

GÉRER ET MESURER LE RISQUE OPÉRATIONNEL



1 jour

Fiche d'inscription
sur www.caritat.fr

Valorisation - Pilotage - Contrôle



À qui s'adresse cette formation ?

Aux dirigeants et cadres responsables de l'organisation, du risk management, du contrôle interne, du projet Solvabilité 2, dans les sociétés d'assurance et de réassurance, les mutuelles et institutions de prévoyance, l'audit et le conseil.

Pour obtenir quoi ?

Comprendre la place du risque opérationnel dans la chaîne des risques du nouvel environnement réglementaire Solvabilité 2. Bénéficier de l'expérience des banques et de l'industrie dans ce domaine. Apprendre quelles sont les méthodes et l'organisation des données nécessaires à la mesure du risque.

Comment ?

Par une manipulation des outils mathématiques de mesure du risque. Par un exercice concret sur le cas d'une banque. Par le recensement des besoins de données et la définition d'une base d'incidents pour un organisme assureur.

Quels sont les pré-requis ?

Connaissances générales en assurance et en statistique.

Qui anime cette formation ?

Jean-Marie NESSI, membre agrégé de l'Institut des Actuariers, ancien dirigeant de sociétés d'assurance et réassurance.



Pierre d'ARGENLIEU, membre de l'Institut Français des Administrateurs, consultant en gestion des risques.

Un actuaire consultant.

Anne CLERC, chargée d'études à la direction risques et assurances de la SNCF.

Qu'allez-vous apprendre ?

COMPRENDRE LE CONTEXTE DU RISQUE OPÉRATIONNEL

Les réformes Bâle 2, Solvabilité 2, Sarbanes-Oxley, IFRS

- Origine. Règles pour les institutions financières
- La place du risque opérationnel
- Expériences acquises
- Convergence et différences entre ces réglementations

Identification et hiérarchisation des risques

- Cartographie
- Gestion des risques

GÉRER ET MESURER LE RISQUE OPÉRATIONNEL : PROFITER DE L'EXPÉRIENCE DE CAS PRATIQUES RÉELS

Les mesures disponibles et leur application au cas d'une institution financière

- Qu'est-ce qu'une mesure ? Définition mathématique
- Les mesures disponibles et leurs limites : mesure d'Esscher, Value at Risk, Tail VaR, Wang
- Les difficultés rencontrées en pratique et leurs contournements
- Critique constructive pour améliorer la base de données

L'exemple de la SNCF

- Construction d'une base de données « incidents »
- Comment analyser et maîtriser le risque opérationnel

SAVOIR UTILISER LA MESURE DU RISQUE OPÉRATIONNEL

- Le risque opérationnel dans la chaîne des risques. Contribution à la volatilité
- Calcul de la charge en capital du risque opérationnel
- Modèle standard / Modèle interne. Pilotage de la variation du SCR

La formation en pratique...

Quand et où ?

9 mars 2010

9 h - 12 h 15 et 13 h 45 - 17 h 30
Salons du Cercle Républicain - Paris 1^o

Combien ça coûte ?

1 190 € HT + TVA 19,60%, soit 1 423,24 € TTC
Les frais de participation couvrent la journée de formation, la documentation complète, le déjeuner et les pauses café.

Où vous loger ?

Si vous venez de province ou de l'étranger, pour toute réservation d'hôtel, contactez notre partenaire :
Elysées West Hôtel - 01 47 75 92 90 - www.ewh.com.
Demandez le tarif Caritat.

Contact :
01 44 51 04 04

! Chaque participant se munira d'un ordinateur portable pour les travaux pratiques.

Qu'en disent les stagiaires ?

Cette formation est une nouveauté du catalogue 2010.