

CONSTRUIRE UNE TABLE DE MORTALITÉ D'EXPÉRIENCE



1 jour

Fiche d'inscription sur www.caritat.fr

Assurances de personnes

À qui s'adresse cette formation ?

Aux actuaires et collaborateurs des directions techniques des sociétés d'assurance et de réassurance, des mutuelles, des institutions de prévoyance, du courtage, de l'audit et du conseil.

Pour obtenir quoi ?

Connaître les méthodes de construction de tables de mortalité instantanées et prospectives. Savoir gérer les données incomplètes. Modéliser le risque catastrophe de mortalité. Savoir utiliser les tables dans le contexte Solvabilité 2 / IFRS.

Comment ?

Les apports théoriques alternent, pendant la formation, avec des travaux pratiques d'application réalisés sur Excel.

Quels sont les pré-requis ?

Connaissances de base en actuariat.

Qui anime cette formation ?

Frédéric PLANCHET, actuaire agrégé, docteur en sciences de gestion, professeur associé à l'ISFA, associé du cabinet WINTER & Associés.



Aymric KAMEGA, actuaire qualifié, consultant chez WINTER & Associés.

Marc JUILLARD, actuaire qualifié, consultant chez WINTER & Associés.



Vivien GUETTE, actuaire consultant au sein du cabinet BAO.

La formation en pratique...

Quand et où ?

25 mars 2010

9 h - 12 h 30 et 14 h - 17 h 30
Centre de conférence Avilis Opéra
Paris 9°

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

Qu'allez-vous apprendre ?



Introduction

- Qu'est-ce qu'une table de mortalité d'expérience ?
- Quelle place dans les contextes Solvabilité 2 et IFRS ?

Les outils pour la modélisation des données tronquées et censurées

- Retour sur les notions de censure et de troncature
- Les approches paramétriques (approche théorique et simplification opérationnelle) et non paramétriques
- La prise en compte de variables de segmentation (Cox, Aalen, etc.)

La construction de tables du moment (risque en cas de décès)

- La constitution d'une base de données fiable
- Les méthodes de construction endogènes et les positionnements
- Les critères de validation et de choix de la table, la mesure du risque d'échantillonnage

La construction de tables prospectives (risque en cas de vie)

- Le cas d'une population de grande taille, retour sur les modèles usuels (Lee-Carter et log-Poisson) et quelques modèles alternatifs
- Le cas d'un portefeuille d'assurés : méthodes de positionnement
- Les critères de validation et de choix de la table, la mesure du risque d'échantillonnage

Le risque catastrophe de mortalité

- La place de ce risque dans Solvabilité 2
- Les modèles envisageables : théorie et mise en œuvre
- Un exemple pratique, comparaison avec le niveau retenu par le modèle standard

Contact :
01 44 51 04 04

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

Qu'en disent les stagiaires ?

« Contenu riche et très bons cas pratiques. »

Virginie V., GIE AXA

« Présentation et supports d'excellente qualité. »

Snějina M. FORTIS ASSURANCES

« Très bons formateurs. »

Charlie B., GROUPAMA