

CONSTRUIRE UN GÉNÉRATEUR DE SCÉNARIOS ÉCONOMIQUES



1 jour

Fiche d'inscription
sur www.caritat.fr

Méthodes et outils d'Actuariat

À qui s'adresse cette formation ?

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

Pour obtenir quoi ?

Comprendre l'utilité des générateurs de scénarios économiques. Connaître les méthodes de construction. Maîtriser les paramètres des modèles. Savoir utiliser un générateur de scénarios dans le contexte Solvabilité 2 / IFRS.

Comment ?

Les apports théoriques alternent, tout au long du stage, avec des travaux pratiques d'application réalisés sur Excel.

Quels sont les pré-requis ?

Connaissances de base en statistique.

Qui anime cette formation ?

Frédéric PLANCHET, actuaire agrégé,
associé du cabinet WINTER & Associés,
professeur associé à l'ISFA.



Aymric KAMEGA, actuaire consultant
au sein du cabinet WINTER & Associés.

Kamal ARMEL,
Telecom Brest / EURIA.



Thibault GUENEE, sous-directeur des
investissements du groupe Le Conservateur.

Qu'allez-vous apprendre ?



Introduction. Pourquoi mettre un place un ESG (Générateur de scénarios économiques) ?

- Le rôle d'un ESG, quel contexte, que peut-on en attendre ?
- Les étapes de sa mise en place
- Comment le maintenir à jour ?

Un exemple de mise en œuvre : le modèle d'Ahlgrim

- La structure du modèle
- Le calibrage des paramètres
- Quelle utilisation ?

Le choix de la structure de dépendance du modèle

- De la dépendance linéaire vers la dépendance non linéaire
- Quelques constants empiriques
- Les conséquences sur le comportement du modèle

Profiter de l'expérience de cas pratiques réels

- La mise en place d'un ESG dans le cadre d'une démarche ALM
- L'alimentation du modèle
- L'exploitation des résultats

Contact :
01 44 51 04 04

La formation en pratique...

Quand et où ?

17 juin 2010

9 h - 12 h 30 et 14 h - 17 h 30
Hôtel Saint Petersburg
Paris 9ème

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

! 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.