

# METTRE EN ŒUVRE LA MODÉLISATION ALM EN ASSURANCE VIE



Modélisation financière

Bulletin de participation sur [www.caritat.fr](http://www.caritat.fr)

## Durée de la formation ?

1 jour.

## À qui s'adresse cette formation ?

Aux actuaires et gestionnaires actif-passif des sociétés d'assurance et de réassurance, des mutuelles et institutions de prévoyance, de l'audit et du conseil, aux product managers, allocataires d'actifs, structureurs des sociétés de gestion, et à toute personne désireuse de maîtriser la modélisation actif-passif en assurance.

## Pour obtenir quoi ?

Connaître et maîtriser les outils de modélisation ALM. Construire un modèle adapté aux contraintes actif-passif. Réaliser les études techniques et financières en vue de gérer les risques.

## Comment ?

Les apports théoriques sont complétés, tout au long de la formation, par des études et travaux pratiques réalisés sous Excel par les participants.

## Quels sont les prérequis ?

Connaissances de base en modélisation financière ou actuarielle.

## Qui anime cette formation ?

### Romain FITOUSSI

Membre qualifié de l'Institut des Actuaires, ancien responsable de l'allocation stratégique BNP Paribas Cardif. Il est désormais responsable des Investissements, de la modélisation ALM et du contrôle de gestion chez MUTEX.



## La formation en pratique...

### Quand et où ?

**16 octobre 2019**

9 h 00 - 12 h 30 et 14 h 00 - 17 h 30  
Caritat, Paris 8°

### Combien ça coûte ?

1 250 € HT + TVA 20%, soit 1 500 € TTC.

Les frais de participation couvrent la journée de stage, la documentation complète, le déjeuner et les pauses café.

**Réduction de 15%** en cas d'inscription simultanée à la formation « Comprendre la gestion actif passif en assurance vie » du 15 octobre 2019.

### Où vous loger ?

Si vous venez de province ou de l'étranger, pour toute réservation d'hôtel, contactez notre partenaire :

Elysées West Hôtel - 01 85 34 72 00

Précisez que vous venez de la part de Caritat.

<http://elysees.hotusa.com/caritat/>

## Qu'allez-vous apprendre ?



### Introduction

- Rôle et contexte d'utilisation des modèles actif passif
- Les principes de projection du bilan
- Enjeux et complexité de mise en œuvre

### L'architecture d'un modèle ALM

- Approche modulaire et méthode de constitution
- La structure du modèle actif passif
- Etapes de projection et de mise en place de l'outil

### Données et hypothèses de projection

- Mise en perspective des problématiques d'alimentation du modèle
- Précision, complétude et agrégation des données (Grouping et granularité des Model Points)
- Calibrage des hypothèses du modèles ALM (Actif, Passif & générateur de scénarios économiques)
- Processus de contrôle de la qualité de données et d'hypothèses de simulation

### Profiter de l'expérience de cas pratiques réels

- Implémentation des blocs constitutifs du modèle ALM d'un fonds en Euros
- De l'alimentation du modèle à la création d'indicateurs d'aide à la décision
- Mesure du risque et indicateurs avancés
- Analyse des premiers résultats simulés
- Test de convergence, analyse de sensibilités et pertinence des résultats

01 44 51 04 00  
[info@caritat.fr](mailto:info@caritat.fr)

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

## Qu'en disent les stagiaires ?

« Programme dense, contenu bien présenté. Formateur agréable et compétent. »

*ED, Actuaire associée – AGPM*

« Diaporama très riche. Le contenu répond à mes attentes. »

*LG, Actuaire associé – GROUPE AGRICA*

« Forme, documents et formateur parfaits. »

*AD, Chargée d'études statistiques – SMAVIE BTP*