

MODÉLISATION DES RISQUES CATASTROPHES DANS LE CADRE D'UN MODÈLE INTERNE OU DE L'ORSA



Assurances dommages

Bulletin de participation sur www.caritat.fr

Durée de la formation ?

2 jours.

À qui s'adresse cette formation ?

Aux actuaires, aux chargés d'études actuarielles, techniciens d'actuariat et collaborateurs des services techniques et bureaux d'études des sociétés d'assurance et de réassurance et des mutuelles.

Pour obtenir quoi ?

Connaître les pré-requis à une approbation de modèle interne. Identifier les exigences et découvrir les principales méthodes de modélisation des périls catastrophes en modèle interne ou ORSA.

Comment ?

Les apports théoriques sont complétés par des travaux pratiques d'application, basés sur des cas réels, effectués sur Excel et R pendant la formation.

Quels sont les prérequis ?

Connaissances actuarielles de base en assurance non-vie. Notions Solvabilité II.

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

Qui anime cette formation ?

Romain NOBIS,

Actuaire certifié membre de l'institut des actuaires, 8 ans d'expérience en modélisation, modèle interne, réassurance, qualité de données et pilotage de projets. Actuellement consultant dans un grand cabinet d'actuariat.



La formation en pratique...

Quand et où ?

27 et 28 janvier 2020

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

Combien ça coûte ?

2 100 € HT + TVA 20 %, soit 2 520 € TTC.
Les frais de participation couvrent les deux journées de formation, la documentation complète, les deux déjeuners 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 85 34 72 00

Précisez que vous venez de la part de Caritat.

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

Qu'allez-vous apprendre ?

Réglementation

- Synthèse sur Solvabilité II
- Le pilier 1 et les modèles internes, normes applicables, conditions d'utilisation et tests, politique de modification
- Le pilier 2 et l'ORSA
- Processus d'approbation d'un modèle interne auprès de l'ACPR : calendrier et déroulements de la pré-candidature et de la candidature, documentation à produire

Phase préalable

- Cartographie des risques, identification des risques majeurs et des périls Cat
- Analyse des données internes : inventaire, qualité et tests, sélection des données appropriées en fonction des périls
- Données externes

Cahier des charges d'un modèle interne

- Etude de besoin
- Définition du périmètre
- Choix d'architecture
- Plan de réalisation et budget

Passage du modèle interne à l'ORSA

- Différences d'objectifs
- Adaptation du modèle « ORSA » : changements d'hypothèses et de paramétrage, mise en adéquation avec une évaluation dynamique et prospective

Mesure et atténuation du risque pour les périls Cat

- Techniques d'atténuation du risque
- Evaluation empirique du risque, modélisation du risque
- Agrégation des risques

Approches de modélisation des différents périls

- Estimation des expositions
- Systèmes d'informations géographiques
- Données manquantes
- Définition des périls
- Présentation de différentes approches pour les différents périls Cat

Agrégation des périls et intégration du modèle

- Analyse des corrélations ou dépendances
- Choix des liens : copules ou matrices de corrélation ?
- Agrégation des périls Cat
- Rattachement du modèle interne des périls Cat à la formule standard ou à un modèle intégral

Analyse et exploitation des résultats

- Critères de validation interne
- Comparaison avec l'historique
- Recalibrage des résultats
- Tests de sensibilité
- Impacts sur le SCR

Extension à l'ORSA

- Adaptation des paramètres de modélisation à l'ORSA
- Intégration du modèle des périls Cat dans l'ORSA
- Impacts sur l'évaluation globale des risques et de la Solvabilité

01 44 51 04 00
info@caritat.fr

Qu'en disent les stagiaires ?

« Bon équilibre entre pratique et théorie. »

AY, Chargé des contrôles permanents et des risques - PACIFICA

« Le programme est tel qu'annoncé : le contenu est très clair. Le formateur est à recommander. »

JM, Chargé d'études actuarielles - GROUPAMA SA

« Formation claire et intéressante. »

BP, Chargé d'études actuarielles - PACIFICA