

Durée de la formation ?

2 jours – 14 heures

À qui s'adresse cette formation ?

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

Pour obtenir quoi ?

Renforcer ses compétences techniques par un exposé complet des méthodes stochastiques de calcul de la provision pour sinistres à payer, dans la perspective des évolutions 'Solvency II', modèles internes, normes IFRS/IAS...

Quels objectifs pédagogiques ?

Maitriser les différents modèles de provision.

Comprendre le calcul de l'erreur d'incertitude d'estimation des provisions.

Savoir analyser et interpréter les résultats.

Quelles méthodes mobilisées ?

Les apports théoriques sont complétés, tout au long de la formation, soit par des travaux pratiques réalisés sous Excel par les participants, soit par des illustrations concrètes de mise en œuvre sous « R » présentées par le formateur.

Quels sont les prérequis ?

Bonnes notions de base en statistiques.

Quelles modalités d'évaluation ?

Une évaluation des acquis des objectifs vous sera proposée en fin de séance.

Qu'allez-vous apprendre ?

La problématique du provisionnement dans l'optique Solvabilité II

Introduction

- Modèles déterministes / modèles stochastiques
- Vision à l'ultime/vision à un an

L'approche Chain-Ladder et quelques modèles déterministes

Une première mesure de l'incertitude : le modèle de Mack (93)

- Définition du modèle et des hypothèses sous-jacentes
- Mise en application et test des hypothèses

Modèles stochastiques

- Rappel sur les GLM
- Les modèles de Mack et ODP (Poisson sur-dispersé)
- Simulation d'une distribution par bootstrap non paramétrique
- Cas pratique : mise en œuvre du modèle ODP

En pratique

- Quels ajustements pratiques
- La modélisation : des hypothèses aux résultats
- Un cas pratique complet

Pour Approfondir

- La vision à un an
- Modélisation des dépendances
- Les modèles bayésiens

Qui anime cette formation ?

Xavier MILHAUD,
Actuaire certifié et Maître de
Conférences à l'ISFA Lyon,
Membre de l'IA et Ingénieur
en Informatique et
Mathématiques Appliquées.



01 44 51 04 00
info@caritat.fr

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

Qu'en disent les stagiaires ?

« Formateur pédagogue, accessible et dynamique. La documentation est très bien faite. J'ai particulièrement apprécié le format des exercices sous Excel, avec la possibilité d'avoir la correction en direct, et donc, de pouvoir suivre les commentaires du formateur sans perdre du temps à recopier les corrections. C'est certainement plus de travail et de préparation pour le formateur, mais c'est très utile pour les participants. »

CF, Chargée d'études actuarielles – MMA

« Exposé clair et appliqué, mise en pratique directe très appréciable. »

CK, Actuaire certifié - Risk management – CNP

« Programme bien suivi et bien expliqué. Documents et travaux pratiques très explicites. »

DK, Chargé d'études statistiques en risques – CARREFOUR

La formation en pratique...

Quand et où ?

4 et 5 octobre 2021

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.