



### Durée de la formation ?

2 jours – soit 14 heures.

### À qui s'adresse cette formation ?

Aux professionnels de la gestion des risques, des services techniques et bureaux d'études des mutuelles, des institutions de prévoyance, des sociétés d'assurance et de réassurance, de l'audit et du conseil.

### Pour obtenir quoi ?

Avoir une vision opérationnelle de l'ORSA, c'est-à-dire des process et calculs à mettre en place pour satisfaire aux exigences de la norme Solvabilité II.

### Quels objectifs pédagogiques ?

**Maîtriser** le concept de l'ORSA.

**Appréhender** le contexte réglementaire.

**Présenter** les différents risques.

**Montrer** des outils « simples » pour la mesure de risques.

**Saisir** le fonctionnement d'un générateur de scénarios.

**Faciliter** la compréhension par de nombreux exemples.

### Quelles méthodes mobilisées ?

La mise en application s'effectue pendant le stage, par des travaux pratiques sous Excel. Les exercices d'application seront basés sur des données réelles, issues du monde de l'assurance de personnes (risques techniques et financiers).

### Quels sont les prérequis ?

Formation "Découvrir et comprendre l'ORSA" ou connaissances équivalentes.

### Quelles modalités d'évaluation ?

Une évaluation des acquis des objectifs sera réalisée durant la formation.

## Qui anime cette formation ?

### Edouard HARDY,

Manager en actuariat chez  
Grant Thornton.



## La formation en pratique...

### Quand et où ?

**27 et 28 septembre 2023**

9 h 00 - 12 h 30 et 14 h 00 - 17 h 30  
Caritat, Paris 8<sup>e</sup>

### Combien ça coûte ?

2 300 € HT + TVA 20 %, soit 2 760 € TTC.  
Les frais de participation couvrent les deux journées de formation, la documentation complète, les déjeuners et les pauses café.

## Qu'allez-vous apprendre ?

### Introduction

- Piler 2 de la directive Solvabilité II
- Gestion des risques
- ORSA

### Rappels des textes sur l'ORSA

- Issues Paper
- Directive Solvabilité II
- Règlement 2015-35
- Orientations de l'EIOPA

### Risques traités

- Action
- Taux
- Spread
- Immobilier
- Change
- Souverain
- Mortalité
- Longévité
- Santé

### Thèmes abordés pour chaque risque

- Modélisation stochastiques historiques ou théoriques
- Estimation de la Var à un niveau de confiance donné
- Ecart avec les hypothèses Solvabilité II
- Calcul de corrélation entre les risques
- Techniques informatiques pour optimiser les calculs

*Des exemples concrets seront déroulés tout au long de la formation, afin d'illustrer les concepts théoriques.*

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 ?

« Contenu des exposés et mise en pratique très intéressante, très bonne formation orientée sur la pratique. »

*BS, Actuaire certifiée et expert ERM-CERA – SURAVENIR*

« Bonne organisation, très intéressant. »

*AG, Actuaire associé et Chargé d'études financières – PREPAR VIE*

« Excellente pédagogie. »

*AK – CIGNA INTERNATIONAL*

Cette formation est proposée en partenariat avec

