



Durée de la formation ?

1 jour – soit 7 heures.

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.

Quels objectifs pédagogiques ?

Définir les hypothèses de modélisation à l'actif et au passif.

Maîtriser les étapes de construction d'un modèle.

Interpréter les résultats d'un modèle ALM.

Quelles méthodes mobilisées ?

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.

Quelles modalités d'évaluation ?

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

Qui anime cette formation ?

Alain CORDANI,

Membre associé de la Society Of Actuaries, diplômé de l'ISFA et actuellement actuaire chez Mutex. Au cours de sa carrière, il a développé une expertise sur les sujets de modélisation en assurance vie et en ALM.



La formation en pratique...

Quand et où ?

11 juin 2024

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

Combien ça coûte ?

1 350 € HT + TVA 20%, soit 1 620 € TTC.

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

Réduction de 15% sur la 2^{ème} inscription en cas d'inscription simultanée à la formation « Comprendre la gestion actif-passif en assurance vie » du 10 juin 2024.

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

! 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