

# CONSTRUCTION ET UTILISATION DE LOIS D'EXPÉRIENCE : APPROCHES AVANCÉES



1 jour

Fiche d'inscription sur [www.caritat.fr](http://www.caritat.fr)

Prévoyance - Santé

## À qui s'adresse cette formation ?

Aux actuaires et collaborateurs des directions techniques des sociétés d'assurance et de réassurance, des mutuelles, des institutions de prévoyance, du courtage, de l'audit et du conseil, et toute personne confrontée à la mise en place de tables d'expérience.

## Pour obtenir quoi ?

La journée est destinée à permettre une utilisation efficace d'approches avancées de construction de lois d'expérience, dans le cadre de la construction de lois 'best estimate'.

## Comment ?

Les apports théoriques alternent, pendant la formation, avec des travaux pratiques d'application réalisés sur R.

## Quels sont les pré-requis ?

Connaissances de base des problématiques de construction de tables d'expérience.

## Qui anime cette formation ?



Frédéric PLANCHET, actuaire agrégé, docteur en sciences de gestion, professeur à l'ISFA, associé au cabinet PRIM'ACT.

Aymric KAMEGA, actuaire qualifié, enseignant associé à l'EURIA, directeur de mission au cabinet PRIM'ACT.



Quentin GUIBERT, actuaire qualifié, docteur en sciences de gestion, post-doctorant au LSAF, consultant chez PRIM'ACT.

## Qu'allez-vous apprendre ?



### Utilisation des méthodes de vraisemblance locale

- Les limites des approches traditionnelles pour les lois complexes (arrêt de travail, dépendance, présence d'hétérogénéité)
- Présentation des méthodes de vraisemblance locale
- Mise en œuvre sur des exemples

### Prendre en compte le risque d'estimation

- Problématiques de construction en présence d'un échantillon limité
- Présentation et mesure du risque d'estimation (tables de mortalité du moment et prospective)
- Pilotage du risque d'estimation (tables de mortalité du moment et prospective)

### Les approches multi-états

- Le cadre multi-états en arrêt de travail et en dépendance
- Estimation des probabilités de transition
- Comparaison avec l'approche du praticien

### La prise en compte dans le besoin en capital de l'incertitude sur les lois

- Les risques associés à la construction de tables d'expérience
- Leur impact sur les provisions techniques, lien avec les « binary events »
- Quelle prise en compte dans le capital économique ?

## La formation en pratique...

### Quand et où ?

**14 octobre 2016**

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

### Combien ça coûte ?

1 220 € HT + TVA 20%, soit 1 464 € TTC.  
Les frais de participation couvrent la journée de formation, la documentation complète, le déjeuner 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 47 75 92 90 - [www.ewh.com](http://www.ewh.com). Précisez que vous venez de la part de Caritat

### Contact :

01 44 51 04 00

Mail

[info@caritat.fr](mailto:info@caritat.fr)

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

## Qu'en disent les stagiaires ?

« Très satisfaite du contenu et des présentations. »

C. M., ACM

« Une présentation très claire. »

J. A., BPCE VIE