

LA NOTION DE VALEUR EN ASSURANCE VIE



1 jour

Bulletin de participation
sur www.caritat.fr

Épargne - Retraite - Vie

42^{pts} P.P.C.
CLASSEUR

À qui s'adresse cette formation ?

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

Pour obtenir quoi ?

Maîtriser les méthodes de valorisation d'un portefeuille de contrats en assurances de personnes, d'un point de vue analytique et dans la perspective d'une gestion des risques organisée dans l'entreprise et de la mise en place de modèles internes.

Comment ?

Les cours théoriques sont complétés, pendant le stage, par des travaux pratiques sur Excel.

Quels sont les prérequis ?

Bonnes notions de base techniques et financières en assurance vie.

Qu'allez-vous apprendre ?

Introduction : Évolution de la culture du risque

- La valeur : les aspects réglementaires (Solvabilité II), comptables (IFRS), communication financière (EEV)
- Intégration de la valeur dans la gestion des risques (ERM)

Embedded Value ou Valeur Intrinsèque (EV)

- Généralités
- Embedded Value déterministe : Traditional Embedded Value (TEV)
- Embedded Value stochastique :
- European Embedded Value (EEV)
- Market Consistent Embedded Value (MCEV)

→ Cette partie est illustrée d'exemples en épargne

Élaboration d'un modèle interne (contexte Solvabilité II)

- L'importance de la modélisation prospective
- Les étapes clés
- La modélisation stochastique
- Processus de simulation : Monte Carlo, Bootstrap
- Application numérique : taux d'intérêt, actions
- Tests de validation
- Différence entre la théorie « risque-neutre » et le « monde réel »

→ Application pratique sur un contrat en épargne

Pilotage et reporting

- Mesure de sensibilités
- New Business
- Analyse des mouvements
- Les points-clés d'un rapport d'Embedded Value au travers d'un exemple

Conclusion

- Vers une gestion cohérente

Qui anime cette formation ?

Pierre PORET,

Actuaire Manager expert sur les travaux de modélisation prospective. Membre de l'Institut des Actuaires. Il a réalisé des missions de modélisation prospective sur différents modèles internes. Il co-anime enfin le Groupe de Travail d'Optimind sur le multinorme.



Leonel NGOMO,

Consultant chez Optimind, il a réalisé plusieurs missions valorisation et de modélisation.



La formation en pratique...

Quand et où ?

26 septembre 2018

9 h 00 - 12 h 30 et 14 h 00 - 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 85 34 72 00

Précisez que vous venez de la part de Caritat.

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

01 44 51 04 00
info@caritat.fr

Qu'en disent les stagiaires ?

« Le contenu est clair, précis. Le professeur est très disponible et à l'écoute. »

LY, Chargé d'études actuarielles - ALLIANZ

« Le programme est très opérationnel. »

GD, Manager études actuarielles - NATIXIS

« Formation complète avec des exemples pertinents. »

DC, Actuaire associé et Chef de projet actuariat - MAIF



Cette formation est proposée en partenariat avec



5 rue Tronchet - 75008 Paris
Tél. : 01 44 51 04 00 - Fax : 01 44 51 04 09
www.caritat.fr

SIRET 477 962 690 00020