

PRATIQUE DU CALCUL DU BILAN PRUDENTIEL, DU BEST ESTIMATE ET DU SCR EN ASSURANCE NON-VIE



1 jour

Bulletin de participation
sur www.caritat.fr

Assurances dommages

42 Pts PPC
CARRIF

À qui s'adresse cette formation ?

Aux actuaires, chargés d'études et collaborateurs des services techniques, comptables, financiers et directions des risques des sociétés d'assurance non-vie et de réassurance, des courtiers, de l'audit et du conseil.

Pour obtenir quoi ?

Comprendre et analyser les causes de la volatilité du résultat de l'entreprise. Utiliser le modèle standard comme modèle interne simplifié. Détailler les opérations de passage à Solvabilité II en matière d'inventaire et de liasses des comptes.

Comment ?

Les apports théoriques et historiques sont complétés par des travaux pratiques réalisés sous Excel/Java par les participants, grâce à un logiciel pédagogique conçu à cet effet et présenté par le formateur.

Quels sont les prérequis ?

Bonnes notions de base en assurance non-vie.

01 44 51 04 00
info@caritat.fr

Qui anime cette formation ?

Hervé NESSI,
Directeur technique
à la CCR, membre qualifié de
l'Institut des Actuaires.



La formation en pratique...

Quand et où ?

5 juillet 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/>

Qu'allez-vous apprendre ?

Quelle que soit votre fonction dans l'entreprise, vous pourrez vous situer dans la chaîne des risques d'une société d'assurance et découvrir de qui vous dépendez et qui vous alimentez en matière d'information.

À partir d'exemples de portefeuilles concrets et réalistes, vous apprendrez et comparerez l'approche déterministe Solvabilité I et l'approche stochastique Solvabilité II.

Chaque risque de la formule standard sera analysé, expliqué et mesuré. Vous découvrirez leurs poids relatifs. Vous vous familiariserez avec les phénomènes de corrélation, de dépendance et de diversification.

Enfin vous vous sensibiliserez au calcul de la marge de solvabilité (comptabilité prudentielle) et à sa couverture (comptabilité internationale).

Analyse des différentes causes de volatilité du résultat

Historique de la notion de solvabilité

- Solvabilité I. Analyse critique.
- Solvabilité II et les réponses qu'elle apporte

Présentation des règles comptables IFRS

- Bilan solvabilité I / Bilan solvabilité II
- Impact et changement au 31.12.2012

Prise en main du logiciel de simulation

- Comment modéliser le risque d'actif
- Particularité de la marge de risque en assurance non vie
- Comment modéliser le risque de passif
- Prendre en compte la réassurance
- Comprendre et paramétrer la matrice de corrélation

Applications et sensibilité

- Tester différents jeux de paramètres :
 - méthodes de tarification
 - variations de la sinistralité
 - traités de réassurance
 - etc.
- Découvrir les conséquences sur la volatilité du résultat
- Tester la sensibilité aux hypothèses de corrélation

Conclusion

Le modèle standard versus un modèle interne.

Qu'en disent les stagiaires ?

« Programme offrant une vision globale de Solvabilité II, puis bloc par bloc. Outil pédagogique simplifié permettant d'illustrer la théorie. Appréciable. Points de vue et expériences des formateurs très intéressants. »

AB, Chargée d'études statistiques - MATMUT

« La forme et le contenu des exposés sont pertinents. »

FOY, Chargée de risques techniques - PACIFICA

« Documents, supports adaptés à la formation. Bonne pédagogie du formateur ! »

JPS, Actuaire études techniques - AVIVA ASSURANCES