



### Durée de la formation ?

1 jour – soit 7 heures.

### À qui s'adresse cette formation ?

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

### Pour obtenir quoi ?

Comprendre l'utilité des générateurs de scénarios économiques. Connaître les méthodes de construction. Maîtriser les paramètres des modèles. Savoir utiliser un générateur de scénarios dans le contexte Solvabilité II / IFRS.

### Quels objectifs pédagogiques ?

**Comprendre** les scénarios économiques en probabilités historique et risque-neutre.

**Savoir** structurer un GSE.

**Savoir** calibrer un GSE.

### Quelles méthodes mobilisées ?

Les apports théoriques alternent, tout au long du stage, avec des travaux pratiques d'application réalisés sur Excel.

### Quels sont les prérequis ?

Connaissances de base en statistique.

### Quelles modalités d'évaluation ?

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

## Qu'allez-vous apprendre ?

### Introduction : Pourquoi mettre en place un ESG (Générateur de scénarios économiques) ?

- Le rôle d'un ESG, quel contexte, que peut-on en attendre ?
- Les approches risque-neutre (calculs de provisions) et historique (ORSA et ALM)
- Les points d'attention majeurs
- Les principes de construction, d'estimation et de mise en œuvre
- Discussion sur la structure de dépendance entre les risques

### Exemple numéro 1 : un GSE « risque neutre »

- La structure du modèle
- Le calibrage des paramètres
- Le choix du modèle de taux en période de taux négatifs

### Exemple numéro 2 : un GSE « historique »

- La structure du modèle
- Le calibrage des paramètres
- Quelle articulation avec le GSE « risque neutre » dans le cadre de l'ORSA ?

01 44 51 04 00  
[info@caritat.fr](mailto:info@caritat.fr)

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

## Qui anime cette formation ?

### Frédéric PLANCHET,

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



### Quentin GUIBERT,

Consulting actuary chez PRIM'ACT et Professeur à temps partiel à l'Université Dauphine.



### Sugiban RATNASOTHY,

(ISFA), Manager chez PRIM'ACT depuis 2013.



## Qu'en disent les stagiaires ?

« Les explications des formateurs étaient absolument claires avec la présentation bien structurée. Grâce à une discussion, Monsieur PLANCHET a résolu un problème qui était resté dans ma tête avant ce cours. Merci beaucoup ! »

*WW, Actuaire indépendant*

« Excellente connaissance du sujet et bon rythme (bon panorama des problématiques avec focus sur des exemples concrets). »

*GD, Responsable LPI – HSBC*

« Formateurs agréables, communicants et pédagogues. »

*AG, Actuaire Gestion Actif-Passif – CARAC*

## La formation en pratique...

### Quand et où ?

**14 octobre 2022**

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

### Combien ça coûte ?

1 250 € HT + TVA 20 %, soit 1 500 € TTC.

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

Cette formation est proposée en partenariat avec

