caritat
RECHERCHE & FORMATION

CERTIFICAT DE COMPÉTENCES ACTUARIELLES

Solvabilité II

Janvier 2022

ffp
Fédération de la Formation Professionnelle

SOLVABILITÉ II

6j

Ce parcours donne aux membres qualifiés de l'Institut des Actuaires

PPC 252

DURÉE DU PARCOURS ?

Un programme de 6 jours (42 heures) compatible avec une activité professionnelle. Le Certificat est construit autour de la mise en œuvre d'un projet pédagogique sur un rythme de 2 jours par mois sur 3 mois. Un examen de validation le clôture.

À QUI S'ADRESSE CE CERTIFICAT ?

Aux personnes intervenant dans les travaux Solvabilité II, aux responsables et opérationnels incarnant les fonctions clés de la « Gestion des Risques » et « Actuariat », aux membres de la Direction Générale, et à l'ensemble des membres du Conseil d'Administration.

POUR OBTENIR QUOI ?

- Maîtriser et comprendre les exigences liées à la Directive Solvabilité II,
- Comprendre les différents mécanismes d'établissement des calculs du pilier 1 et les leviers attachés, disposer de connaissances approfondies sur le pilier 2 et 3 de la Directive,
- Comprendre les enjeux de la Gouvernance au sens de Solvabilité II et connaître l'ensemble des rapports et états quantitatifs,
- Obtenir un Certificat Caritat de compétences professionnelles reconnu par la profession.

QUELS OBJECTIFS PÉDAGOGIQUES ?

- Sensibiliser les participants aux exigences des trois piliers de la Directive SII,
- Etre à même de pouvoir appréhender les sujets quantitatifs avec le nouveau ration de solvabilité,
- Comprendre les thèmes de gouvernance et de gestion des risques (ORSA) ainsi que les exigences de reporting.

QUELLES MÉTHODES MOBILISÉES ?

Les apports théoriques sont complétés par des travaux pratiques d'application sous Excel. Un examen final permet de valider l'acquisition du Certificat Caritat.

QUELS SONT LES PRÉREQUIS ?

Connaissances de base en assurance, finance et comptabilité ainsi que dans la manipulation d'Excel.

QUELLES MODALITÉS D'ÉVALUATION ?

Une évaluation des acquis des objectifs sera réalisée durant la formation, et déterminera l'obtention du Certificat.

Le Certificat en pratique…

Quand et où ?

20 et 21 octobre,
21 et 22 novembre,
14 et 15 décembre 2022
9 h 00 - 12 h 30 et 14 h 00 - 17 h 30
Caritat, Paris 8° ou à distance
(Zoom, Webex ou Teams)

Combien ça coûte ?

Parcours complet :
6 000 € HT + TVA 20 %, soit 7 200 € TTC.

Les frais de participation couvrent les journées de formation, la documentation complète, les déjeuners et les pauses café (en format présentiel).

L'accès au parcours est acquis à l'issue d'un court entretien avec le responsable pédagogique.

LES POINTS FORTS

Une vision complète de la directive SII, appuyée sur des retours d'expériences et un benchmark du marché.

Une présentation sur mesure basée sur des échanges entre les participants et les formateurs.

Des exercices pratiques qui illustrent les aspects les plus techniques du Certificat.

Un responsable pédagogique expert du domaine, entouré d'un panel d'intervenants spécialisés.

SOLVABILITÉ II

Module 1 : Mesurer la richesse économique et quantifier le risque sous Solvabilité II

Introduction et Pilier I

Introduction à la norme Solvabilité II

- Comprendre les raisons du contrôle, le contexte réglementaire et la hiérarchie des textes de loi

Mesurer la richesse économique des organismes d'assurance

- Comprendre le passage du bilan comptable au bilan prudentiel
- Comprendre la construction du bilan prudentiel (avec approfondissements sur le calcul des provisions techniques, le calcul des impôts différés) avec des exemples sur Excel
- Mesurer le niveau de richesse de l'organisme d'assurance

Pilier I

Mesurer le risque des organismes d'assurance

- Comprendre l'approche « formule standard »
- Comprendre le calcul et la signification des différents modules de risques, avec exemples
- Mesurer le niveau des risques de l'organisme d'assurance (calcul du SCR et MCR)

Déterminer la solvabilité de l'entreprise

- Comprendre la signification des indicateurs de solvabilité
- Approche critique et premiers pas vers l'ORSA

Module 2 : L'ORSA, un outil d'aide à la décision

Pilier II

Focus sur l'ORSA – Approche théorique

- Comprendre l'intérêt d'un processus ORSA
- Identifier les étapes du processus ORSA et la méthodologie de travail (évaluer le besoin global de solvabilité, démontrer la solvabilité continue, construire une vision prospective et réaliser des scénarios de stress tests).

Pilier II

Focus sur l'ORSA – Approche pratique

- Mise en pratique – Etude de cas pour la réalisation d'un ORSA
- Comprendre les enjeux des stress tests et savoir les interpréter
- Initiation à l'appétence aux risques

En partenariat

© Caritat

Module 3 : Les principes du Risk Management sous SII et l'ensemble du reporting SII

J.1

Pilier II

La gestion des risques

- Comprendre le système de gestion des risques instauré par Solvabilité II
- Comprendre la notion de « Compétence et Honorabilité »
- Comprendre le rôle de l'AMSB
- Comprendre le rôle des fonctions clés
- Comprendre les politiques écrites

J.2

Pilier II

Comprendre le reporting QRT et ENS

- Comprendre le format de reporting européen
- Identifier les informations à communiquer dans les QRT au-delà des travaux du pilier I

Identifier le contenu des rapports narratifs

- Décrypter le contenu des rapports RSR et SFCR

NOS INTERVENANTS

Responsable pédagogique

Frank BOUKOBZA
Dirigeant
ACTUELIA

Jean-Marie NESSI
Président
CARITAT

Kévin MA
Consultant senior
ACTUELIA

Maxime GEORGET
Manager
ACTUELIA

Patrick COHEN
Consultant senior
ACTUELIA

En partenariat

ACTUELIA
Conseil · Audit · Formation en Actuariat

© Caritat