

LA TRANSPARISATION DU PORTEFEUILLE FINANCIER DANS SOLVABILITÉ II



Solvabilité II

Bulletin de participation sur www.caritat.fr

Durée de la formation ?

1 jour.

À qui s'adresse cette formation ?

À toutes les personnes intervenant sur les placements dans les organismes d'assurance soumis à Solvabilité II.

Pour obtenir quoi ?

Une compréhension des enjeux et des opportunités liés à la transparence du portefeuille financier.

Comment ?

Par la présentation des enjeux réglementaires ainsi que des applications pratiques de stratégies de transparence sur des données réelles.

Quels sont les prérequis ?

Connaissances de base sur Excel et sur la directive Solvabilité II.

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

Qui anime cette formation ?

Edouard HARDY,
Manager en actuariat chez
Grant Thornton.



La formation en pratique...

Quand et où ?

20 novembre 2020

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.

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 ?



Introduction et contexte réglementaire

- Définition de l'approche par transparence ou « look-through approach »
- Titres concernés par l'approche par transparence
- Règlement délégué 2015/35 (Article 84)
- Orientation EIOPA 14/171 « Orientations sur l'approche par transparence »

La gestion opérationnelle de la transparence

- Approches possibles (transparence complète, allocation cible du fond, proxy, action type 2)
- Gestion des fonds de fonds et niveaux de transparence
- Application de la correcte stratégie de transparence en lien avec :
 - L'impact au niveau du SCR marché
 - Le principe de proportionnalité
 - Les contraintes liées aux délais de reporting
- Utilisation de la transparence dans l'ORSA

La qualité des données

- Responsabilité de la qualité des données
- Gestion de la multitude des sources
- Le format TPT (Tripartite Template) et le besoin de standardisation
- Automatisation nécessaire du traitement des données

Le reporting

- L'état 5.06.03 (Organismes de placement collectif (OPC) – Approche par transparence)
- Contrôles avec les états 5.06.01 (Résumé des actifs) et 5.06.02 (Liste des actifs)

01 44 51 04 00

info@caritat.fr

Qu'en disent les stagiaires ?

« Formateur motivé et qui sait garder l'attention des participants. Support agréable et adéquat et exercices pertinents. »

ET, Chargée d'études actuarielles – AXA WEALTH EUROPE

« Formation axée cas pratiques conforme à mes attentes. »

EV, Actuaire – BÂLOISE VIE

Cette formation est proposée en partenariat avec



Grant Thornton
L'instinct de la croissance