LES INVESTISSEMENTS EN ASSURANCE

Modélisation et gestion d'actifs

Bulletin de participation sur www.caritat.fr

PPC 42

Durée de la formation ?

1 jour – soit 7 heures.

À qui s'adresse cette formation ?

Aux collaborateurs des directions d'investissement ou techniques des sociétés d'assurance et de réassurance, des mutuelles et institutions de prévoyance, de l'audit et du conseil, et plus généralement à toute personne souhaitant développer sa compréhension des enjeux de la gestion d'actif au sein de son institution.

Pour obtenir quoi ?

Un panorama complet sur les actifs côtés et non côtés d'un investisseur institutionnel au niveau financier, comptable et prudentiel.

Quels objectifs pédagogiques ?

Enrichir sa compréhension des différentes classes d'actif.

Maîtriser les risques liés aux spécificités des actifs.

Analyser ex-ante et ex-post un support d'investissement dans le non côté.

Quelles méthodes mobilisées ?

Les apports théoriques sont complétés par des exemples concrets et des travaux pratiques sur Excel.

Quels sont les prérequis ?

Connaissances de base d'un actif d'assurance et de ses composants.

Quelles modalités d'évaluation ?

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

Qui anime cette formation ?

Gabriele BALAGNA,
Détenteur d'un Master en finance quantitative de l'université de Turin, certifié CFA (Chartered Financial Analyst) et CAIA (Chartered Alternative Investment Analyst), il est Responsable des investissements non cotés chez Le Conservateur.

La formation en pratique…

Quand et où ?

4 décembre 2023
9 h 00 - 12 h 30 et 14 h 00 - 17 h 30
Caritat, Paris 8° ou En distanciel (ZOOM)

Combien ça coûte ?

1 350 € HT + TVA 20%, soit 1 620 € TTC.
Les frais de participation couvrent la journée de formation, la documentation complète, le déjeuner et les pauses café.

Qu'allez-vous apprendre ?

A. Les investissements côtés

Valorisation, aspect comptable et traitement en solvabilité 2

- Revue des divers types d'obligations (taux fixes, taux variables, indexées inflations, convertibles).
- Approfondissement des classes d'actif diversifiantes (actions, gestion alternative, produits structurés).

TP Stress tests d'actifs, calcul Solvabilité 2
TP Construction de pay-offs optionnels pour l'institutionnel

B. Les investissements non côtés

1. Revue des 4 principales classes d'actif

Valorisation, aspect comptable et traitement en solvabilité 2

- L'immobilier : revue des différents formats juridiques et de leurs caractéristiques
- Le private equity : étapes d'investissement (courbe en J), présentation des différentes stratégies de fonds (Venture Capital, Growth capital, LBO)
- Les actifs d'infrastructures.
- La dette privée (dettes corporate, infrastructure, mezzanine, autres)

2. Le processus de sélection et de suivi d'un fonds

- La due diligence
  - DD qualitative
  - DD quantitative
  - DD opérationnelle
- Le processus de suivi
- Périodes clés (souscription, investissements, liquidation)
- Appels et distributions
- Indicateurs (exemples)

TP calcul d'indicateurs de performance par classe d'actif

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

01 44 51 04 00
info@caritat.fr

Qu'en disent les stagiaires ?

Cette formation est une nouveauté du catalogue Caritat.