



Durée de la formation ?

1 jour – soit 7 heures.

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 transparisation du portefeuille financier.

Quels objectifs pédagogiques ?

Appréhender le contexte réglementaire et la gestion opérationnelle de la transparisation.

Maîtriser le calcul du SCR marché.

Renforcer la qualité des données et le reporting lié à la transparisation.

Quelles méthodes mobilisées ?

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

Quels sont les prérequis ?

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

Quelles modalités d'évaluation ?

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

Qui anime cette formation ?

Edouard HARDY,
Manager en actuariat chez
Grant Thornton.



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 transparisation

- Approches possibles (transparisation complète, allocation cible du fond, proxy, action type 2)
- Gestion des fonds de fonds et niveaux de transparence
- Application de la correcte stratégie de transparisation en lien avec :
 - L'impact au niveau du SCR marché
 - Le principe de proportionnalité
 - Les contraintes liées aux délais de reporting
- Utilisation de la transparisation 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 S.06.03 (Organismes de placement collectif (OPC) – Approche par transparence)
- Contrôles avec les états S.06.01 (Résumé des actifs) et S.06.02 (Liste des actifs)

01 44 51 04 00
info@caritat.fr

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

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

La formation en pratique...

Quand et où ?

10 octobre 2024

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

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.

Cette formation est proposée en partenariat avec



Grant Thornton
L'instinct de la croissance