

PILOTAGE ET ALLOCATION DES ACTIFS DANS LE CONTEXTE SOLVABILITÉ II



Solvabilité II

Bulletin de participation sur www.caritat.fr



Durée de la formation ?

1 jour – soit 7 heures.

À qui s'adresse cette formation ?

Aux dirigeants (DG, Président, DAF, Directeurs techniques) et membres des organes de décision (Conseil d'Administration, Bureau ou comités spécialisés) des organismes d'assurance, institutions de prévoyance et mutuelles.

Pour obtenir quoi ?

Des connaissances sur le contexte réglementaire des actifs sous Solvabilité II.

Une présentation des risques financiers contrainte pour les décisions stratégiques d'allocation. Une présentation des possibilités d'allocation d'actifs dans le cadre fixé par l'ORSA.

Quels objectifs pédagogiques ?

Être à même de **pouvoir appréhender** les sujets quantitatifs avec le nouveau ratio de solvabilité notamment concernant les placements.

Analyser les stratégies de placements à l'aide de l'ORSA compte tenu des contraintes réglementaires.

Renforcer les compétences des participants à l'aide de cas pratiques pour appréhender le pilotage du ratio de solvabilité.

Quelles méthodes mobilisées ?

Une formation théorique ponctuée par la mise en pratique afin de s'approprier les concepts clés.

Quels sont les prérequis ?

Connaissance de base en assurance ainsi que sur les fondamentaux Solvabilité II en particulier le Pilier 1.

Quelles modalités d'évaluation ?

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

Qu'allez-vous apprendre ?

Comprendre le contexte technique et réglementaire des actifs sous Solvabilité II

La formule standard

- Cartographie des risques de marché selon le Pilier I
- Modélisation des risques financiers et de défaut dans la formule standard
- Rappels : construction du bilan prudentiel SII et calcul complet de SCR et de MCR

ORSA : Besoin Global de Solvabilité et analyse prospective

- Adéquation des risques standards au profil de risque spécifique
- Construction d'un scénario central de développement
- Mesure d'impact de l'allocation d'actifs sur les risques financiers

Stress tests

- Construction de scénarii alternatifs tenant compte de dérives financières futures
- Présentation d'un cas pratique

Appétence et pilotage

- Expression d'une appétence au risque dans le contexte SII
- Tolérance au risque et préparation des limites Marché
- Utilisation de l'ORSA pour mesurer l'impact d'un changement d'allocation d'actifs.

Des exemples concrets seront déroulés tout au long de la formation, afin d'illustrer les concepts théoriques.

01 44 51 04 00
info@caritat.fr

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

Qui anime cette formation ?

Frank BOUKOBZA,
Membre certifié de l'Institut des Actuaires, actuaire-conseil, dirigeant du cabinet Actuelia.



Qu'en disent les stagiaires ?

« Parfait. Beaucoup d'échanges. »

C.D., Directeur Général adjoint finance moyens et gestion – MNT

« Le formateur est compétent et maîtrise son sujet. Ce qui rend le contenu de la formation accessible et compréhensible. »

C.N.N., Actuaire inventaire – KLESIA

La formation en pratique...

Quand et où ?

4 juin 2026

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

ACTUELIA
Conseil - Audit - Formation en Actuariat