



### Durée de la formation ?

1 jour – soit 7 heures.

### À qui s'adresse cette formation ?

Aux acteurs de la gestion actif passif en assurance vie, qui produisent ou vont produire des résultats et veulent mieux comprendre les enjeux de leurs travaux. Aux autres acteurs de l'assurance vie qui souhaitent se former à la gestion actif passif en assurance vie.

### Pour obtenir quoi ?

Comprendre les objectifs de la gestion actif passif (ALM), les outils et le fonctionnement, et comment tout ceci se met en place à travers des exemples.

### Quels objectifs pédagogiques ?

**Comprendre** les enjeux de la production d'indicateurs ALM ;

**Identifier** les risques inhérents à la gestion de contrats d'assurance vie à composante financière ;

**Quantifier** l'impact de ces risques.

### Quelles méthodes mobilisées ?

La formation adopte une méthode progressive combinant exposés théoriques, cas pratiques et exemples concrets. Elle s'appuie sur le cadre réglementaire (normes françaises, Solvabilité 2 et IFRS 17) et d'autres contraintes réelles pour proposer une démarche structurée de maîtrise des risques.

### Quels sont les prérequis ?

Maîtrise d'Excel pour les exercices.

### Quelles modalités d'évaluation ?

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

### Qui anime cette formation ?

#### Fabrice BARBE,

Actuaire diplômé de l'ISFA, il est également membre certifié de l'institut des actuaires. Il accompagne depuis plus de 10 ans les assureurs et réassureurs vie dans leurs enjeux techniques, réglementaires et stratégiques. Il met un point d'honneur à rendre accessible des sujets complexes en articulant rigueur actuarielle, pragmatisme et vision globale.



### La formation en pratique...

#### Quand et où ?

**4 novembre 2026**

9 h 00 - 12 h 30 et 14 h 00 - 17 h 30

Caritat, Paris 8°

#### 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 ?

#### Les enjeux de la gestion financière des contrats d'assurance vie et l'allocation de base utilisée

- Rappels sur les produits d'assurance vie
- Produits avec et sans composante épargne

#### Le cadre réglementaire imposé aux assureurs : normes françaises, Solvabilité 2 et IFRS 17

- Description du bilan
- Focus sur les réserves

#### Les enjeux de modélisation à travers des exercices simples

- Compte de résultat
- SCR
- Matching duration

#### Les objectifs de la gestion actif passif ou ALM

- Présentation des différentes parties prenantes
- Les différentes missions de la gestion des risques
- Les principaux risques identifiés ainsi que leur définition

#### Les stratégies employées par la gestion des risques

- La démarche générale
- Présentation des différentes stratégies
- Exemples de stratégies utilisées
- Présentation des indicateurs classiques de suivi de risque
- Focus sur les sensibilités actif-passif
- Création d'un indicateur de suivi des risques

#### Ouverture sur l'allocation stratégique et les frontières efficientes

01 44 51 04 00  
[info@caritat.fr](mailto:info@caritat.fr)

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

### Qu'en disent les stagiaires ?

« Explications très claires, les cas d'usage étant bien adaptés au cours. »

*RJ, Responsable de la gestion des actifs financiers – MUTUELLE DE POITIERS ASSURANCES*

« Formateur très clair et pédagogue. »

*GL, Souscripteur Réassurance Santé Prévoyance – MMA IARD SA*