

Durée de la formation ?

1 jour – soit 7 heures.

À qui s'adresse cette formation ?

Aux actuaires et gestionnaires actif-passif des sociétés d'assurance et de réassurance, des mutuelles et institutions de prévoyance, de l'audit et du conseil, aux product managers, allocataires d'actifs, structureurs des sociétés de gestion, et à toute personne désireuse de maîtriser la modélisation actif-passif en assurance.

Cette formation est spécialement conçue pour les débutants et les personnes de niveau intermédiaire souhaitant approfondir leur compréhension de la modélisation ALM.

Pour obtenir quoi ?

Comprendre et maîtriser les principes fondamentaux de la modélisation ALM. Apprendre à construire un modèle ALM adapté aux contraintes actif-passif.

Quels objectifs pédagogiques ?

Définir les hypothèses de modélisation à l'actif et au passif. **Maîtriser** les étapes de construction d'un modèle ALM. **Comprendre** les mécanismes et les composantes des modèles ALM.

Quelles méthodes mobilisées ?

Les apports théoriques sont complétés, tout au long de la formation, par des études et travaux pratiques réalisés sous Excel par les participants.

Quels sont les prérequis ?

Connaissances de base en modélisation financière ou actuarielle.

Quelles modalités d'évaluation ?

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

Qu'allez-vous apprendre ?

Introduction

- Rôles et contexte d'utilisation des modèles actif-passif
- Les principes de projection du bilan
- Enjeux et complexité de mise en œuvre

Généralités sur les modèles ALM

- Principales caractéristiques d'un modèle ALM
- Architecture d'un modèle ALM
- Inputs et outputs d'un modèle ALM

Modélisation de l'actif

- Inputs liés à l'actif : scénarios économiques et base d'actifs
- Projection des différentes classes d'actifs (actions, obligations, produits dérivés...)
- Stratégies de réallocation d'actifs

Modélisation des interactions actif/passif

- Modélisation des rachats dynamiques
- Algorithme de participation aux bénéfices
- Focus sur l'approche par flexings

Notions diverses

- Analyse du coût des options et garanties
- Validation d'un modèle ALM via l'écart de convergence
- Notions diverses dans le cadre de Solvabilité 2

Cas pratiques réels

- Interprétation des variables projetées sous différents scénarios économiques
- Études d'allocation stratégique d'actifs
- Analyses de résultats de sensibilités sur les métriques SII

Qui anime cette formation ?

Mordehaï ROOS,

Actuaire certifié de l'institut des Actuaires, qui accompagne les organismes d'assurance sur divers sujets telle que Solvabilité 2, inventaire, produits et audit. Il est consultant manager au sein du cabinet ACTUELIA



01 44 51 04 00
info@caritat.fr

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

La formation en pratique...

Quand et où ?

23 novembre 2026

9 h 00 - 12 h 30 et 14 h 00 - 17 h 30
6^{ème} Madeleine, Paris 8^e

Combien ça coûte ?

1 620 €

Les frais de participation couvrent la journée de formation, la documentation complète, le déjeuner et les pauses café.

Réduction de 15% sur la 2^{ème} inscription en cas d'inscription simultanée à la formation « Comprendre la gestion actif-passif en assurance vie » du 25 novembre 2026.

Qu'en disent les stagiaires ?

- « Programme dense, contenu bien présenté. Formateur agréable et compétent. »
ED, Actuaire associée – AGPM
- « Diaporama très riche. Le contenu répond à mes attentes. »
LG, Actuaire associé – GROUPE AGRICA
- « Forme, documents et formateur parfaits. »
AD, Chargée d'études statistiques – SMAVIE BTP