DÉFINITION, CONSTRUCTION ET APPLICATION DE LA COURBE DE TAUX À L'ACTUARIAT ET « SOLVENCY II »

Solvabilité II

Bulletin de participation sur www.caritat.fr

PPC 84

Durée de la formation ?

2 jours – soit 14 heures.

À qui s'adresse cette formation ?

À toute personne souhaitant comprendre, construire et utiliser les courbes de taux en finance et en actuariat.

Pour obtenir quoi ?

Acquérir une expertise en courbe de taux, valoriser et couvrir les produits de taux en finance et en actuariat.

Quelles méthodes mobilisées ?

En utilisant des modèles de construction des courbes de taux calibrés sur des données de marchés.

Quels sont les prérequis ?

Avoir des connaissances en finance et en actuariat.
Avoir des notions sur le pricing de produits de taux (Obligation, taux IBOR, FRA, Futur, Swap, Cap/Floor, Swaption, etc…)
Avoir des connaissances en mathématiques.

Quelles modalités d'évaluation ?

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

Qui anime cette formation ?



Slim SAANOUNI,
Actuaire certifié diplômé de l'ISUP et de la Sorbonne, possède une expertise en ALM et en modélisation financière et des risques.

Qu'allez-vous apprendre ?

Définition des taux d'intérêt

- Les différentes dénominations du taux d'intérêt
- Le taux d'intérêt simple
- Le taux d'intérêt composé
- Le taux d'intérêt exponentiel
- Exemples et cas pratiques

Définition des courbes de taux

- Courbe de taux « spot » ou « forward »
- Types de courbes de taux : « Marché » ou « Implicite »
- Familles de courbes de taux : « Interbancaire », « Etat » ou « Corporate »
- Exemples et cas pratiques

Pricing des produits de taux

- Obligations
- Contrats futurs
- Swaps
- Cap / Floor

Construction des piliers de la courbe de taux Zéro-Coupon

- Piliers « Courts Termes »
- Piliers « Moyens Termes »
- Piliers « Longs Termes »

Construction de la courbe de taux Zéro-Coupon par modèle d'Interpolation & Bootstraping

Pricing de produits dérivés de taux : Cap, Floor & Swaption

Construction de la courbe de taux Zéro-Coupon par modèle Nelson-Siegel

- Modèle de Smith Wilson
- Modèle de Nelson-Siegel
- Modèle HJM
- Modèle LMM
- Application et utilisation dans l'actuariat et « Solvency II »

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 ?

17 et 18 décembre 2026
9 h 00 - 12 h 30 et 14 h 00 - 17 h 30
Caritat, Paris 8e

Combien ça coûte ?

2 760 €.
Les frais de participation couvrent les journées de formation, la documentation complète, les déjeuners et les pauses café.

Qu'en disent les stagiaires ?

« Programme bien structuré. Les documents fournis permettaient de bien comprendre les concepts, les exercices illustraient bien les concepts. »

JD, Reserving Actuary – SCOR

« Le formateur était très clair. »

KN, Responsable d'audit interne – FOYER ASSURANCES