LA TRANSPARISATION DU PORTEFEUILLE FINANCIER DANS SOLVABILITÉ II

Solvabilité II

Bulletin de participation sur www.caritat.fr

PPO 42

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,
Directeur Actuaire 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.

La formation en pratique…

Quand et où ?

22 septembre 2027
9 h 00 - 12 h 30 et 14 h 00 - 17 h 30
Caritat, Paris 8e

Combien ça coûte ?

1 620 €
Les frais de participation couvrent la journée de formation, la documentation complète, le déjeuner et les pauses café.

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

Cette formation est proposée en partenariat avec Grant Thornton L'instinct de la croissance