

Objectifs

- > **Comprendre l'utilité de la valeur en gestion des risques (ERM)**
- > Se familiariser avec la logique de valeur « *Market Consistent* »
- > Savoir déchiffrer les rapports d'*Embedded Value* publiés

EV, Notion de valeur en assurance-vie Introduction : Évolution de la culture du risque

- > La valeur : aspects réglementaires (Solvabilité II), comptables (IFRS) et communication financière (EEV)
- > Notion d'*Enterprise Risk Management* (ERM)
- > Comment bien évaluer la performance et le potentiel des activités vie d'une compagnie d'assurance ?

Embedded Value ou Valeur Intrinsèque (EV)

- > Généralités
- > Définitions des notions
- > Modélisations
- > Évolutions
- > Reporting

Traditional Embedded Value (TEV): EV déterministe

- > Évaluation classique et déterministe : méthodologie, critiques, limites
- > Application pratique sur un contrat d'épargne en euro

De l'*European Embedded Value* (EEV) à la *Market Consistent Embedded Value* (MCEV)

- > Principes
- > Méthodologie
- > Limites

Génération de scénarios économiques

- > Modélisation stochastique
- > Processus de simulation : Monte Carlo, *Bootstrap*
- > Application numérique : taux d'intérêt, actions

Évaluation cohérente avec le marché

- > Théorie « risque-neutre »
- > Théorie des déflateurs
- > Application numérique

Outils de modélisation, de pilotage et de reporting

- > Focus sur MoSes et Prophet
- > Analyse des mouvements
- > New Business
- > Mesures de sensibilité

Les horaires

Durée : 7 heures
9 h 00 : Accueil des participants
9 h 15 : Début du stage
17 h 30 : Fin du stage
 Pauses Café : **10 h 45** et **16 h 00**
 Déjeuner : **12 h 30 - 14 h 00**

Tarif

1050 euros + 19,6 % de TVA.
 Tarif dégressif en fonction du nombre de formations

Les formateurs

Chez Optimind, les formateurs, au minimum diplômés de niveau BAC +5, sont de cursus en rapport direct avec la thématique de formation traitée, Actuaires, Ingénieurs financiers, techniques, etc. et salariés de notre entreprise. Cette règle, qui ne tolère aucune exception, est pour nous le gage de leur capacité à comprendre les métiers et les enjeux de nos clients. Affectation au budget formation : Optimind est enregistré en tant qu'organisme de formation. A ce titre, les budgets engagés par nos clients sur ces activités peuvent être imputés à leurs budgets de formation permanents.

Qui sommes-nous ?

Société d'actuariat conseil, OPTIMIND est un interlocuteur de référence pour les assureurs, mutuelles, banques et grandes entreprises qui souhaitent un partenaire métier les accompagnants dans leurs projets.

Lieu

Optimind
 46 rue La Boétie
 75008 Paris

Ces formations s'adressent aux collaborateurs des directions métiers, produit, modélisation, contrôle des risques, comptabilité, inventaires, contrôle de gestion, systèmes d'information ou des commerciaux des Compagnies d'assurance, Mutuelles, et Institutions de Prévoyance.