

17
novembre
2011

Valeur en Assurance Vie

Modélisations, méthodologies et pilotage

- 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

Introduction : Évolution de la culture du risque

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

Embedded Value : le calcul de Valeur en assurance vie

- > Concepts & Généralités
- > Vers une normalisation des calculs sous l'impulsion du CFO Forum : de la TEV à la MCEV
- > Outils de pilotage et de reporting
- > Enjeux fonctionnels & besoins de technicités croissantes

Exemples pratiques de mise en œuvre

- > Calcul de la TEV sur un contrat d'épargne en euro
- > Valorisation de la valeur temps des options et des garanties financières

Une montée en puissance en matière de modélisation prospective

- > Principes généraux et fonctionnement
- > Focus sur Moses et Prophet

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

Les horaires

Durée : 7 heures
 9 h 15 : Accueil des participants
 9 h 30 : 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 de conseil en actuariat et gestion des risques, OPTIMIND est un interlocuteur de référence pour les assureurs, mutuelles, banques et grandes entreprises qui souhaitent un partenaire métier les accompagnant 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.