

22

Novembre
2011

Petit-déjeuner conférence

La Recherche & Développement au service des modèles prospectifs L'exemple des copules et de la logique floue

La modélisation prospective constitue aujourd'hui un élément incontournable pour gérer l'activité d'assurance, notamment suite aux évolutions des exigences prudentielles avec la réforme Solvabilité II et comptables avec les normes IFRS. Les enjeux portent autant sur des problématiques quantitatives de modélisation et de valorisation économique que sur des aspects qualitatifs de suivi et de management des risques.

Optimind, avec l'intervention de Frédérique Henge et Matthias Pillaudin, actuaires, vous propose à l'occasion de ce petit-déjeuner conférence, de vous présenter comment des sujets techniques R & D peuvent aboutir à des utilisations concrètes au service de la modélisation prospective : les copules pour l'évaluation continue et prospective des risques et la logique floue pour la modélisation du comportement des assurés.

Intervenants :

Frédérique Henge, actuaire R & D
Matthias Pillaudin, actuaire consultant

8h30 : Accueil des participants

9h00 : Introduction

9h05 : Partie 1 : L'apport de la théorie des copules pour l'évaluation continue et prospective de la rentabilité d'un portefeuille

- > *Le suivi de la rentabilité sous Solvabilité II*
- > *Analyse multivariée et copules*
- > *Construction d'un business plan prospectif à l'aide des copules elliptiques*
- > *Développements futurs*

9h40 : Partie 2 : La modélisation des lois comportementales via la logique floue

- > *Les enjeux de la modélisation prospective en assurance vie*
- > *La théorie de la logique floue*
- > *La commande floue : une application de la logique floue*
- > *Les apports et les inconvénients en matière de modélisation*

10h10 : Conclusion

10h15 : Questions / réponses

10h30 : Fin du petit-déjeuner

Les horaires

Durée : 1h30
8h30 : Café d'accueil
9h00 : Présentation
10h15 : Question-réponse
10h30 : Fin du petit-déjeuner

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.

Où ?

Optimind – Auditorium
46 rue La Boétie
75008 Paris

Le nombre de places étant limité,
nous vous invitons à confirmer votre présence avant 16 novembre 2011.
Pour vous inscrire : pdj@optimind.fr / Réf. 111122