

AE018

PERFECTIONNEMENT

1 jour 7 heures

860 €

Déjeuners offerts
Exonérés de TVA

Gestion actif-passif en assurance

Comprendre et s'entraîner aux détails et méthodes

OBJECTIFS

- Comprendre la gestion actif-passif
- Découvrir les principes, calculs et méthodes de Gestion actif-passif
- S'entraîner avec un cas pratique

PROGRAMME

A. ACTIF

1. Classification des actifs selon le code des assurances
2. Actifs admis en représentation des engagements vis-à-vis des assurés
3. Règles prudentielles
4. Réglementation relative aux produits dérivés selon les normes IFRS
5. Réserve de capitalisation
6. Provision pour dépréciation durable
7. Provision pour risque d'exigibilité

B. MÉCANISMES DE PARTICIPATION AUX BÉNÉFICES

1. Intérêts techniques
2. Taux minimum garanti
3. Participation aux bénéfices et la réglementation associée

C. PROVISIONS D'ACTIF-PASSIF

1. Provision pour aléas financiers
2. Représentation des engagements techniques
3. Principe de congruence

D. MARGE DE SOLVABILITÉ

1. Principes et définitions
2. Calcul de la marge constituée
3. Calcul du besoin de marge

E. RISQUES ET GESTION ACTIF-PASSIF

1. Objectifs
2. Segmentation des actifs et des passifs
3. Méthodologie et Hypothèses
4. Résultats
5. Illustration par un cas pratique sur un portefeuille d'assurance vie

PUBLIC

- Chargés d'études actuarielles
- Gestionnaires de back-office
- Conseillers en gestion de patrimoine
- Auditeurs internes
- Consultants

PRÉ-REQUIS

Formations IFPASS suivies ou connaissances équivalentes. AA115

POINTS FORTS


Le formateur expose les principes clés de la gestion actif-passif. Un exercice permet de valider les connaissances des participants.

FORMATEUR(S)

Cette formation est animée par un professionnel de l'actuariat, formateur expert de l'ifpass.

SESSION(S) 2019

PARIS

Le 28 mai 

Le 7 novembre

Session(s) continue(s)

Disponible en régions sur demande

PERSONNALISATION DE PARCOURS

Un questionnaire préparatoire sera remis en amont de la formation au participant lui permettant de faire remonter auprès du formateur ses attentes et besoins spécifiques.

VALIDATION

Une attestation sera remise au stagiaire à la fin de la formation.