NOUVEAU

AE057	BASES	1 jour 7 heures	850 €	Déjeuners offerts Exonérés de TVA

Mise en place d'un modèle simplifié de projections ORSA pour une mutuelle santé

COMPÉTENCES VISÉES

- Appréhender les grands principes de la gestion actif/passif (ALM)
- Disposer de clés pour comprendre le fonctionnement de modèles ALM
- Être en mesure de développer un modèle simplifié de projections ORSA pour une mutuelle Santé

PROGRAMME

A. INTRODUCTION

1. Objectifs principaux de la gestion actif / passif en assurance
2. Principaux acteurs en assurance
3. Principaux risques en assurance

B. ENGAGEMENTS DES ASSUREURS

1. Principaux types de produits en Epargne/Retraite
2. Spécificités de la Santé par rapport à l'Epargne/Retraite

C. GESTION D'ACTIFS DES ASSUREURS

1. Principales classes d'actifs
2. Notion d'allocations d'actifs financiers
3. Gestion d'actifs au service du paiement des engagements

D. PRINCIPES DE MODÉLISATION ACTIF/PASSIF

1. Notion d'adossement actif/passif comme outil de pilotage
2. Modèles de projection actif/passif
   a) intérêts de l'utilisation de modèle actif/passif comme outil de pilotage
   b) principes généraux
   c) principal enjeu : la modélisation des interactions actif/passif
   d) importance des hypothèses et paramètres retenus pour les projections
3. Illustration : Elaboration d'un compte de résultat

E. CAS PRATIQUE

1. Développement d'un modèle ALM simplifié (Santé)
   a) Projection des actifs
   b) Projection des passifs (engagements)
   c) Projection du bilan
   d) Projection du SCR (à l'aide de proxies élémentaires)
   e) Projection du ratio prudentiel
2. Points d'attention lors du développement et de l'utilisation d'un modèle ALM simplifié
3. Présentation d'un modèle de projection ORSA pour une mutuelle Santé (utilisation de proxies)

F. CONCLUSION

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 DES ACQUIS

- Évaluation des acquis de la formation par des cas pratiques, exercices, QCM...
- Questionnaire d'évaluation à chaud proposé à la fin du stage
- Une attestation sera remise au stagiaire à la fin de la formation

PUBLIC

- Collaborateurs de compagnies d'assurance et mutuelles

PRÉ-REQUIS

Connaissances générales en assurances et Solvabilité 2

POINTS FORTS

Vision complète des problématiques de gestion actif/passif
Cas pratique détaillé d'application aux projections ORSA pour une mutuelle santé

FORMATEUR(S)

Cette formation est animée par un professionnel de l'assurance automobile, formateur expert de l'Ifpass.

SESSION(S) 2022

Dates disponibles sur le site www.ifpass.fr

Session(s) continue(s)

© Conception / Réalisation Ifpass - Novembre 2021