

Calculer les besoins en fonds propres des assureurs sur la base de modélisation des facteurs de risques de marché

### PUBLIC

Actuaires – Managers et collaborateurs des fonctions ALM et trésorerie – Relation Institutionnels – Analystes ALM – Risk managers – Conformité – Consultants SSII dans le secteur de l'assurance – Agents généraux – Banquiers privés

### PRÉ-REQUIS

Avoir de solides connaissances mathématiques, une bonne maîtrise d'Excel et une première expérience sur le sujet

### NIVEAU D'EXPERTISE

Expertise

### MOYENS PÉDAGOGIQUES

- Dispositif de formation structuré autour du transfert des compétences
- Acquisition des compétences opérationnelles par la pratique et l'expérimentation
- Apprentissage collaboratif lors des moments synchrones
- Parcours d'apprentissage en plusieurs temps pour permettre engagement, apprentissage et transfert
- Formation favorisant l'engagement du participant pour un meilleur ancrage des enseignements

### SATISFACTION ET EVALUATION

- L'évaluation des compétences sera réalisée tout au long de la formation par le participant lui-même (auto-évaluation) et/ou le formateur selon les modalités de la formation.
- Evaluation de l'action de formation en ligne sur votre espace participant :
  - ▶ A chaud, dès la fin de la formation, pour mesurer votre satisfaction et votre perception de l'évolution de vos compétences par rapport aux objectifs de la formation. Avec votre accord, votre note globale et vos verbatims seront publiés sur notre site au travers d'Avis Vérifiés, solution Certifiée NF

Code  
**157**

Durée  
**1 jour / 7 heures**

Tarif Inter\*  
**1 318 € HT**

\*Repas inclus (en présentiel)

## Objectifs pédagogiques

- Décortiquer les modalités de calcul des sous-modules de SCR bruts de marché et de contrepartie
- Décomposer les facteurs de risque sur les fonds et les produits complexes, les montages avec couverture
- Calculer les besoins quantitatifs des assureurs

## Programme de la formation

### Engagement

Vous vous engagez dans votre formation. Connectez-vous sur votre espace participant et complétez votre questionnaire préparatoire. Votre formateur reçoit vos objectifs de progrès.

## Décortiquer les modalités de calcul des sous-modules de SCR bruts de marché et de contrepartie

### Lister les calculs

- Taux d'intérêt, action (type 1/2/infrastructure QII & QICI/LTEI/Private Equity), spread -dont infrastructure-, devise et immobilier
- Besoins annexes pour le sous-module SCR brut de contrepartie

### Causes et effets des dispositifs de correction des risques

- Dampener
- Prime contra-cyclique
- Matching adjustment
- Exercice d'application

## Décomposer les facteurs de risque sur les fonds, les produits complexes et les couvertures financières

Déterminer les besoins quantitatifs des assureurs auprès des sociétés d'asset management auprès desquelles ils détiennent des fonds

- Architecture des données attendues par les assureurs
- Pour réaliser les calculs
- Pour alimenter le reporting du Pilier 3 (QRT et rapports narratifs)

#### Service

- ▶ A froid, 60 jours après la formation pour valider le transfert de vos acquis en situation de travail
- Suivi des présences et remise d'une attestation individuelle de formation ou d'un certificat de réalisation

#### ACCOMPAGNEMENT FORMATION À DISTANCE

En cas de nécessité, une assistance technique et pédagogique est joignable entre 8h30 et 18h (jours ouvrés):

- par téléphone : 01 83 10 10 10
- par mail : [care-formation@lefebvre-dalloz.fr](mailto:care-formation@lefebvre-dalloz.fr)

Une réponse immédiate est apportée ; si besoin, le demandeur est mis en relation avec un expert dans un délai maximum de 48h.

#### • Exercice

## Calculer les besoins quantitatifs des assureurs

### Évaluer le SCR sur des actifs financiers complexes

- Exemple d'une obligation convertible en action
- Etude de cas : un fonds diversifié avec couverture

### Intégrer ORSA rappel des objectifs

- Compenser les limites du SCR
- Prendre en compte la tolérance au risque
- Introduire une vision prospective (durabilité, vision « going concern » versus « run-off »)
- Dispositif de gouvernance
- Etude de cas : exemples d'indicateurs susceptibles d'être suivis en matière de gestion des actifs
- Références réglementaires entre un assureur Solvabilité 2 et un FRPS IORP2
- Brainstorming : comparaison des règles de comptabilisation et de solvabilité entre Solvabilité 2 et FRPS (Loi Sapin2/IORP2)

### Transfert

Votre parcours de formation se poursuit dans votre espace participant. Connectez-vous pour accéder aux ressources et faciliter la mise en œuvre de vos engagements dans votre contexte professionnel.

## A noter

... —————

En amont et en aval de la formation, le positionnement pédagogique sera effectué à l'aide d'un questionnaire d'auto-positionnement.

## Prochaines sessions

...

### PARIS

- 24 Nov. 2026
- 9 Déc. 2026

### A DISTANCE

- 24 Nov. 2026
- 9 Déc. 2026

