

ALLOCATION STRATÉGIQUE ET GESTION DES RISQUES

Quelle allocation stratégique optimale sous ORSA

1 JOUR, 7 HEURES

FINANCE / SOLVABILITÉ II

Objectifs de la formation

- Maîtriser le cadre du pilotage des actifs sous Solvabilité II
- Etablir la cartographie des risques financiers et opérationnels pour passer aux décisions stratégiques d'allocation
- Optimiser votre allocation d'actifs dans le cadre fixé par l'ORSA

Animée par

- **BOUKOBZA Frank**
Actuaire certifié,
ACTUELIA
- **CHALENDARD Romaric**
Consultant Actuaire,
ACTUÉLIA

Public concernés

- aux directions financières, aux directions des investissements, aux directions actif/passif, aux asset managers, aux directions comptables, aux directions de l'actuariat

Dates

Critères d'admission

- Cette formation entre dans le champ d'application des dispositions relatives à la formation professionnelle continue car considérée comme une action d'adaptation et

Accueil des participants

Comprendre le cadre du pilotage des actifs respecter sous Solvabilité II

- Quelle gouvernance mettre en place
- Quel processus ALM et allocation d'actifs définir
- Comment piloter les risques grâce à l'ORSA

Etablir les processus et la cartographie des risques financiers et opérationnels

- Définition de la typologie des risques
- Quelles évolutions du dispositif de cartographie prévoir

Passer de la cartographie aux décisions stratégiques d'allocation

de développement des compétences des salariés.

Prérequis

- Aucun prérequis n'est nécessaire

Modalités pédagogiques

- Un questionnaire préalable sera envoyé aux participants pour recueillir leurs besoins et attentes spécifiques, et sera transmis au(x) formateur(s) avant la formation
- Tous nos stages de formations sont limités, dans la mesure du possible, à une douzaine de participants
- Les formations sont déroulées en présentiel ou en classe virtuelle et étayées, chaque fois que cela est pertinent, d'études de cas et de mise en pratique ou en situation
- Un formulaire d'évaluation du formateur et du déroulé du programme suivi sera proposé aux participants à la fin du stage

- Appréhender les enjeux de la gestion prospective des risques
- Comment identifier et quantifier les risques
- Quelle articulation entre allocation stratégique et pilotage opérationnel de la gestion : classes d'actifs, indicateurs de pilotage et suivi des risques

Déjeuner

Considérer les enjeux de la délégation de gestion d'actifs

- Comment mettre en conformité vos délégations de gestion d'actifs avec Solvabilité II
- Comment maîtriser le risque de délégation : rédaction des mandats et prospectus, qualité des données et du reporting

Optimiser votre allocation d'actifs dans le cadre fixé par l'ORSA

- Définir clairement vos objectifs
- Délimiter vos contraintes
- Choisir votre allocation de risque

Fin de journée
