GESTION D'ACTIFS

Mettre en place une stratégie efficiente
sous Solvabilité II

2 JOURS, 14 HEURES

FINANCE / SOLVABILITÉ II

CODE : AFI06

Objectifs de la formation

Appliquer les principes fondamentaux de la gestion d'actif / passif sous Solvabilité II

Identifier les évolutions réglementaires impactant la gestion d'actifs pour les organismes soumis à Solvabilité II

Identifier des leviers de pilotage, de maîtrise des risques et d'optimisation des rendements des investissements

Parmi nos formateurs

- **DELESTRADE Isabelle**
  Directrice Risk Management & Développement,
  PÉRICLÈS ACTUARIAL

Public concernés

- DAF; Responsables financiers ; Gérants d'actifs ; Conformité ; Gestion des Risques ; Audit et Contrôle interne ; Comptables ; Contrôleurs de gestion ; Analystes financiers ; Responsables investissement

Prérequis

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

Tarifs

- Tarif Session en classe virtuelle : 1 650,00 €HT
- Tarif Session en présentiel : 1 755,00 €HT

JOUR 1

Introduction à la gestion actif/passif sous le prisme prudentiel

- Connaître le cadre réglementaire des placements et leur traitement sous Solvabilité II
- Maîtriser la structure des interactions entre actif et passif
- Exercice : Calculs d'engagements entre l'assuré et l'assureur basé sur un cas de contrat épargne retraite)
- Cas pratique : sous excel, application à travers un mécanisme ALM (Optimisation de la stratégie d'allocation d'un fonds euro)
- Intégrer les méthodes et techniques de la gestion actif passif : adossement de flux et gestion de risques
- Test de connaissance : question sur les objectifs de la gestion actif passif

Anticiper, évaluer et piloter la gestion des investissements

- Quels sont les objectifs d'une stratégie d'investissement
- Cas pratique : sur la base d'un rapport public, analyse et présentation des objectifs d'une stratégie d'investissement
- Gouvernance et pilotage de la stratégie d'allocation d'actifs dans un environnement contraint
- Mesurer et gérer les risques liés au bilan
- Savoir mettre en place les indicateurs de suivi spécifiques : gap de trésorerie, sensibilités, SCR marché

CAS PRATIQUE **Etude de cas : analyse des impacts d'une variation des taux d'intérêt (Gestion du risque de hausse des taux, couverture dynamique)**

CAS PRATIQUE **Retour d'expérience : analyse d'un tableau de bord type de suivi qui peut être montré en comité de direction**

ILLUSTRATION **Analyse d'un rapport public: profil des risques du groupe (et de tous les indicateurs)**

JOUR 2

Optimiser la gestion d'actifs pour les organismes soumis à Solvabilité 2

- Diversifier un portefeuille d'actifs sous contraintes prudentielles
- Optimiser le ratio de couverture S2 : modéliser la solvabilité future en fonction de l'allocation stratégique
- Savoir utiliser le modèle ALM dans les calculs d'applications concrètes: calcul d'un BEL et d'un module du SCR
- Illustrations : graphiques et modélisation d'actifs, passifs, des risques et des rendements

Assurer la mise en œuvre de votre système de gestion

- Maîtriser les différents modes de gestion, les types de délégation
- Partage d'expériences : sélection d'un AM (cf AFI09)
- Comment mettre en place d'un mandat de gestion : du choix du délégataire à la prise en main des investissements et de leur maîtrise et suivi
- Identifier les impacts de l'allocation d'actifs sur l'ORSA, et analyser les managements actions utilisés

Quels choix de placements au regard des enjeux conjoncturels ?

- Choisir les stratégies efficaces pour la couverture des risques financiers
- Maîtriser les techniques d'immunisation en taux entre actif et passif
- Connaître les investissements alternatifs et les perspectives économiques
- Illustration : Présentation des différents stratégiques de couverture des risques en fonction de son statut (assureur / réassureur ...)
- Etude d'un rapport public sur les variations de sensibilité des taux
- Brainstorming sur les investissements alternatifs et perspectives économiques dans un contexte de taux bas, de baisse des marchés financiers (private equity, nouveaux fonds,etc.)

Dates

Paris	Classe virtuelle
14-15/10/2024	14-15/10/2024
13-14/11/2024	13-14/11/2024

Modalités pédagogiques, d'évaluation et techniques

- **Modalités pédagogiques:**

Pour les formations synchrones-présentiel ou classes virtuelles (formations à distance, en direct), les stages sont limités, dans la mesure du possible, à une douzaine de participants, et cherchent à respecter un équilibre entre théorie et pratique. Chaque fois que cela est possible et pertinent, des études de cas, des mises en pratique ou en situation, des exercices sont proposées aux stagiaires, permettant ainsi de valider les acquis au cours de la formation. Les stagiaires peuvent interagir avec le formateur ou les autres participants tout au long de la formation, y compris sur les classes virtuelles durant lesquelles le formateur, comme en présentiel peut distribuer des documents tout au long de la formation via la plateforme. Un questionnaire préalable dit 'questionnaire pédagogique' est envoyé aux participants pour recueillir leurs besoins et attentes spécifiques. Il est transmis aux intervenant(e)s avant la formation, leur permettant de s'adapter aux publics. Pour les formations en E-learning (formations à distance, asynchrones), le stagiaire peut suivre la formation à son rythme, quand il le souhaite. L'expérience alterne des vidéos de contenu et des activités pédagogiques de type quizz permettant de tester et de valider ses acquis tout au long du parcours. Des fiches mémos reprenant l'essentiel de la formation sont téléchargeables. La présence d'un forum de discussion permet un accompagnement pédagogique personnalisé. Un quizz de validation des acquis clôture chaque parcours. Enfin, le blended-learning est un parcours alternant présentiel, classes virtuelles et/ou e-learning.

- **Modalités d'évaluation:**

Toute formation se clôture par une évaluation à chaud de la satisfaction du stagiaire sur le déroulement, l'organisation et les activités pédagogiques de la formation. Les intervenant(e)s évaluent également la session. La validation des acquis se fait en contrôle continu tout au long des parcours, via les exercices proposés. Sur certaines formations, une validation formelle des acquis peut se faire via un examen ou un QCM en fin de parcours. Une auto-évaluation des acquis pré et post formation est effectuée en ligne afin de permettre à chaque participant de mesurer sa progression à l'issue de la formation. Une évaluation à froid systématique sera effectuée à 6 mois et 12 mois pour s'assurer de l'ancrage des acquis et du transfert de compétences en situation professionnelle, soit par téléphone soit par questionnaire en ligne.

- **Modalités techniques FOAD:**

Les parcours sont accessibles depuis un simple lien web, envoyé par Email aux stagiaires. L'accès au module de E-learning se fait via la plateforme 360Learning. La durée d'accès au module se déclenche à partir de la réception de l'invitation de connexion. L'accès aux classes virtuelles se fait via la plateforme Teams. Le(a) stagiaire reçoit une invitation en amont de la session lui permettant de se connecter via un lien. Pour une bonne utilisation des fonctionnalités multimédia, vous devez disposer d'un poste informatique équipé d'une carte son et d'un dispositif vous permettant d'écouter du son (enceintes ou casque). En ce qui concerne la classe virtuelle, d'un microphone (éventuellement intégré au casque audio ou à la webcam), et éventuellement d'une webcam qui permettra aux autres participants et au formateur de vous voir. En cas de difficulté technique, le(a) stagiaire pourra contacter la hotline au 01 70 72 25 81, entre 9h et 17h ou par mail au logistiqueformations@infopro-digital.com et la prise en compte de la demande se fera dans les 48h.