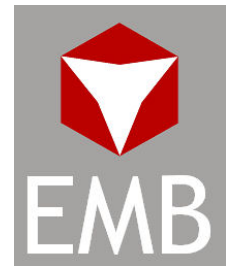


Volatilité du provisionnement en IARD

Comment évaluer "Best Estimate", "Risk Margin" et risque de provisionnement pour Solvabilité II ?

Hôtel Ambassador, 16 boulevard Haussmann, Paris 9e
Mardi 19 juin 2007



Programme

Heure	Présentation
09:30	Accueil
10:00	10:15 Introduction <i>Comment passer du provisionnement déterministe au provisionnement stochastique ?</i> Stéphane Chappellier
10:15	10:45 La place du provisionnement dans Solvabilité II <i>Comment les nouvelles mesures de provisionnement impacteront les comptes (best estimate et Risk Margin), d'une part et le modèle interne de risques (risque de provisionnement), d'autre part ?</i> Stéphane Chappellier
10:45	11:15 Revue des méthodes utilisées pour obtenir un Best Estimate <i>Plusieurs méthodes doivent être adoptées pour obtenir le best estimate, lesquelles choisir ? En quoi les données, la segmentation ou les regroupements jouent-ils un rôle ?</i> Jennifer Ah-Kin
11:15	11:30 Pause
11:30	12:15 Mesurer la volatilité des provisions par une approche stochastique <i>Examen des fondements théoriques de l'approche stochastique</i> Peter England (présentation en anglais)
12:15	14:00 Déjeuner
14:00	15:00 ResQ : outil EMB pour le provisionnement déterministe et stochastique <i>Illustration des fonctionnalités de notre outil sur des études de cas correspondant à des problèmes concrets : traitement des valeurs manquantes, bootstrap en présence d'une liquidation favorable des provisions, volatilité du facteur de queue...</i> Fabien Faivre et Peter England
15:00	15:30 Méthode stochastique de projection des sinistres individuels <i>Comment traiter les sinistres graves et leur réassurance ?</i> Karl Murphy (présentation en anglais)
15:30	15:45 Pause
15:45	16:15 Prise en compte du risque de provisionnement dans un modèle interne Solvabilité II <i>Quelle place pour le risque de provisionnement ? Comment l'intégrer ? Comment le mesurer ?</i> Fabien Faivre
16:15	16:30 Conclusion, questions et réponses Stéphane Chappellier
16:30	Clôture