

Journées d'Etudes IARD de l'Institut des Actuaire

CONSTRUCTION D'UN MODELE INTERNE : OUTILS ET MOYENS

Jeudi 25 mars 2010 : Les bases théoriques et les moyens

09 h 15 : Accueil

09 h 30 : Rappel des principes de la Directive Solvabilité II.

10 h 00 : État des lieux des CP à la fin mars 2010, vers QIS 5 (M. Gueganou - Ernst & Young)

11 h 00 : Pause

11 h 30 : La définition des modèles internes dans la directive, aspects réglementaires. (Régis Weisslinger - ACAM)

12 h 15 : Repas

14 h 00 : Les étapes de la construction d'un modèle interne (Jean-Marc Boyer - FIXAGE)

15 h 00 : Pause

15 h 30 : Techniques d'analyse des dépendances :

- Les statistiques bayésiennes (Emmanuel Mazer - PROBAYES)

- Les copules (Gilles Depommier - ALTIA)

17 h 00 : Exemple de construction d'un modèle interne dans une compagnie d'assurance IARD.

Vendredi 26 mars 2010 : Présentations par les éditeurs de logiciels de modèles internes

9 h 15 : Accueil

9 h 30 : Présentation ACTUARIS

10 h 15 : Présentation METARISK

11 h 00 : Pause

11 h 30 : Présentation EMB IGLOO

12 h 15 : Repas

14 h 00 : Présentation REMETRICA

14 h 45 : Présentation RISKLINK

15 h 30 : Pause

16 h 00 : Table ronde et questions.

17 h 30 : Conclusion des journées IARD