

LES MORNING FORSIDES



17 mai 2016

9h - 10h30

Accueil à partir de 8h30

76 rue de la Victoire

75 009 Paris

(4^{ème} étage – se présenter à l'accueil du RDC)

Intervenants

Séverine PRIN – Thélem Assurances

Directrice des risques

Marc RAYMOND – Forsides

Associé



Comment calibrer les stress test de l'ORSA ?

Processus interne d'évaluation des risques et de la solvabilité L'ORSA, élément central de Solvabilité 2, doit illustrer la capacité de l'organisme à identifier, mesurer et gérer les éléments de nature à modifier sa solvabilité ou sa situation financière.

Formidable outil d'aide à la décision, il reste néanmoins complexe dans sa mise en œuvre et dans ses calculs. De par sa vocation à présenter une vision prospective et transversale des risques il nécessite de travailler sur un grand nombre d'hypothèses financières et techniques,

Le calibrage des scénarios de stress et le calcul de leur impact sont des éléments centraux de l'évaluation et concentrent les principales difficultés techniques en vue de la réalisation de l'ORSA

9h – 9h20 : L'ORSA

- Rappel des textes
- Retour d'expérience Thélem assurances

9h20 – 9h40 : Le calibrage des stress sur les risques de primes et de réserves

- Le risque de primes
- Le risque de réserves
- Les risques biométriques

9h40 – 10h : Le calibrage des stress sur les risques financiers

- Le risque action
- Le risque immobilier
- Le risque de spread

10h – 10h30 : Mise en œuvre opérationnelle des stress

- Retour d'expérience Thélem assurances

Accès :

Métro : Trinité (l. 12), Chaussée d'Antin (l. 7/9)

Saint-Lazare (l. 3/12/13/14)

RER : Auber (RER A) Haussmann Saint-Lazare (RER E)

Parking : 45, Boulevard Haussmann

Renseignements :

Élodie GUILGAUT - Tél : 01 42 97 91 70

courriel : secretariat-groupe@forsides.fr



Suivez nous : Forsides.fr  