

MORNING FORSIDES

27 juin 2019



27 juin 2019

8h30 - 10h

Accueil à partir de 8h

52 rue de la Victoire

75 009 Paris

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

Détermination des seuils de sinistres graves et optimisation de la réassurance

La segmentation de la sinistralité par le choix de seuils permet de distinguer différents niveaux : attritionnel, grave, catastrophe... et participe à la gestion des risques liés à tout portefeuille d'assurance non vie.

De nombreuses méthodes statistiques existent pour estimer ces seuils de segmentation de la sinistralité. Ces méthodes, relevant principalement de la théorie des valeurs extrêmes, permettent d'évaluer l'impact des événements exceptionnels ainsi que les pertes associées à leur apparition.

Un domaine d'application de la gestion des graves est l'optimisation de la réassurance non proportionnelle. En effet, le seuil de graves constitue une clé de visualisation et d'analyse de l'intérêt d'une couverture en XS.

8h30 – 8h40 : Introduction

8h40 – 9h10 : Méthodologie de choix de seuils

9h10 – 9h30 : Retour d'expérience Aviva

9h30 – 9h50 : Visualisation de l'impact d'un XS et mesure de la prime de réassurance.

Intervenants

Antoine Chanh - Aviva

Responsable de l'équipe Fonction Actuarielle Non-Vie d'Aviva, Antoine intervient sur les sujets actuariels clés en non-vie de la compagnie (provisions techniques, politique de souscription, réassurance et gestion des risques).

Pascale Quennelle - Forsides

Actuaire, associée Forsides, Pascale intervient très régulièrement sur des problématiques non vie pour la modélisation des risques et l'évolution des gammes produits.

Cheick Oumar Diallo -Forsides

Directeur de mission Forsides, Cheick intervient régulièrement en tant qu'actuaire conseil pour le pilotage de travaux d'actuariat non vie et le développement d'outils.



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 :

Elodie GUILGAUT - Tél : 01 42 97 91 70

courriel : secretariat-groupe@forsides.fr



Suivez nous : Forsides.fr