



2 | 20  
Déc. | 16



## Les actifs financiers au bilan des organismes d'assurance

### Principes et mécanismes clés



#### Horaires

9h00 - 12h30 et 14h00 - 17h30  
7 heures de formation



#### Tarif

1 090 € + 20 % de TVA  
Tarif dégressif en fonction du nombre de formations



#### À qui s'adresse cette formation ?

Aux collaborateurs des sociétés de gestion, des directions des investissements des organismes d'assurance, des responsables comptables, des gestionnaires actif/passif et des actuaires.



#### Formateur

Chez Optimind Winter, les formateurs sont de cursus en rapport direct avec la thématique de formation traitée, Actuaires, Ingénieurs financiers, techniques, etc. et salariés de notre entreprise. Cette règle, qui ne tolère aucune exception, est pour nous le gage de leur capacité à comprendre les métiers et les enjeux de nos clients.



#### Optimind Winter

Leader de l'actuariat conseil et de la gestion des risques en France avec ses 180 collaborateurs, Optimind Winter constitue l'interlocuteur de référence pour les organismes assureurs, banques et grandes entreprises qui souhaitent un partenaire métier de haut niveau les accompagnant dans leurs projets stratégiques en actuariat conseil, protection sociale, risk management, finance & performance, business transformation.



#### Lieu

46 rue La Boétie - 75008 Paris  
[Se repérer sur la carte](#)



#### Informations

Pour toutes informations :  
[formation@optimindwinter.com](mailto:formation@optimindwinter.com)

#### Affectation au budget formation

Optimind Winter est enregistrée en tant qu'organisme de formation sous le N°1175356087.

À ce titre, les budgets engagés par nos clients sur ces activités peuvent être imputés à leurs budgets de formation permanents.



#### Objectifs

- Maîtriser les fondamentaux des actifs gérés par les assureurs
- S'initier aux produits structurés
- Comprendre l'environnement réglementaire des assureurs (SI et SII)
- Appréhender les problématiques liées à l'ALM



#### Appréhender les produits financiers présents au bilan des organismes assureurs

- Comprendre les principaux produits Financiers
  - Les produits "classiques" (actions, obligations, immobilier)
  - Les fonds
  - Les produits dérivés
  - Les produits structurés
- Les principaux éléments de la réglementation

#### Les principaux éléments de la réglementation

- Comptabilisation des actifs financiers
  - Le mécanisme de surcôte / décôte
  - Les provisions financières
- Contraintes imposées par le Code des assurances
- Comptabilisation en normes IFRS
- Solvabilité II
  - Présentation du module de risque de marché et illustrations de chocs sur plusieurs actifs

#### ALM ou Gestion actif / passif

- Contexte de l'ALM
- Stratégies de bases-réplication du passif
  - Cash-flow matching
  - Immunisation (avec illustration)
- Exemple de stratégie ALM
  - Core satellite, LDI, CPPI