

29  
mars  
2012

## Petit-déjeuner conférence

### ORSA

### Quels impacts sur les modèles de gestion des risques ?

A l'approche de l'entrée en vigueur de la réforme Solvabilité II, et dans un contexte où le régulateur vient juste de finaliser une consultation sur l'ORSA, cette exigence pose encore de nombreuses problématiques opérationnelles au marché, notamment en termes d'impacts sur les modèles de gestion des risques.

Optimind, avec l'intervention de Gildas Robert, actuaire senior manager et practice leader Solvabilité II et Emmanuel Berthelé, actuaire et practice leader Modélisation Prospective, vous propose à l'occasion de ce petit déjeuner conférence de vous de vous livrer leur analyse des réponses possibles qui peuvent être apportées par les modèles.

**Gildas Robert**, actuaire, senior manager, practice leader Solvabilité II  
**Emmanuel Berthelé**, actuaire, practice leader Modélisation Prospective

#### Les horaires

Durée : 1h15  
8h30 : Café d'accueil  
9h00 : Présentation  
10h00 : Question-réponse  
10h15 : Fin du petit-déjeuner

8h30 : Accueil des participants

9h00 : Introduction

- > *L'ORSA au sein de Solvabilité II*
- > *Les principales exigences quantitatives*

9h10 : Les évolutions à apporter aux modèles quantitatifs

- > *Périmètre de risques à envisager*
- > *L'horizon temporel à retenir*
- > *Quelle métrique retenir*
- > *Quel calibrage des risques*

9h35 : La mise en place d'un modèle de gestion des risques

- > *Des simulations dans les simulations aux replicating portfolio*
- > *Vers des méthodes simplifiées ?*

10h00 : Questions / réponses

10h15 : Fin du petit-déjeuner

#### Qui sommes-nous ?

Société de conseil en actuariat et gestion des risques, OPTIMIND est un interlocuteur de référence pour les assureurs, mutuelles, banques et grandes entreprises qui souhaitent un partenaire métier les accompagnant dans leurs projets.

#### Où ?

Optimind – Auditorium  
46 rue La Boétie  
75008 Paris

Le nombre de places étant limité,  
nous vous invitons à confirmer votre présence avant le 27 mars 2012.  
Pour vous inscrire : [pdj@optimind.fr](mailto:pdj@optimind.fr) / Réf. 120329