

Milliman, le Laboratoire de Science Actuarielle et Financière et l'Institut Louis Bachelier vous invitent à la matinée de la chaire « Actuariat durable et stabilité du secteur de l'assurance à long terme »

Le jeudi 5 novembre par visioconférence Webex

L'objectif de cette chaire est de promouvoir la recherche dans plusieurs domaines de la science actuarielle, en particulier la théorie de la ruine, les risques systémiques et les risques d'assurance de long terme. Cet événement sera l'occasion de partager les développements et les enjeux récents autour des Générateurs de Scénarios Economiques (GSE). Le calibrage des modèles de taux, les choix des modèles financiers et l'intégration de nouveaux facteurs de risques dans le cadre réglementaire et le contexte économique actuels seront notamment au cœur des présentations durant la matinée.

AGENDA

- 9h00 – 9h15 :** Stéphane Loisel (Univ. Lyon 1) - Bilan scientifique des activités récentes de la chaire
- 9h15 – 10h00 :** Milliman R&D – Comment adapter les GSE aux conditions de marché et exigences réglementaires ?
- 10h00 – 10h25 :** Fabrice Borel Mathurin (ACPR) – Point de vue sur la régulation et le développement des GSE
- 10h25 – 10h50 :** Michael Leitschkis (Milliman) – Economic Scenario Generators for UK Internal Models: Extreme times & extreme scenarios?
- 10h50 – 11h20 :** Pause
- 11h20 – 12h05 :** Nicole El Karoui (LPSM, Univ Paris 6), Stéphane Loisel (Univ. Lyon 1) et Julien Vedani (Milliman R&D - SAF Lyon 1) – Market consistency, a pre- and post-Covid analysis and further developments
- 12h05 – 12h30 :** Sophian Mehalla (Milliman R&D - CERMICS) – Méthodes d'accélération pour le calibrage des modèles de taux

DATE ET LIEU

Cette conférence aura lieu le jeudi 5 novembre 2020 à partir de 9h par visioconférence Webex.

MODALITÉS D'INSCRIPTION

Inscription par email à actuariat-durable@milliman.com



Cette conférence a été homologuée par l'Institut des Actuaire pour entrer dans le périmètre du PPC (Perfectionnement Professionnel Continu) et donne droit à un crédit de 12 points.