

ÉCONOMÉTRIE DE L'ASSURANCE

Public visé par la formation et prérequis

- Professionnels souhaitant acquérir ou approfondir des compétences techniques dans la tarification et le provisionnement en assurance
- Chargés d'études statistiques, chargés d'études actuarielles, professionnels de l'assurance
- Une durée d'exercice professionnelle n'est pas nécessaire.
- Nécessite des capacités de modélisation mathématique et de la maîtrise de son formalisme
- Un niveau de formation équivalent à un master scientifique (mathématique, économie ou économétrie de préférence) est souhaitable
- Prérequis : niveau mathématique équivalent à une licence 3 de mathématiques, connaissances élémentaires en probabilités et statistique. Aucun prérequis en programmation n'est nécessaire.

Objectifs de la formation

- Modéliser un risque en assurance vie ou non-vie
- Appréhender les enjeux de la tarification et du provisionnement en assurance
- Maîtriser les outils techniques nécessaires à la conception de tarifs d'assurance et à la gestion des risques associés
- Analyser la fiabilité des données et des méthodes statistiques permettant de concevoir un tarif

Contenus de la formation

- Bases conceptuelles de théorie des probabilités en vue d'une application en assurance
- Principes de tarification en assurance
- Méthodes de traitement des données pour concevoir un tarif d'assurance
- Méthodes de segmentation, d'analyse et de suivi du tarif
- Principes de provisionnement en assurance

Moyens et méthodes pédagogiques

- Supports de cours dématérialisés
- Études de données réelles au moyen de logiciels libre (logiciel R)
- Rendus de rapports réguliers sur les modèles utilisés et les analyses effectuées

Évaluation de la formation / sanction de la formation

- Exercices à réaliser en dehors des sessions
- Evaluation sur les 10 questions écrites de l'épreuve d'accès au CEA
- Remise d'une attestation individuelle de formation

Formateur

Olivier Lopez, professeur à Sorbonne Université (laboratoire LPSM), directeur de l'ISUP, membre agrégé de l'Institut des actuaires
Expérience de formation et de recherche théorique et appliquée dans la thématique envisagée.

Durée de la formation et modalités d'organisation

- 35 h réparties sur 10 demi-journées de mars à juin
- De 9 h à 12h30 ou de 14 h à 17h30
- Paris intra-muros
- ½ journée par semaine sur 10 semaines
- Une trentaine de stagiaires