

Avec l'entrée en vigueur de Solvabilité 2, les modèles stochastiques sont devenus un passage obligé pour calculer le capital de solvabilité.

Si ces modèles ont été imposés c'est qu'ils sont les seuls qui permettent de valoriser les options telles que les participations aux bénéfices des contrats d'assurance vie.

Pour nous familiariser davantage avec ces techniques, l'ILAC organise une conférence avec des chercheurs du monde académique actifs sur ce type de modélisation.

Cette rencontre permettra aux praticiens de la finance et de l'assurance d'échanger avec ces spécialistes.

Deux présentations vont illustrer la puissance de la modélisation stochastique.

Dans un premier modèle nous considérons le problème de la gestion du bilan d'un contrat financier de type assurance vie. L'originalité de cette étude se situe dans la modélisation de l'option de retrait anticipé de l'assuré.

Le second modèle porte sur les mesures de risque extrême en finance et la détection des périodes de crises et de stabilité, permettant ainsi de mieux estimer les événements rares de type forte fluctuation du marché financier pour affiner les indicateurs de risque.

Les techniques utilisées reposent sur le calcul stochastique, la calibration des modèles sur des données réelles et les méthodes numériques probabilistes.

«Modèles stochastiques en finance et assurance»

(la conférence sera tenue en langue française)

Madalina Deaconu & Antoine Lejay

chercheurs membres de l'équipe-projet TOSCA de INRIA-Grand-Est

nous feront l'honneur d'être nos orateurs pour cet événement.

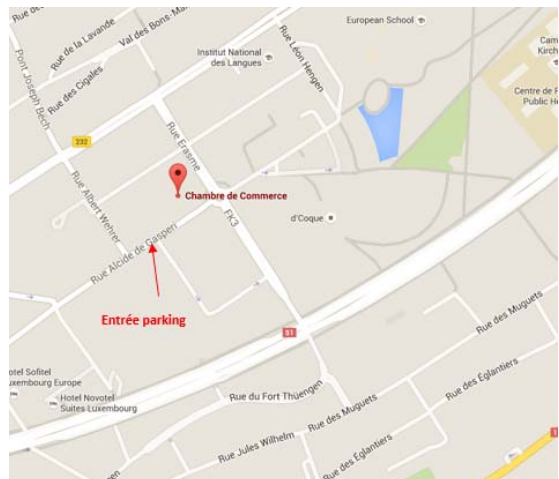
En pratique

Date : Jeudi, le **10 mars 2016**

Lieu : Chambre de Commerce
7, rue Alcide de Gasperi
L-2981 Luxembourg

Parking: Le parking est mis à disposition des participants (entrée du parking: rue Alcide de Gasperi)

Horaire : 18h15 – 19h45



La conférence sera suivie d'un drink offert par l'ILAC.

Espérant vous compter parmi les participants, nous vous invitons à nous confirmer votre présence avant le 7 mars à l'adresse suivante :

www.eventbrite.fr/e/billets-les-modeles-stochastiques-en-finance-et-en-assurance-21515283793