

MORNING FORSIDES

27 SEPTEMBRE 2024

AVEC LA REVUE S2, LES LTEI, UNE OPPORTUNITÉ À NE PAS MANQUER?

Les mesures LTEI introduites dans la réglementation Solvabilité 2 en 2019 permettent d'atténuer les chocs actions pour des actions gérées à long terme sous certaines conditions. Le choc sur cette catégorie est de 22% (contre 39% pour les actions de type 1 et 49% pour les actions de type 2 auxquels s'ajoute le dampener).

Ce système, actuellement peu utilisé en raison de critères d'application très limités et restrictifs, pourrait être simplifié dans le cadre de la révision actuelle de Solvabilité 2.

Ce Morning proposera de décrypter les assouplissements réglementaires envisagés pour les LTEI puis présentera les résultats de l'étude menée par Forsides visant à évaluer l'impact en termes de taux de couverture de l'introduction d'une poche LTEI dans un portefeuille fictif constitué à l'aide de données moyennes de marché.

INTERVENANT

Daniel ZERBIB – Senior Manager – Forsides France

Daniel est Senior Manager chez Forsides qu'il a rejoint en 2013. Fort de 11 ans d'expérience dans l'actuariat et le conseil, Il dispose d'une pratique approfondie de Solvabilité II, particulièrement sur les sujets de modélisation financière et de calculs actif-passif. Il a notamment accompagné la mise en place du dispositif LTEI chez un assureur.

Cyril BARRITAUD – Senior Consultant – Forsides Luxembourg

Actuaire ISFA, membre de l'IA et de l'ILAC, a commencé sa carrière en France chez Quatrem Assurances Collectives puis à la MGEN avant de rejoindre sa filiale de gestion d'actifs EGAMO. Il prend par la suite la direction du bureau d'étude non-vie de Monceau Générale Assurances, dont il rejoint en 2019 l'entité luxembourgeoise plus particulièrement sur les aspects de la gestion des investissements et de l'optimisation des besoins en SCR en découlant. Il devient en 2022 fonction clé gestion des risques pour Baloise Luxembourg..

DÉROULEMENT

8h30 – 8h40 : Rappel du contexte

8h40 – 9h10 : Analyse réglementaire

9h10 – 9h30 : Présentation de l'étude d'impact

9h30 – 9h35 : Conclusion

9h35 : Echanges Q/R



En visioconférence

Ouverture à partir de 8h15

Le lien sera transmis avec la confirmation d'inscription

 FORSIDES - 4, rue du Général Foy - 75008 Paris

Renseignements :  Élodie GUILGAUT - 01 42 97 91 70  secretariat-groupe@forsides.com