

# 4<sup>ème</sup> journée de rencontre, de formation et d'échanges du Master ESA Samedi 1<sup>er</sup> avril 2017

## Programme

À partir de

14h15

**Café d'accueil : Hall Sully**

**Mot de bienvenue et présentations : Amphi. Cantillon**

14h30

**Anca-Maria Alvirescu et Iona Ionascu** (Consultantes, Deloitte)

*IFRS 9 – Dépréciation des instruments financiers : vers un changement de modèle*

- Présentation générale du contexte, des exigences de la norme, des nouveautés par rapport au modèle existant et de la méthodologie de calcul du provisionnement IFRS 9 (A. Alvirescu)
- Focus sur le calibrage d'un modèle de probabilité de défaut IFRS 9 – démarche, prérequis et méthodes statistiques employées (I. Ionascu)

Cette intervention sera précédée d'une présentation du Département FSI-Risk Advisory par **Daoud Barkat** (Senior Manager, Risk Advisory, Deloitte)

15h15

**Ophélie Couperier et Sullivan Hué** (Etudiant-e-s, M2 ESA voie recherche)

*Challenge RCI Bank – Paramètres bâlois : comment modéliser la LGD*

15h45

**Rémi Giraud** (Etudiant, M2 ESA voie professionnelle)

*Challenge RCI Bank – Construction d'un score d'octroi pour un crédit automobile*

Ces interventions seront précédées d'une présentation du Challenge RCI Bank par **Christophe Hurlin**

16h15

**Pause**

16h30

**Dieudonné Sondjo** (Actuaire, SOGECAP)

*La statistique appliquée en actuariat : exemples en assurance non vie*

17h00

**Florence Giuliano** (EMEA Fraud Strategy Director, SAS) et **Jean-Loïc Berthet**

(Responsable Lutte contre la fraude et conformité, SAS France)

*L'analytique au service de la lutte contre la fraude et conformité*

17h30

**Cocktail de fin de journée : Hall Sully**

À partir de

20h

**Soirée de Gala au Golf de Marcilly en Vilette**