

EDITORIAL

Frédéric PLANCHET

Editeur

Arthur CHARPENTIER

Editeur associé

Stéphane LOISEL

Editeur associé

Risque catastrophe, calcul de best estimate en assurance vie et méthodes market consistent, mesure des risques systématiques : les thèmes développés dans ce vingt et unième numéro du Bulletin Français d'Actuariat couvrent un large spectre des problématiques récurrentes rencontrées au cours de la mise en place du dispositif Solvabilité 2, qui motive toujours l'essentiel des articles présentés.

Le travail présenté par K. Mandhouj sur le risque de pandémie fait ainsi suite aux articles de V. Guette (n°19) puis de M. Habart (n°20) sur ce même thème.

L. Devineau et M. Chauvigny poursuivent l'analyse des techniques de portefeuilles répliquant pour calculer des best estimate pour des contrats d'épargne.

Le travail proposé par F. Bonnin et al. sur l'évaluation du risque de taux dans le cadre d'une dette financière complexe, s'il n'est pas comme les autres travaux directement lié au cadre Solvabilité 2 peut toutefois fournir des outils pour le calcul de best estimate étudié dans l'article précédent.

Enfin, le sujet de la détermination de best estimate, mais cette fois en assurance de personnes, est au cœur des approches présentées par A. Kamega et F. Planchet pour quantifier le risque d'estimation associé à la construction de lois d'expérience.

Au-delà de la diversité des articles présentés sur ces différents sujets, on peut observer une convergence dans les approches et les choix méthodologiques retenus, signe sans doute d'une certaine maturité, déjà, des acteurs dans la mise en place du pilier 1 de Solvabilité 2.

Nous devrions alors logiquement voir apparaître dans les prochains numéros des travaux avancés sur l'ORSA et les problématiques du pilier 2.

Nous vous souhaitons une bonne lecture.