

한양대학교 ERICA캠퍼스 교무처장 귀하

강 의 계 획 서

교과목 정 보	교과목명	중급보험수리학		수업년도(학기)	2015년 1학기	
		<input type="checkbox"/> 2학점	<input checked="" type="checkbox"/> 3학점			
	소 속	경상대학 보험계리학과		성 명	심현우	
	강의요일	월/수		강의시간	9:00-10:30	
	강의장소	경상관 13-303				
교과목 개 요	본 과정은 보험수리학 1, 2에서 진보된 수준에서, 다중상태 모형에 기초한 현대적 보험 수리학을 배운다.					
수업목표	1. 독립생명, 연합생명, 최종생존자, 그리고 공통충격 모형의 확률과 분포를 배운다. 기대값, 분산, 공분산과 같은 모멘트를 평가하고 조건부 확률을 계산한다. 2. 상기 모형을 보험과 연금에 적용한다. 3. 다중탈퇴 모형의 확률을 계산하고 탈퇴력을 생성하고, 다중탈퇴에 기반한 생명표를 작성한다. 근사적 확률 평가시 사용하는 다양한 가정 사이의 차이점들을 설명한다. 4. 이산시간/연속시간 Markov 체인의 개념을 이해하며, 해당하는 확률을 계산한다. 전이 확률의 시간에 따른 변화를 Kolmogorov 전진방정식과 같은 방법을 이용하여 계산하고, 다중상태 모형의 보험료와 준비금을 산출한다.					
교 재	교재명		저자		출판사	
	최신보험수리학		오창수		박영사	
평가방법	중간(%)	기말(%)	출석(%)	과제(%)	수업참여도(%)	기타(%)
	30	30	10	15		15

주 강 계 편 의 화	주차	Contents	Exam & 과제
	Week 1	Multiple life model	
	Week 2	Multiple life model	
	Week 3	Multiple life model	
	Week 4	Multiple life model	
	Week 5	Multiple life model	
	Week 6	Multiple decrement model	
	Week 7	Multiple decrement model	
	Week 8	Review/Midterm exam	Midterm exam
	Week 9	Multiple decrement model	
	Week 10	Multiple decrement model	
	Week 11	Multiple state model	
	Week 12	Multiple state model	
	Week 13	Multiple state model	
	Week 14	Multiple state model	
	Week 15	Multiple state model	