

האוניברסיטה העברית בירושלים

סילבוס

מבוא לאקטואריה - 52007

תאריך עדכון אחרון 10-10-2019

נקודות זכות באוניברסיטה העברית: 4

תואר: בוגר

היחידה האקדמית שאחראית על הקורס: סטטיסטיקה

השנה הראשונה בתואר בה ניתן ללמוד את הקורס: 0

סמסטר: סמסטר א'

שפת ההוראה: אנגלית

קמפוס: הר הצופים

מורה אחראי על הקורס (רכז): בנימין יקיר

דוא"ל של המורה האחראי על הקורס: benjamin.yakir@mail.huji.ac.il

שעות קבלה של רכז הקורס: בתיאום מראש

מורי הקורס:

תאור כללי של הקורס:

הסילבוס מבוסס על הדרישות של המבחן CM1 של אגודת האקטוארים. (מבחן זה מחליף את המבחנים CT1 ו-CT5).

מטרות הקורס:

אקטואריה מתמטית (CM1) מספקת בסיס בעקרונות המידול האקטוארי, עם דגש על מודלים דטרמיניסטיים וישומיהם בתחום הפיננסי. הקורס מעניק ידע בעקרונות הבסיסיים של אקטואריה, תיאוריה קצב הריבית והטכניקות המתמטיות בעזרתן ממדלים את הערך של תזרים מזומנים בתנאי ודאות או כתלות במוות, מחלה, ו/או הישרדות. הנושא כולל תיאוריה וישום לנתונים ריאליסטיים.

תוצרי למידה

בסיומו של קורס זה, סטודנטים יהיו מסוגלים:

1. לחלץ תזרימי מזומנים מתיאור מילולי של בעיה פיננסית.
2. לבצע חישובים פיננסיים בהקשרים אקטואריים.
3. להשיב על שאלות ברמה ובסגנון של מבחני ההסמכה לאקטואריה
4. לנתח נתונים ולהסיק מהם מסקנות

דרישות נוכחות (%) :

אין

שיטת ההוראה בקורס: הרצאות פרונטליות בהן יוצג החומר התיאורטי של הקורס. תיקבע רשימה של שאלות ממבחני CT1 ו-CT5 של שנים עברו. הסטודנטים נדרשים ללמוד באופן עצמאי את השאלות ולהבין את דרכי פתרון. ניתן לנצל את ההרצאות הפרונטליות לשם הבהרה של נושאים בהם אתם מתקשים.

רשימת נושאים / תכנית הלימודים בקורס:

1. נתונים והעקרונות הבסיסיים של מידול (10%)
2. התיאוריה של ריבית (20%).
3. העקרון של שויון הערך ויישומיו (15%)
4. מודלים של תמותה של פרט בודד (10%).
5. מודלים של תמותה הכוללים מספר פרטים (10%).
6. תמחור ורזרבות (35%).

חומר חובה לקריאה:

רשימות לכיתה

חומר לקריאה נוספת:

הערכת הקורס - הרכב הציון הסופי :

מבחן מסכם בכתב/בחינה בעל פה 60 %
הרצאה 0 %
השתתפות 0 %
הגשת עבודה 0 %
הגשת תרגילים 0 %
הגשת דו"חות 0 %
פרויקט מחקר 0 %
בחנים 40 %
אחר 0 %

מידע נוסף / הערות:

במשך הקורס יתקיימו 4 בחנים. הבחנים יהיו ממוחשבים ומוגבלים בזמן. הבחנים יתבססו על שאלות מהמבחנים הישנים של CT1 ושל CT5. ציון שיקבע לכל אחד מהבחנים שנבחרו יהווה 10% מהציון הסופי כציון מגן (כלומר, ציון הבוחן שווה לגדול מבין ציון הבדיקה של המבחן המסכם וציון הבדיקה של הבוחן).

המבחן המסכם והבחנים הממוחשבים הם בשפה האנגלית. ניתן לרשום את התשובות לבחנים ולמבחן המסכם בשפה העברית.