

האוניברסיטה העברית בירושלים

סילבוס

שיטות סטטיסטיות בביטוח - 52613

תאריך עדכון אחרון 07-08-2017

נקודות זכות באוניברסיטה העברית: 3

תואר: בוגר

היחידה האקדמית שאחראית על הקורס: סטטיסטיקה

השנה הראשונה בתואר בה ניתן ללמוד את הקורס: 0

סמסטר: סמסטר ב'

שפת ההוראה: עברית

קמפוס: הר הצופים

מורה אחראי על הקורס (רכז): פרופ' בנימין יקיר

דוא"ל של המורה האחראי על הקורס: msby@huji.ac.il

שעות קבלה של רכז הקורס: בתאום מראש

מורי הקורס:

פרופ בנימין יקיר
פרופ עופר קלע

תאור כללי של הקורס:

קורס זה מציג את המודלים הסטטיסטיים המרכזים בהם משתמשים אקטוארים בתעשיית הביטוח. הקורס מבוסס על קריאה של היחידה CT6 המהווה חלק ממערך הבחינה של איגוד האקטוארים הבריטיים.

מטרות הקורס:

המטרה המרכזית היא להציג חלק מהיישומים של סטטיסטיקה בתעשיית הביטוח. מטרה משנית היא לסייע בהכנה לתלמידים המעוניינים ליטול מבחני הסמכה באקטואריה.

תוצרי למידה

בסיומו של קורס זה, סטודנטים יהיו מסוגלים:

1. להדגים את ההבנה של המושגים המופיעים ברשימת ה-Reading Core של CT6.
2. לפתור בעיות ממבחנים ישנים של CT6.

דרישות נוכחות (%) :
אין דרישת נוכחות.

שיטת ההוראה בקורס: הסטודנטים נדרשים לקרוא את החלקים הרלוונטיים של ה-Reading Core לפני השיעור. בכיתה נדון בחומר, נביא דוגמאות של יישום, ונפתור את שיעורי הבית של השבוע הקודם. יוצגו שאלות הבית לשבוע העוקב. שאלות אלה יתבססו על שאלות שהופיעו במבחנים ישנים.

רשימת נושאים / תכנית הלימודים בקורס:

תורת ההחלטות, התפלגויות הפסד, מולים של סיכון, תורת "פשיטת הרגל", סטטיסטיקה בייזיאנית, תורת האימון (credibility), ניתוח זליגת משולשים, מודלים לינארים מוכללים, מודלים של סדרות עיתיות, שיטות מונטה קרלו.

חומר חובה לקריאה:
כל היחידות של CT6.

חומר לקריאה נוספת:
Loss Models: From Data to Decision, by S.A. Klugman, H.H. Panjer, and G.E. Willmot, John Wiley and Sons.

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 CT6. 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.