

■■ 科目番号			
数理482			
■■ 開講年度	■■ 開講学期	■■ 曜日時限	■■ 開講学部等
2016	後学期	月2	理学部数理科学科
■■ 講義コード	■■ 科目名[英文名]		■■ 単位数
40121100	数理統計学Ⅱ		2
■■ 担当教員[ローマ字表記]			
杉浦 誠			

■■ 授業内容と方法

アクチュアリー会資格試験の数学分野(確率, 統計, モデリング)および生保数理に関する講義を行う。

■■ 達成目標

確率統計について、1年次2年次に学んだ数学知識を生かして、実際に計算できるようになる。

この科目は数理科学 学士教育プログラムの学習教育目標の「問題解決力の修得」及び「専門性の修得」に関連した授業である。

■■ 評価基準と評価方法

レポートと授業態度で評価する。

■■ 履修条件

統計と社会を履修済みであること。確率統計学I, 数理統計学Iを修得済みであること。備考の事項にも注意ください。

■■ 授業計画

以下のような内容を講義する計画です。

- 1 回帰分析
- 2 時系列解析
- 3 マルコフ連鎖
- 4 シミュレーション
- 5 生保数理または損保数理入門

■■ 事前学習

前回の復習をし、配布する演習問題をしっかり解いておいてください。

■■ 事後学習

前回の復習をし、配布する演習問題をしっかり解いておいてください。

■■ 教科書にかかわる情報

教科書	書名	生保年金数理			ISBN	9784563011338	備考
	著者名	黒田耕嗣著					
	出版社	培風館	出版年	2007	NCID	BA82480557	
教科書	書名	アクチュアリーのための生命保険数学入門			ISBN	9784000062800	備考
	著者名	京都大学理学部アクチュアリーサイエンス部門編					
	出版社	岩波書店	出版年	2014	NCID	BB16117041	
	書名	生命保険数学					

教科書	著者名	二見隆著			ISBN		備考	
	出版社	生命保険文化研究所	出版年	1992	NCID	BN07997029		
教科書	書名	Theory of point estimation			ISBN	9780387985022	備考	Springer texts in statistics
	著者名	E.L. Lehmann, George Casella,						
	出版社	Springer	出版年		NCID			
教科書	書名	Extreme Values, Regular Variation and Point Processes			ISBN	9780387759524	備考	Springer Series in Operations Research and Financial Engineering
	著者名	S.I. Resnick						
	出版社	Springer	出版年	2007	NCID			
教科書	書名	極値統計学			ISBN	9784764905153	備考	ISMシリーズ：進化する統計数理；5
	著者名	高橋倫也, 志村隆彰 著,						
	出版社	近代科学社	出版年	2016	NCID			

教科書全体備考

参考書にかかわる情報

参考書	書名	モデリング			ISBN		備考	
	著者名							
	出版社	日本アクチュアリー会	出版年	2005	NCID	BA72919315		
参考書	書名	確率・統計・モデリング問題集			ISBN		備考	
	著者名	藤田岳彦 [著]						
	出版社	日本アクチュアリー会	出版年	2007	NCID	BA83443170		
参考書	書名	損害保険数理 (アクチュアリー数学シリーズ) / 岩沢 宏和, 黒田 耕嗣 -- 日本評論社, 2015--()			ISBN	9784535607095	備考	
	著者名							
	出版社		出版年		NCID			
参考書	書名	定量的リスク管理：基礎概念と数理技法			ISBN	9784320018631	備考	
	著者名	Alexander J. McNeil, Rudiger Frey, Paul Embrechts 著, 塚原英敦 訳者代表,						
	出版社	共立出版	出版年	2008	NCID			
参考書	書名	Regular Variation			ISBN	9780521379434	備考	Encyclopedia of Mathematics and its Applications
	著者名	N.H. Bingham, C.M. Goldie and J.L. Teugels						
	出版社	Cambridge University Press	出版年		NCID			

参考書全体備考

使用言語

日本語

メッセージ

2年次の各序論、序論演習の履修条件は、1年次の微分積分学ADI、II、線形代数学I、II、線形代数学演習I、IIおよび数学序論I、II、数学序論演習I、IIを修得済みもしくは履修中であることを原則とする。

2年次の計算機概論、3、4年次専門科目の履修条件は、上記の条件、および、2年次の代数・幾何・解析の各序論I、II、序論演習I、IIを修得済みもしくは履修中であることを原則とする。

教室容量との関係で理学部数理科学科の学生を優先する。その他の学生は講義室の状況を見て登録を許可するかどうかを判断する。

オフィスアワー

月曜日 9:00--10:00 場所<研究室>