

<별첨>

IFRS17 을 위한 금융공학 이해 및 실습

1. 교육목적

- 계리, 상품, 리스크관리 직무 인력이 파생상품을 이해하고 담당 업무에 활용하기 위한 교육입니다. 파생금융상품의 구조와 이와 관련된 위험요소, 그리고 가치산정 모형을 이해하는데 주안점을 두었으며, 궁극적으로 보험회사가 직면하는 다양한 리스크를 헷징하는데 실질적인 도움을 주고자 합니다.

2. 교육개요

과 정 명	IFRS17 을 위한 금융공학 이해 및 실습				
교육일정	2019년 5월 8일(수) 14:00~17:50 5월 9일(목) 10:30~17:50				
교육수준	기본 심화				
교육대상	생·손보업계 상품/계리/리스크 등 관련 업무 담당자				
교육정원	40명 선착순 모집				
교육장소	한국보험계리사회 강의실(코리안리재보험 빌딩 311호)				
교육비	- 무통장입금 또는 교육 당일 현장에서 법인카드 결제 <우리은행 1005-502-527602 (사) 한국보험계리사회>				
	구 분	법인회원사		비회원사	
		개인회비 납입	개인회비 미납입	개인회비 납입	개인회비 미납입
할인율	50%	25%	25%	0%	
교육비	100,000	150,000	150,000	200,000	

3. 강의 일람표 (안)

일자	시간	과 목 개 요		시간	강 사
		과목	주요내용		
05.08 (수)	14:00~14:50	파생상품의 기초개념	○ 선물/선도, 옵션, 스왑의 개념	1H	소일웅 대리 (KDB 생명)
	15:00~15:50	기초자산의 이해	○ 채권 - 듀레이션(Duration), 볼록성(Convexity)	1H	
	16:00~17:50		○ 주식 - 브라운운동(Brownion motion), 테일러 정리, Ito-lemma, 산술브라운운동(ABM), 기하브라운운동(GBM)	2H	
05.09 (목)	10:30~11:50	옵션	○ 이항 모형 - 위험중립확률(Martingale Measure) 산출, 유리피언 및 아메리칸 옵션 가격결정	1.5H	
	13:30~16:20		○ 블랙숄즈(B-S) 모형 - B-S PDE, B-S 공식유도, 옵션가치 분해, Monte Carlo 를 이용한 유리피언 콜옵션 계산	3H	
	16:30~17:50	할인율 산출	○ 풋-콜 패리티 ○ 결정론적 할인율 - Bootstrapping, 금리기간 구조, Smith-Wilson 적용	1.5H	
계				10	

* 강사진 및 교과별 강의 시간은 강의 진행 과정에 따라 일부 변경될 수 있습니다.

* 50 분 강의, 10 분 휴식시간 기준입니다.

* 5 월 9 일 점심시간은 12:00~13:30 입니다.

4. 강사

소일웅 대리 (KDB 생명)

5. 신청 방법

- 성명, 회사명, 부서, 직책, 휴대전화, 이메일을 차례로 기재하여 이메일(actuary@actuary.or.kr) 또는 FAX(02-782-7441)로 접수하신 후, 수강료 입금상황을 확인해 주시기 바랍니다.

* 회원대상 강의이므로 비회원은 회원가입 후 신청가능

ex) 신청 양식

성명	회사명	부서	직책	휴대전화	이메일
홍길동	xx 생명	계리팀	과장	010-1234-5678	abc@abc.com

- 홈페이지(www.actuary.or.kr)에서 수강신청이 가능합니다.
(로그인 후 교육정보 > 교육과정 정보 및 신청에서 수강신청 가능)

6. 기타

- 본 교육의 이수학점은 10 학점입니다.
- 본 회 홈페이지의 교육정보(교육과정정보)에 관련 공문 및 수강신청서 등을 첨부하였으니 참조 바랍니다.
- 추후 교육 관련 변동사항 등을 안내하기 위해 정확한 휴대전화 번호와 이메일 주소를 신청서에 반드시 기재 바랍니다.
- 교육시간을 엄수하여 주시기 바라며, 신청 후 참석을 하지 못하는 경우에는 교육개시 하루전까지 계리사회 사무국으로 전화 (02-782-7440)나 대표메일 (actuary@actuary.or.kr)을 통해 미리 연락해주시기 바랍니다.