

## COE Lecture Note Series

Volume No. : 13

Title : プロシーディング「損保数理に現れる確率モデル」

Editor : 谷口説男

Written In : Japanese

ISSN : 1881-4042

Published In : 2009年2月6日

Authors : 田中立志, 斎藤新悟, 谷口説男, 吉満隆亮

Contents :

田中立志	
IBNR 見積法のサーベイ-ランオフ三角形とチェーンラダー法-	1
斎藤新悟	
Mack の公式 : 支払備金の区間推定	11
谷口説男	
ランダムウォークモデルについて	23
吉満隆亮	
実データを使用した BandomWalk 法の活用例	33
谷口説男	
マークドポアソン過程-保険金見積もりの細分化について-	37
田中立志	
保険金見積もりの細分化	47
谷口説男	
共同研究中間発表参考資料-確率論・線形計画法・ガウス推定-	53