

보험부채의 보증리스크 및 금리리스크의 평가 및 관리 - 이론과 실습

본 과정은 보험부채에 내재된 보증리스크 및 금리리스크를 금융공학 관점에서 체계적으로 이해하고, 확률론적 시나리오, 옵션평가, 동적헤지 등 실무에 활용 가능한 기법을 이론과 실습을 통해 학습하는 과정입니다. 회원 여러분의 많은 관심과 참여 바랍니다. 감사합니다.

교육일시	2026년 3월 11일(수) ~ 3월 12일(목) 09:30~18:00 (총 14시간 / 2일)
교육장소	한국보험계리사회 세미나실 (주소: 서울시 종로구 새문안로3길 15, 4층)
학습목표	1. 보험부채에 내재된 보증리스크 및 금리리스크를 금융공학 관점에서 구조적으로 이해 2. 옵션평가, 확률 미분 방정식, 확률론적 시나리오 생성 기법을 활용한 리스크 평가 실무 역량 확보 3. IFRS17 및 K-ICS 체계 하에서 보증리스크의 평가·프라이싱·관리 방안을 실무에 적용 가능하도록 체계화
수강대상	보험부채 평가, 리스크관리, ALM, 상품개발, 계리모형 개발, IFRS17 및 K-ICS 대응 업무 종사자
사전지식	변액보험에 대한 기본 지식
준비물	노트북, 마우스
강사진	이택기 (Aon Life Solutions 대표), 소민관 (Aon Life Solutions 부대표)
이수학점	14학점
수강신청	계리연수원 > 집합교육 > 과목선택 > 수강신청 [수강신청 바로가기] ※ 선착순 50명 접수중
교육비	1) 법인회원사 소속이며(AND) 개인회원 (50% 할인) : 150,000원 2) 법인회원사 소속 또는(OR) 개인회원 (25% 할인) : 225,000원 3) 일반 : 300,000원
문의	전화 02-782-7440 (내선1번), 이메일 actuary@actuary.or.kr

일시	과목	내용	소요	강사	
3/11 (수)	금융공학의 활용	1. 금융공학 이론적 배경	2H	소민관	
		2. 옵션 평가			
		점심시간			
		3. 금융공학: 확률 미분 방정식	5H		
		4. 확률론적 시나리오 생성			
		5. 헤지 및 파생상품			
		6. 동적헤지 프로세스			
3/12 (목)	보험부채의 보증리스크 및 금리리스크의 이해·평가·분석	1. 보증리스크 및 금리리스크의 개요	2H	이택기	
		2. IFRS17 & K-ICS 하 보증리스크 관리			
		점심시간			
		3. 보증리스크 및 금리리스크 평가	5H		
		4. 보증리스크 프라이싱			
※ 상기 일정표는 진행과정에 따라 일부 변경될 수 있습니다.				14H	