

參考文獻

中文部分

1. 沈小琪,「市場利率與保單失效解約率關係之研究」,逢甲大學統計與精算研究所碩士論文,1998。
2. 吳婕綺,「隨機利率模型下利率變動型年金之盈餘分配與資產配置策略」,逢甲大學保險所碩士論文,2006。
3. 孟嘉仁,「台灣利率變動型年金商品設計與利率宣告策略關連性之研究」,台灣大學EMBA 財務金融所碩士論文,2004。
4. 林芳如,「利率變動型年金資產負債管理—隨機規劃方法之應用」,銘傳大學金融研究所在職專班碩士論文,2004。
5. 林怡菁,「利率變動型年金之利率風險研究」,朝陽科技大學保險金融管理系碩士論文,2005。
6. 郭瑜玲,「利率變動型年金經營策略與附加價值」,國立台灣大學財務金融所碩士論文,2004。
7. 陳宣仲,「不同情境下利率變動型年金於累積期之風險分析」,國立台灣大學財務金融所碩士論文,2006。
8. 顏尚琴,「利率變動型年金保險解約率的估計」,大同技術學院學報,第十三期,2004,第29-47頁。
9. 蘇承懋,「模擬產險公司最佳化資產配置」,國立政治大學風險管理與保險學

所碩士論文，2004。

英文部分

1. Cox, J.C., J.E. Ingersoll, and S.A. Ross, 1985, A Theory of the Term Structure of Interest Rates, *Econometrica*, 53, 2, 385-407.
2. Grosen, A. and P. L., Jorgensen, 2000, Fair Valuation of Life Insurance Liabilities: The Impact of Interest Rate Guarantees, Surrender Options, and Bonus Policies, *Insurance: Mathematics and Economics*, 26, 1, 37-57.
3. Tsai, C., W. Kuo, and W. Chen, 2002, Early Surrender and the Distribution of Policy Reserves, *Insurance: Mathematics and Economics*, 31, 3, 429-445.