

平成 18 年 5 月吉日

各位

日本保険・年金リスク学会  
研修会担当理事 金村・河野・清水

## JARIP 平成 18 年度第 1 回研修会のご案内

拝啓 時下益々ご清栄のこととお喜び申し上げます。

日本保険・年金リスク学会（JARIP）では、研修会を年 4 回程度予定しております。

平成 18 年度第 1 回研修会を下記のとおり開催いたしますので、各位の積極的なご参加をお願い申し上げます。

敬具

記

### 1. 研修会の概要（詳細は別紙）

日時： 2006 年 6 月 28 日（水）午後 3 時から 6 時

場所： ニッセイ同和損保 東京本社 42 階第 1 会議室（中央区明石町 8 - 1）

講師： 木島 正明氏（首都大学東京 大学院 社会科学研究科 教授）

テーマ：「保険料算出原理と金融工学」

### 2. 参加申込

参加者のお名前・組織名・会員種別・電話番号と領収書が必要な場合は宛名を明記の上、E-mail にて日本保険・年金リスク学会事務局 担当：中村迄お申し込み下さい。

申込〆切は、2006年6月23日（金）です。

メールアドレスを「JARIP研修会申込み」としていただきますようお願い致します。

E-mail: office@jarip.org

東京都千代田区丸の内2-5-2 三菱ビル9F 〒100-0005 京都大学経済研究所分室 内

Tel: 03-3201-5051 Fax: 03-3201-5058

### 3. 参加費

会員；4,000 円、 学生会員；1,000 円、 非会員；10,000 円

（法人会員は、3 名までは 1 人当り 4,000 円、それ以上は 1 人当り 10,000 円となります）

参加費は、研修会当日、会場受付にてお支払い下さい。

なお、領収書が必要な方は、必ず事前申込時に領収書の宛先をメールに記載して下さい。

以上

## JARIP 平成18年度第1回研修会

A．日時；2006年6月28日(水)午後3時から6時

B．場所；ニッセイ同和損保 東京本社42階第1会議室

〒104-8556 東京都中央区明石町8-1聖路加タワー

有楽町線新富町または日比谷線築地駅より徒歩8分



C．テーマ；保険料算出原理と金融工学

D．講師・プロフィール

木島 正明 氏（首都大学東京 大学院 社会科学部 教授）

1980年 東京工業大学 理学部 情報科学科 卒業

1985年 東京工業大学 大学院 理工学研究科 情報科学専攻 博士課程修了（理学博士）

1986年 米国 ロチェスター大学 経営大学院 博士課程修了（Ph.D.）

1986年 東京工業大学 理学部 情報科学科 助手

1989年 筑波大学社会 工学系 助教授

1997年 東京都立大学 経済学部 教授  
2001年 京都大学 大学院 経済学研究科 教授  
2006年 首都大学東京 大学院 社会科学部 教授（現在に至る）

Journal of Economic Dynamics and Control, Associate Editor

日本オペレーションズ・リサーチ学会 フェロー

1990年 第18回日本オペレーションズ・リサーチ学会文献賞

1999年 日本応用数理学会論文賞

#### E．講義の概要

保険商品の価格付けは、非完備市場における価格付け問題の一つなので、保険商品を無裁定の枠組みで価格付けするためにはそのリスク特性を理解する必要があります。本講演では、金融工学における価格付け理論の枠組みで保険料算出原理を考えます。特に、保険商品の価格付けにおいて利用されているエッシャー変換とワン変換について詳しく説明します。

以上