

平成 18 年 10 月 16 日

J A R I P 会員各位

日本保険・年金リスク学会  
研究会担当理事  
栗山晃・福田敬・臼杵政治

### J A R I P 平成 18 年度第 4 回研究会のご案内

拝啓 時下益々ご清栄のこととお慶び申し上げます。

さて、日本保険・年金リスク学会（J A R I P）では会員の研鑽のため、重要なテーマについてより深く研究討議を行う研究会を実施しております。平成 18 年度第 4 回の研究会を下記のとおり開催いたしますので、ご案内申し上げます。

今回は、成城大学の塚原先生に、ETH のデルバーン先生のもとで研究されたリスク尺度に関する成果等を解説していただきます。リスク尺度は、アクチュアリー分野でも変額年金で注目された C T E を始め、現在活発な研究が行われている分野です。

当 J A R I P の主要テーマでの 1 つである「リスク」について今回は数理的な視野からの貴重なご研究の報告を伺える絶好の機会です。

ご報告とその後の会員各位との質疑応答を通じて理解を深めていきたいと考えています。会員各位の積極的なご参加をお願い申し上げます。

敬具

記

#### 1 . 第 4 回研究会

日時：平成 18 年（2006 年）11 月 1 日（水）4 時から 6 時

場所：千代田区丸の内 2 - 1 - 1 明治安田生命マイプラザ会議室

（ティファニー宝石店横の明治安田生命の受け付けをお入りください）

[http://www.myplaza.jp/05\\_other/access.html](http://www.myplaza.jp/05_other/access.html)

講師：成城大学経済学部 塚原 英敦 助教授

（略歴をご参照ください）

講演題目：歪みリスク尺度の 1-パラメータ族とその応用

要旨：歪みリスク尺度の 1-パラメータ族を導入し、その性質を調べ、さらにリスク管理への応用を議論する。

その導出は法則不変かつ共単調リスクに対して加法的な整合的リスク尺度に対する楠岡の表現定理に基づいている。そこから期待ショートフォール (=CTE) との比較可能性を考慮して扱いやすいクラスを絞り込む。そのいくつかについて、数値的比較を行い、データに

基づく歪みリスク尺度の値の推定方法を検討する。さらに、リスク管理における利用や解釈について議論する。

## 2. 参加申込

参加希望者のお名前・所属組織名・E - メールアドレス・電話番号に加え、「第4回研究会への参加申込」と明記の上、E - メールにて

To : [office@jarip.org](mailto:office@jarip.org) (日本保険・年金リスク学会事務局 担当：中村祐子)

cc : [kuriyama\\_akira@mail.asahi-life.co.jp](mailto:kuriyama_akira@mail.asahi-life.co.jp) (同研究会担当：栗山晃)

迄お申込ください。参加申込は10月27日(金)迄とさせていただきます。

## 3. 参加費

研究会の参加費は無料ですが、資料代などの実費をカバーするため、会場にて1,000円程度のカンパをお願いしております。趣旨ご高配の上、ご協力いただきますよう宜しくお願い申し上げます。またカンパの趣旨から領収書の発行は行っておりません、ご了承いただきたくお願い申し上げます。

以上

## 講師の略歴

1988年 東京大学経済学部卒業

1996年 イリノイ大学アーバナ・シャンペーン校統計学科卒業 Ph.D (統計学)

現在、成城大学経済学部助教授