

平成20年11月10日

日本保険・年金リスク学会理事

栗山 晃、森本 祐司

デルバーン教授による公開講座およびセミナー実施のご案内

本年度の年次大会で特別講演をいただきました東京大学数理科学研究科教授の楠岡先生より、保険、ファイナンス数学の分野で著名な Prof. Dr. Freddy Delbaen の公開講座とセミナーのご案内をいただきましたので、ご連絡させていただきます。

公開講座は本年12月3日（水曜日）東京大学で実施されますが、本学会会員にも公開していただける運びとなりました。

また、来年2月には連続4回のセミナー開催を予定しております。このセミナーは日本アクチュアリー会会員およびJARIP(日本保険・年金リスク学会)会員を主たる対象にしたものであります。

詳細は、それぞれ以下の通りです。

本セミナーおよび公開講座はともに英語で行なわれ通訳はつきません。

(1) 公開講座

日時：12月3日（水）17：30－19：00

会場：東大駒場キャンパス数理科学研究棟 118号教室

テーマ："The structure of dynamic utility functions in a Brownian Filtration".

Abstract: The penalty function for monetary dynamic utility functions has a special form. They can be seen as potentials. In the Brownian Filtration Rao's theorem permits to give a complete description.

申込方法 (日本アクチュアリー会経由でお申込された方は、当方へのご連絡は不要です) :

参加希望者のお名前・所属組織名・Eメールアドレス・電話番号を記載していただき、

「デルバーン先生公開講座(12月3日)への参加申込」

と明記の上、Eメールで

To : office@jarip.org (日本保険・年金リスク学会事務局)

cc : 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11月27日(木曜日)迄とさせていただきます。

(2) セミナー

講演内容：リスク尺度に関する入門的講義

日程：2月5日、12日、19日、26日(全て木曜日)の夕方

会場：東大駒場キャンパス数理科学研究棟

2月5日、12日、19日は、056号室、2月26日 270号室

セミナー開催時間：17:00-18:30 (開始時間は30分前後する可能性あり)

費用：参加費用は不要

参加申込方法：1月早々に参加申込の受付をさせていただきます。

(再度通知連絡させていただきます)

講師の紹介 : Prof. Dr. Freddy Delbaen



ETH Zurich
Freddy Delbaen
Chair of Financial Mathematics
HG G 33.2
Rämistrasse 101
8092 Zürich
Tel: +41 44 632 34 78
Fax: +41 44 632 14 74
E-mail: freddy.delbaen@math.ethz.ch
Homepage of the organisational unit
<http://www.math.ethz.ch/Finance>

Curriculum vitae

On October 1, 1995, Freddy Delbaen was appointed full Professor at the Chair of Financial Mathematics. He directed many projects in this field. He retired end of May 2008.

Born November 21, 1946, in Duffel, Antwerp, Belgium, Freddy Delbaen studied mathematics at the Free University of Brussels (VUB) and graduated from there in 1971. The subject of his Ph.D. dissertation was Mathematical Economics.

Freddy Delbaen has published many papers in journals dealing with pure and applied mathematics, as well as insurance and financial mathematics.

He was invited Professor at many universities in Japan, Australia and China. He gave several talks as invited speaker at international conferences like the biannual meeting of the Bachelier Finance Society. He was president and vice president of BFS.

His research dealt with the mathematical theory of arbitrage and the study of risk measures.