

平成21年1月8日

JARIP会員各位

日本保険・年金リスク学会  
研究会担当理事、国際担当理事  
栗山晃・福田敬・清水信広・森本祐司

## デルバーン教授によるセミナー（講義）実施のご案内

拝啓 時下益々ご清栄のこととお慶び申し上げます。

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 のセミナー（講義）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。

今回のセミナーは2月に4回の連続講義の形態で東京大学にて実施いたします。

このセミナーは日本アクチュアリー会との共催としており、当学会会員および日本アクチュアリー会会員が主たる対象になります。

実施の詳細は、以下の通りです。

講義の後の質疑応答や意見交換を通じてさらに理解を深めていきたいと考えております。会員各位の積極的なご参加をお願い申し上げます。

なお、講義は英語で行なわれ通訳はつきません。

敬具

### 記

#### 1. セミナー（講義）

日程：2月5日、12日、19日、26日(全て木曜日)の17:00-18:30

会場：東大駒場キャンパス数理科学研究棟

(京王井の頭線-駒場東大前下車 徒歩5分 別紙 周辺地図をご参照ください)

2月5日は117号室

2月12日、19日は、056号室

2月26日 270号室

講義内容：「リスク尺度に関する入門的講義（全4回）」

数学的な入門講座（2回）と実務への応用講座（2回）を予定。

（学部ないし修士課程レベルの講義になります。）

（講義は板書で行なわれます、ノートの持参をお勧めします。）

（添付のピサ大学講義録「Coherent Risk Measure」をご参照ください）

講師：Prof. Dr. Freddy Delbaen 氏

(1995年より ETH Zurich Financial Mathematics の full Professor、2008年5月末で退職) (講師の経歴は添付資料ご参照下さい)

## 2. 参加申込

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、

「デルバーン先生セミナー (講義) (2月全4回)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1月28日(水曜日)迄とさせていただきます。

## 3. 参加費

今回のセミナー参加費は無料です。

以上

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](mailto:freddy.delbaen@math.ethz.ch)  
[Homepage of the organisational unit](#)

## 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.