

平成21年1月26日

JARIP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・清水信広

JARIP 平成20年度第7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（JARIP）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20年度第7回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、日本銀行金融研究所の吉羽 要直様より、「**コンピュータの金融実務での活用**」のテーマでご講演をいただきます。

コンピュータの定義からはじまり、具体的なコンピュータの構成方法、パラメトリックなコンピュータのパラメータ推定方法、特定のコンピュータに従う乱数の発生方法など、金融実務でコンピュータを利用する場合に必要なテクニックをご紹介いただき、金融実務での分析事例に基づくコンピュータの利用状況、利用上の問題点についても解説していただく予定です。

IAAがIAISに対してまとめた「保険者ソルベンシー評価のための国際的枠組み（2004）」においても、リスクの依存関係をモデル化する手法としてのコンピュータが「テール（極端な状況）の依存関係」を認識可能にするとの言及がされていますが、今までこれを学ぶ機会も限られておりました。今回は具体的な活用方法も含めて概説していただける、当学会のメンバーにとってまたとない機会となります。

ご講演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。

敬具

記

1. 第7回研究会

日時：平成21年（2009年）2月25日（水曜日） 15時から17時30分

場所：朝日生命大手町オフィス1階大会議室

（地下鉄大手町駅またはJR東京駅下車、徒歩5分）

（別紙 周辺地図をご参照下さい）

講師：吉羽 要直（よしば としなお）氏（日本銀行 金融研究所 企画役）

（講師略歴をご参照ください）

講演題目：「コンピュータの金融実務での活用」

講演の要旨：

コンピュータとは何か解説した後に、戸坂・吉羽[2005]に基づいて、具体的なコンピュータの構成方法、パラメトリックなコンピュータのパラメータ推定方法、特定のコンピュータに従う乱数の発生方法など金融実務でコンピュータを利用する場合に必要なテクニックを解説する。さらに、金融実務でコンピュータを用いた分析事例として、①資産ポートフォリオのリスク把握、②サブプライム問題で注目が集まった CDO (Collateralized Debt Obligation) の価格評価、などを取り上げ、どのようにコンピュータが利用されているかを解説するとともに、コンピュータ利用上の問題点を議論する。

バックグラウンド・ペーパー：

戸坂 凡展、吉羽 要直、「コンピュータの金融実務での具体的な活用方法の解説」、『金融研究』、第 24 巻別冊第 2 号、115～162 頁、日本銀行金融研究所、2005 年 12 月
<http://www.imes.boj.or.jp/japanese/kinyu/2005/kk24-b2-3.pdf>

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、
「2月25日の第7回研究会(吉羽要直氏)への参加申込」と明記の上、Eメールにて
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2月18日(水曜日)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、ご了承ください。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、ご了承ください。

以上

講師略歴：吉羽 要直 (よしば としなお) 氏

1993 年 東京大学大学院 工学系研究科 計数工学専攻 (数理工学) 修了

1993 年 日本銀行入行

2004 年 日本銀行 金融研究所 企画役

2003 年～2005 年 早稲田大学大学院 アジア太平洋研究科 非常勤講師 (統計)

2006 年～ 統計数理研究所 客員准教授