

平成20年8月22日

JARIP会員各位
非会員ご登録者各位

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4回研究会会場と開始時刻変更のお知らせ

拝啓 時下益々ご清栄のこととお慶び申し上げます。

すでにご案内させていただいておりました、JARIP 研究会につきまして、**諸事情により、下記のとおり研究会の【会場】と【開始時刻】を変更させていただきます。**

大変急なお知らせで申し訳ございません。
なにとぞ、よろしくお願い申し上げます

敬具

記

1. 第4回研究会

日時：平成20年（2008年）9月8日（月曜日） **2時30分から5時30分**
場所：**明治安田生命 マイプラザ会議室（千代田区丸の内2-1-1）**
（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）

（別紙 周辺地図をご参照下さい）

講師：田中 敬一先生
（講師略歴をご参照ください）

講演題目：「金利モデルと金利商品の価格付け」

講演の要旨：

金利商品（債券，金利スワップ，ベシススワップ，CMS 等）と代表的な金利モデルの特徴と価格付けについて概説した後，Kijima, Tanaka, Wong (2008)

<http://www.comp.metro-u.ac.jp/lib.keiei/rpspdf/043KijimaTanakaWong.pdf>

のDLGモデルを解説する。DLGモデルを活用した金利商品の価格付けを目標として，金融機関等におけるリスク管理への応用の可能性を議論する。

2. 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

講師略歴：田中 敬一(たなか けいいち)氏

- 1987 年 東京大学理学数学科卒業
- 1987 年 住友銀行入行
- 1992 年 スイス銀行入行
- 2001 年 UBS ウォーバーグ証券退職
- 2004 年 大阪大学大学院経済学研究科修了 博士（経済学）
- 2004 年 東京都立大学 COE 研究員
- 2004 年 日本銀行金融研究所リサーチアソシエイト
- 2005 年 京都大学大学院経済学研究科寄附講座助教授
- 2006 年 首都大学東京准教授