

日本保険・年金リスク学会 (JARIP) 第8回大会プログラム

日時：2010年10月2日（土曜日）9:30-17:00（受付開始 9:00）

場所：大手町サンケイプラザ 3F（301～304号室）

（最寄り駅：地下鉄大手町駅下車 A4・E1 出口直結、東京駅 丸の内北口より徒歩7分）

<http://www.s-plaza.com/map/index.html>

プログラム

- | | |
|-------------|--|
| 9:30-10:00 | 田中 周二会長講演 |
| 10:00-11:45 | 特別講演 「保険契約公開草案の概要」
山田 辰己（国際会計基準審議会理事） |
| 11:45-13:00 | 昼食 |
| 13:00-14:45 | 研究報告Ⅰ（第1会場、第2会場、第3会場） |
| 14:45-15:00 | 休憩（15分間） |
| 15:00-16:10 | 研究報告Ⅱ（第1会場、第2会場、第3会場） |
| 16:10-16:20 | 休憩（10分間） |
| 16:20-16:50 | 総会（第1会場） |
| 17:20- | 懇親会（大手町ビル「素材屋」） |

受付開始 9:00～ (3階 301～303号室)

会長講演および特別講演

9:30 - 11:45

座長：木村 和弘 (日本興亜損保)

「会長講演」

田中 周二会長 (日本大学 大学院総合基礎科学研究科)

特別講演「保険契約公開草案の概要」

山田 辰己 (国際会計基準審議会理事)

研究報告 I

13:00 - 14:45

※研究発表時間:30分 (質疑応答含む)

第1会場：301～302号室、第2会場：303号室、第3会場：304号室

■ 第1会場 リスク管理

座長：伊藤 和平 (三井住友海上保険)

○Optimal Default and Liquidation with Tangible Assets and Debt Renegotiation

後藤 允 (北海道大学 大学院経済学研究科)、木島 正明 (首都大学東京 社会科学部)、
鈴木 輝好 (北海道大学 大学院経済学研究科)

○正規コピュラの漸近的裾依存性

近藤 宏樹 (日新火災海上保険)、斎藤 新悟 (九州大学 大学院数理学研究院)

○システミックリスクを考慮したCDOのリスク評価—日本企業のCDSデータを用いた実証分析

大可 泰士 (慶応義塾大学 大学院理工学研究科)、今井 潤一 (慶応義塾大学 大学院理工学
研究科)

■ 第2会場 年金

座長：杉田 健 (中央三井信託銀行)

○企業年金制度における投資戦略再考

門田 伸一 (法政大学 理工学部経営システム工学科)

○長寿リスクに対するポートフォリオとGAO

浦谷 規 (法政大学 理工学部)

○一時金選択率の推定と会計上のリスク評価

井川 孝之 (みずほ総合研究所株式会社)

■ 第3会場 保険

座長：松山 直樹 (明治大学)

○生命保険会社の多期間にわたる株主資本モデル (仮称)

小倉 宏之 (東京工業大学 大学院イノベーションマネジメント研究科)

○保険料計算原理の統一的表現

岩沢 宏和 (個人)

○保険会社のリスク管理

河野 年洋 (ソニーライフエイゴン生命保険)

研究報告 II

15 : 00 – 16 : 10

※研究発表時間:30分 (質疑応答含む)

第1会場 : 301~302号室、第2会場 : 303号室、第3会場 : 304号室

■ 第1会場 リスク管理

座長 : 河原崎 純一 (三井住友きらめき生命)

○統合リスク資本の評価と使用上の留意点

菅野 正泰 (神奈川大学 経営学部)

○A Study on Risk Integration and Risk Amount (リスクの統合とリスク量に関する一考察)

相原 浩司 (トーマツ)、清水 宏久 (トーマツ)、藤井 栄治エドワード (トーマツ)

■ 第2会場 年金

座長 : 白杵 政治 (ニッセイ基礎研究所)

○期間構造リスクを考慮したLDIの再評価

乾 孝治 (明治大学 グローバルビジネス研究科)

○直列型ハイブリッド制度におけるリスク分担と年金化インセンティブの可能性

清水 信広 (農業者年金基金)

■ 第3会場 保険

座長 : 山内 恒人 (ネクスティア生命)

○生保法人税課税ベースの適正化—国際会計基準および欧米税制との調和を目指して—

山本 信一 (立命館大学 経済学部)

○変額年金 Now and Then

大塚 忠義 (マニユライフ生命)

総会

16 : 20 – 16 : 50

301~302号室

懇親会

17 : 20 – 19 : 30

大手町ビルヂング地下1階「素材屋 大手町ビル店」

以上