

2014年7月吉日

JARIP 会員各位

日本保険・年金リスク学会  
研究会担当理事  
伊藤・河野・原田・岩沢

## JARIP 2014年度第1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。2014年度第1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、**清水泰隆氏**（早稲田大学理工学術院 准教授）より、  
「**Risk Theory(破産理論)のこれまでとこれから**」  
のテーマでご講演をいただきます。

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1回研究会

日時：2014年8月21日（木） 14時から17時

場所：東京海上日動ビル新館15F（添付地図の通り）

〔住所〕東京都千代田区丸の内1-2-1

講師：**清水泰隆氏**（博士：数理学）

早稲田大学理工学術院 応用数理学科 准教授

（講師略歴をご参照ください）

講演題目：「**Risk Theory(破産理論)のこれまでとこれから**」

講演概要：

保険数理におけるRisk Theoryと言え、欧米ではいわゆる破産理論を意味し、損保数理の一分野としてアクチュアリー教科書でもおなじみであるが、H. CramérやF. Lundbergらが創始したいわゆる古典的破産理論は、累積クレーム額を複合ポアソン過程で表現し、保険会社の破産確率を評価するというシンプルな設定のせい、これまで実務で応用されることは少なかった。

しかしその裏で、破産理論は応用数学の一分野として固有の発展を遂げ、現在もその研究は盛んである。特に近年、H. Gerber氏とE. Shiu氏らが導入した割引罰則関数(Gerber-Shiu

関数)は、より広い意味での破産リスクを解析することが可能で、ファイナンスやリスク管理への応用の観点からも注目を集めている。

また、近年は確率過程の理論的發展に伴い、レヴィ過程などを用いたより複雑なリスクモデルが提案されており、それらに基づく一般化Gerber-Shiu解析は、信用リスク解析や配当・準備金評価の問題などに広く応用可能である。

本講演では、アクチュアリー教科書の内容を「これまでの破産理論」として復習し、その後の破産理論が辿った数学的發展について概観しながら、その利用価値や今後の発展・展開について議論したい。

## 2. 参加申し込み

期日：8月13日(水)

学会サイトの【専用申込フォーム】よりお願い申し上げます。

<http://www.jarip.org/>

## 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、ご了承くださいたくお願い申し上げます。

以上

## 講師略歴：

清水泰隆氏(博士：数理科学)

1999年3月 東京大学理学部数学科卒業

(同年10月まで 第一生命保険相互会社に勤務)

2001年4月 東京大学大学院数理科学研究科 修士課程入学

(～2005年3月に博士課程中退)

2005年4月 大阪大学大学院基礎工学研究科 助手

2011年10月 大阪大学大学院基礎工学研究科 准教授

2014年4月 早稲田大学理工学術院 応用数理学科 准教授

現在に至る

# 東京海上日動ビル案内図

