

2016年6月吉日

各位

日本保険・年金リスク学会
研修会担当理事 大塚・河野・田中・原田・吉田

JARIP 研修会のご案内

拝啓 時下益々ご清栄のこととお慶び申し上げます。

日本保険・年金リスク学会（JARIP）の研修会を下記のとおり開催しますので、各位の積極的なご参加をお願い申し上げます。

敬具

記

1. 研修会の概要

日時：2016年8月8日（月曜日） 開始：14:00、 終了：17:00

場所：ラ・メール三番町ビル内 東京海上日動会議室（東京都千代田区三番町 6-4、地図は次頁）

講師：櫻井 豊 氏

リサーチアンドプライシングテクノロジー株式会社（RP テック）取締役（講師略歴は次頁）

講演題目：「数理ファイナンスの歴史と現在」

講演概要：

講師は今春、『数理ファイナンスの歴史』（金融財政事情研究会）という本を上梓した。これは、金融工学や資産運用に直接的に関連する経済やファイナンスの理論、概念や技術の発展を、歴史の視点でまとめたユニークな本であり、1900年のルイ・バシュリエから、最近のフィンテックやAIのトピックまでカバーしている。

本講演では、この本の内容などから数理ファイナンスに関するいくつかの重要な概念や手法を取り上げ、その概念や手法を軸にして数理ファイナンスの歴史を振り返るとともに、現在の立ち位置を考えたい。取り上げる予定の手法や概念は次のとおり。

- ・ ランダムウォーク理論の成立とその限界
- ・ 均衡と価格：ブラック・ショールズ・モデル成立までの経緯と現実の市場
- ・ 実測度とリスク中立測度：概念の成立と現在（保険の視点も交えて）
- ・ 無リスク金利、ファンディング・コスト、割引金利
- ・ 演繹的思考と帰納的思考

2. 参加費 会員・学生会員；無料、 非会員；5,000 円

（法人会員は、3名までは無料、それ以上は1人当り5,000円）

→ 研修会当日、会場受付にてお支払い下さい。

3. 参加申し込み

期日：2016年7月29日（金）

学会サイトの【専用申込フォーム】より申し込みください。 <http://www.jarip.org/>

- 申込者数が定員70名に達した場合は、その時点で締め切ります。
- 今回は参加者多数が想定され、参加申込を会員優先とするため、次の方式とします。

- ✓ 会員(含. 法人会員の3人目まで)の参加申込は、本案内文発信後、即時受付開始します。
 - ✓ 非会員(含. 法人会員の4人目以降)の参加申込は、7月1日から受付開始します。
- このため、仮に6月30日以前に定員に達した場合、非会員の方は申込できません。

4. 講師略歴

1986年、東京銀行（現三菱東京UFJ銀行）入行。2000年にソニーのネット銀行設立メンバーに加わり、ソニー銀行執行役員市場運用部長などを経て2010年よりリサーチアンドプライシングテクノロジー株式会社（RPテック）取締役。入行当初よりほぼ一貫して金融市場におけるさまざまな金融商品を用いたトレーディング、資産運用などの業務に従事。著書に『数理ファイナンスの歴史』など。日本アクチュアリー会準会員。早稲田大学理工学部数学科卒。

以上

[会場地図] ラ・メール三番町ビル内 東京海上日動会議室（東京都千代田区三番町6-4）

