

# 日本保険・年金リスク学会(JARIP)第1回大会プログラム

設立大会 ■第一会場	10:00~11:00 1. 大会宣言 2. 会則の承認 3. 評議員の承認 4. 評議員による会長および副会長の承認 5. 会長による理事の推薦 6. 今年度予算について 7. 会長あいさつ		
研究報告 ■第一会場	11:15~12:15 保険料計算原理 座長: 田中周二(ニッセイ基礎研究所)	■第二会場	11:15~12:15 年金 座長: 杉田健(三井アセット信託)
11:15~11:45	「確率表現関数による保険料率計算」 発表者: 森平爽一郎(慶応義塾大学)		「受給権にもとづく債務評価」 山口修(住友信託)
11:45~12:15	「米国における主要商品およびプライシング」 発表者: 大塚忠義(RGA再保険会社)		「2004年公的年金改革について-スウェーデンの年金改革を参考に-」 小野正昭(みずほ年金研究所)
	12:15~13:15 昼食		
研究報告 ■第一会場	13:15~14:15 死亡率 座長: 金村慶二(住友生命)	■第二会場	13:15~14:15 シミュレーション 座長: 湯前祥二(ニッセイ基礎研究所)
13:15~13:45	「ノンパラメトリック回帰分析と生命表」 発表者: 小暮厚之(慶応義塾大学)		“Dynamic Fund Protection” 発表者: 今井潤一(岩手県立大学), Phelim P. Boyle
13:45~14:15	「生命関数の数式近似」 発表者: 荒井昭(UFJ信託銀行)		「グリッドコンピューティングを用いたリスク管理計算高速化」 発表者: 村田浩樹, 手塚集(IBM東京基礎研究所)
研究報告 ■第一会場	14:15~15:15 ALM 座長: 森本祐司(インテグレイテッド・ファイナンス証券)	■第二会場	14:15~15:15 保険商品 座長: 朝香智雄(東京海上火災)
14:15~14:45	「生保ALMの現状と課題」 発表者: 松山直樹(明治生命)		“Modeling Insurance Surrenders by the Negative Binomial Model” 発表者: 神楽岡優昌(武蔵大学)
14:45~15:15	「バランスシート型生保ALMにおける保険負債の評価-デフォルトスワップモデル-」 発表者: 田中周二, 室町幸雄(ニッセイ基礎研究所)		「気温リスク・スワップの合理的ペイオフ関数決定法に関する考察」 発表者: 西田真二(東京海上火災)
研究報告 ■第一会場	15:15~16:45 保険会計とリスク管理 座長: 吉田靖(住友生命)	■第二会場	15:15~16:45 保険とファイナンス理論 座長: 小守林克哉(みずほ第一FT)
15:15~15:45	「IAAにおけるソルベンシー評価の世界的枠組みの検討状況」 発表者: 河野年洋(ニッセイ同和損害)		「VaRのバイアスと内挿・外挿による修正」 発表者: 乾孝治(京都大学)
15:45~16:15	「国際財務報告基準と生保負債の公正価値」 発表者: 三石宣史(フトソンワイアット・インシュランス・コンサルティング)		“Implications of the Financial Intermediation Theory to Insurers” 発表者: 神谷信一
16:15~16:45	「保険負債公正価値に関する指標について」 発表者: 森本祐司(インテグレイテッド・ファイナンス証券)		“An Efficient Frontier for Participating Policies in a Continuous-Time Economy” 発表者: 岩城秀樹(京都大学), 湯前祥二(ニッセイ基礎研究所)
17:30~	懇親会 会場: 中国飯店(慶応大学東門前)		

(注) 研究発表については発表20分, 質疑・コメント10分.