

## 日本保険・年金リスク学会（JARIP）第3回大会プログラム

日時：2005年10月01日（土曜日）10:00-17:30

場所：日本大学文理学部 百周年記念館 国際会議場

### プログラム

10:00-12:00	研究報告 I
12:00-13:00	昼休み（1時間）
13:00-13:30	総会
	休憩（10分間）
13:40-14:40	刈屋武昭会長（明治大学）講演 「金融保険融合の流れと「保険会社」の将来はあるか —アクチュアリーは—」
	休憩（10分間）
14:50-15:50	Shaun Wang 准教授（Georgia State University）講演 「Risk-based Valuation of Insurance Liabilities and Contingent Claims」
	休憩（10分間）
16:00-17:30	研究報告 II
17:30-	懇親会

■ 第一会場 保険ファイナンス

座長：乾孝治（明治大学）

「Multi-period ALM Optimization Model for a Household」

枇々木規雄(慶應義塾大学), 小守林克哉(みずほ第一フィナンシャルテクノロジー),  
豊田暢子(みずほ第一フィナンシャルテクノロジー)

「構造モデルによる年金負債の評価」

鈴木輝好（北海道大学）

「オランダの新保険年金財務規制

～EU 財務評価フレームワーク実現の先駆的試み～」

田中周二（ニッセイ基礎研究所）

「安全資産にシフトした年金基金の積立不足解消の検討」

中井真人（金融エンジニアリング・グループ）

■ 第二会場 公的年金

座長：坂本純一（野村総合研究所）

「行動ファイナンスと国民年金」

佐々木一郎（広島経済大）

「マイクロ・シミュレーションモデルによる社会経済構造の将来推計」

稲垣誠一（農業者年金基金）

「安定人口理論とスウェーデンNDC方式の持続可能条件」

畑満（社会保険診療報酬支払基金）

「主観的要因からみた国民年金被保険者の加入・納付行動とその意思」

白杵政治（ニッセイ基礎研究所），中嶋邦夫（ニッセイ基礎研究所），北村智紀（ニッセイ基礎研究所）

■ 第一会場 変額年金

座長：松山直樹（明治安田生命保険）

「変額年金の責任準備金とヘッジ戦略の効率的計算手法の構築」

田中周二（ニッセイ基礎研究所），湯前祥二（ニッセイ基礎研究所）

「変額年金保険の理論と実際」

秋山豪太（三井アセット信託銀行），国友直人（東京大学）

「保険と多期間リスク尺度」

森本祐司（インテグレイティド・ファイナンス証券）

■ 第二会場 損害保険

座長：酒井重人（スイス・リー・キャピタルマーケット証券会社）

「損害保険ベータの推定と保険 CAPM 日本の損保は儲けすぎか？」

森平爽一郎（慶應義塾大学），神谷信一（ウィスコンシン大学）

「金融機関における情報システム化投資の定量評価

ーゲーム理論とリアルオプションの融合モデルー」

青木克人（埼玉大学）

「日本の自動車保険ボーナス・マラス制度は効率的か？」

神谷信一（ウィスコンシン大学），東城和仁