

## 日本保険・年金リスク学会（J A R I P）第4回大会プログラム

日時：2006年10月14日（土曜日）10:00－17:30

場所：慶應義塾大学・三田キャンパス 東館

<http://www.keio.ac.jp/access.html>

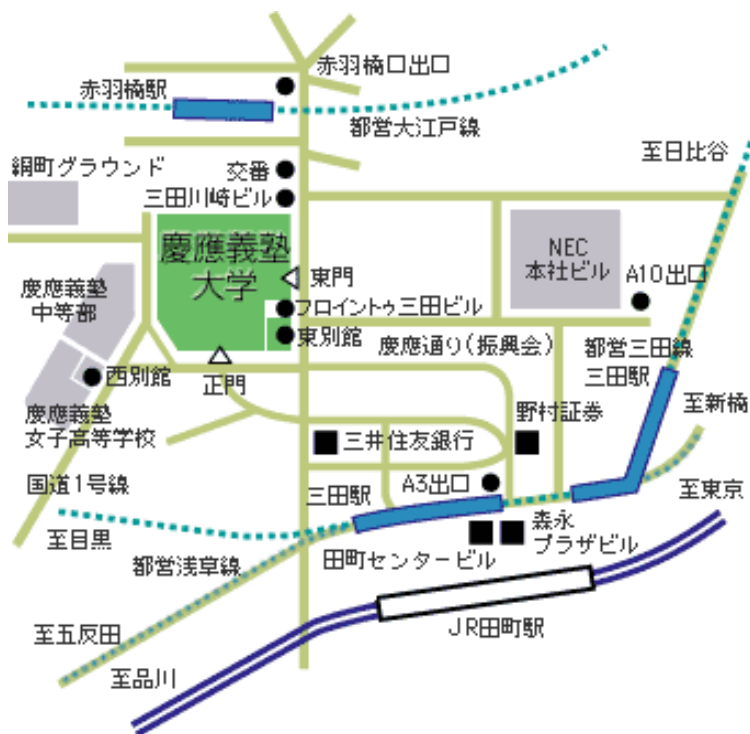
### プログラム

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
13:30－13:40	休憩（10分間）
13:40－14:40	森平 爽一郎教授（慶應義塾大学）講演 チュートリアル 「寿命（Mortality）リスクと その証券化：モデリングの展望」
14:40－14:50	休憩（10分間）
14:50－15:50	研究報告Ⅱ
15:50－16:00	休憩（10分間）
16:00－17:30	研究報告Ⅲ
18:00－	懇親会（中国飯店・三田店）

中国飯店・三田店へのアクセス：東門より徒歩1分

<http://www.chuugokuhanten.com/storemita/index.html>

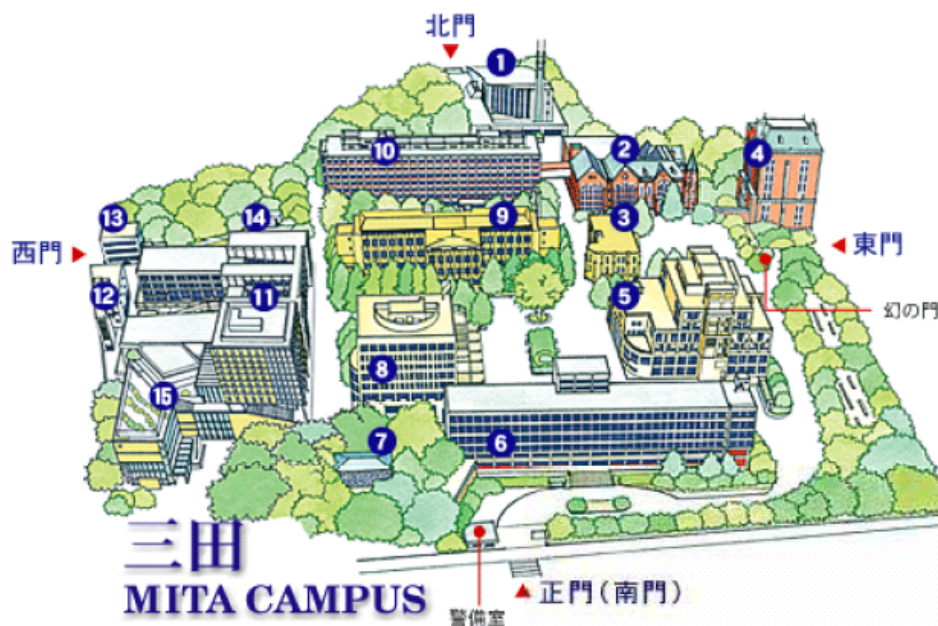
慶應義塾大学・三田キャンパス  
〒108-8345 東京都港区三田 2-15-45



- ・JR 山手線、京浜東北線  
田町駅下車(徒歩 8 分)
- ・都営地下鉄浅草線  
都営地下鉄三田線  
三田駅下車(徒歩 7 分)
- ・都営地下鉄大江戸線  
赤羽橋駅下車(徒歩 8 分)

- ※東京～田町:約 10 分
- ※上野～田町:約 20 分
- ※渋谷～田町:約 15 分
- ※水道橋～三田:約 15 分

東館 : ④ の建物(東門の上にあります。)  
東門から入るとわかりやすいです。



※ 発表時間:30分(質疑応答含む)

**研究報告 I 10:00-12:00**

■ 第1会場 保険とデリバティブズ 座長：室町 幸雄（ニッセイ基礎研究所）

「生命保険契約における転換権のオプション価値評価」

門田 伸一（野村証券株式会社 金融経済研究所 金融工学研究センター）

「保証付き年金オプションの評価」

国友 直人（東京大学大学院経済学研究科），室井 芳史（大阪大学金融・保険教育研究センター）

「保険数理への「熱力学」的アプローチ」

赤堀 次郎（立命館大学理工学部数理科学科），西田 真穂（ソニー生命），

矢野 孝次（京都大学数理解析研究所）

「生命保険会社における死亡リスク・スワップ取引とその価格付けモデル」

小島 茂（東京海上日動フィナンシャル生命）

■ 第2会場 年金（1） 座長：小守林 克哉（金融情報システムセンター）

「厚生年金制度の通知による30代・40代の態度変化企業」

中嶋 邦夫，臼杵 政治，北村 智紀（ニッセイ基礎研究所 金融研究部門）

「公的年金制度における財政の自動均衡措置に関する留意点」

坂本 純一（野村総合研究所）

「母体企業の倒産等に伴う年金受給権の喪失プロセスと対応のあり方」

清水 信宏（年金積立金管理運用独立行政法人）

「企業年金制度改革」

戸塚 達也（三井住友銀行）

**チュートリアル（第1会場） 13:40-14:40**

座長：田中周二（ニッセイ基礎研究所）

「寿命（Mortality）リスクとその証券化：モデリングの展望」

森平 爽一郎 教授（慶應義塾大学 総合政策学部）

## 研究報告 II 14:50-15:50

### ■ 第1会場 保険会社のリスク管理（1） 座長：白井 健史(東京海上日動火災保険)

「生命保険会社の ERM」

田中 周二 (ニッセイ基礎研究所), 山本 信一 (立命館大学),  
室町 幸雄 (ニッセイ基礎研究所)

「損害保険会社の資本コスト推計と資本管理」

白須 洋子(金融庁金融研究研修センター), 小守林 克哉(金融情報システムセンター)  
森平 爽一郎(慶應義塾大学 総合政策学部)

### ■ 第2会場 年金（2） 座長：鈴木 輝好(北海道大学大学院 経済学研究科)

「年金基金における運用パフォーマンス格差の構造を探る」

日暮 昭(インテリジェント・インフォメーション・サービス)

「年金リスクを内包した最適資本構成」

川上 高志 (ニッセイ基礎研究所), 木島 正明 (首都大学東京),  
湯前 祥二 (法政大学 経済学部)

## 研究報告 III 16:00-17:30

### ■ 第1会場 保険会社のリスク管理（2） 座長：湯前 祥二 (法政大学)

「金利リスクに関する期待ショートフォールの算出におけるボラティリティ変動対数  
正規分布によるアプローチ」

白井 健史(東京海上日動火災保険 リスク管理部)

「An Extension of the Wang Transform Derived from Buhlmann's Economic  
Premium Principle for Insurance Risk」

木島 正明 (首都大学東京), 室町 幸雄 (ニッセイ基礎研究所)

「Esscher 変換のノンパラメトリック・アプローチ：経験積率母関数 EMGF)による」

森平 爽一郎 (慶應義塾大学 総合政策学部)

### ■ 第2会場 パーソナル・ファイナンス 座長：吉田 靖 (千葉商科大学)

「世帯主の死亡に伴うキャッシュ・フロー変化を考慮した多期間最適資産形成モデル」  
枇々木 規雄 (慶應義塾大学 理工学部), 小守林 克哉 (金融情報システムセンター)

「地震による家屋の損壊と家計の最適投資消費計画」

鈴木 輝好(北海道大学大学院 経済学研究科)

「パーソナル・ファイナンスにおけるリスク管理と年金資産選択等」

杉田 健(三井アセット信託銀行 年金リサーチセンター)