

日本保険・年金リスク学会（JARIP）第5回大会プログラム

日時：2007年9月22日（土曜日）10:00 - 17:00

場所：早稲田大学大学院ファイナンス研究科 日本橋キャンパス(コレド日本橋)

<http://www.waseda.jp/wnfs/campus/index.html>

プログラム

10:00 - 11:30	研究報告
11:30 - 12:30	昼休み（1時間）
12:30 - 13:00	総会
13:00 - 13:10	休憩（10分間）
13:10 - 14:10	森平 爽一郎 会長（早稲田大学大学院ファイナンス研究科 教授） 会長講演 「予測市場は何をもたらすのか？ 機能と均衡分析」
14:10 - 14:20	休憩（10分間）
14:20 - 15:20	研究報告
15:20 - 15:30	休憩（10分間）
15:30 - 17:00	研究報告
17:15 -	懇親会（紅花別館）

中央区日本橋 1-2-15 TEL 03-3271-0600

紅花別館へのアクセス：コレド日本橋より徒歩2分

<http://r.gnavi.co.jp/g016202/map1.htm>

発表時間:30分(質疑応答含む)

第1会場:ホール, 第2会場:教室8

研究報告 10:00 - 11:30

第1会場 **保険と効率性** 座長:小守林 克哉(早稲田大学大学院ファイナンス研究科)

「規制緩和後のわが国損保業の再編と効率性・生産性への影響」

柳瀬 典由(東京経済大学)、浅井 義裕(城西大学)、富村 圭(名古屋大学大学院)、
尾関 淳哉(名古屋大学大学院)

「わが国生命保険業の生産性 規制緩和後の変化に関する考察」

浅井 義裕(城西大学)、柳瀬 典由(東京経済大学)、富村 圭(名古屋大学大学院)、
尾関 淳哉(名古屋大学大学院)

「自動車保険が損害保険企業の経営に及ぼした影響:自動車保険へのシフトは損害保険企業にとって合理的な行動だったのか?」

米山 高生(一橋大学大学院商学研究科)、宮下 洋(京都産業大学経営学部)

第2会場 **リスク評価** 座長:白井 健史(東京海上日動火災保険)

「Management of Demand Information Risk in China: Exchange of Technology and Information」

姜 英英(一橋大学商学研究科)

「長寿リスク評価へのベイズ統計モデリング」

小暮 厚之(慶應義塾大学総合政策学部)、橘川 研史(大和証券 SMBC)、
倉知 善行(東京大学大学院・経済学研究科金融システム専攻)

「地震をトリガーとした金融機関の信用リスク計測」

菅野正泰(新日本監査法人 Ernst & Young)

会長講演(第1会場) 13:10 - 14:10

座長:小暮 厚之(慶應義塾大学総合政策学部)

「予測市場は何をもたらすのか? 機能と均衡分析」

森平 爽一郎 会長(早稲田大学大学院ファイナンス研究科 教授)

発表時間:30分(質疑応答含む)

第1会場:ホール, 第2会場:教室8

研究報告 14:20 - 15:20

第1会場 **生命保険(1)**

座長: 田中 周二(日本大学文理学部)

「生命保険株式会社の自己資本評価」

小倉 宏之(早稲田大学大学院ファイナンス研究科)

「民間の医療保険商品選択時における疾病リスクと加入条件」

梶原 秀徳((有)ファーストスピード、電気通信大学 情報システム学研究科)

第2会場 **損害保険**

座長: 柳瀬 典由(東京経済大学)

「金融不祥事と市場の反応 上場保険会社に関する実証分析」

白須 洋子(金融庁金融研究研修センター)

吉田 靖(千葉商科大学大学院会計ファイナンス研究科)

「保険元受けサイクルの推定: 企業とマクロ市場」

森平 爽一郎(早稲田大学大学院ファイナンス研究科)

研究報告 15:30 - 17:00

第1会場 **生命保険(2)**

座長: 白須 洋子(金融庁金融研究研修センター)

「生命保険契約における基礎率変更と破綻処理の比較」

門田 伸一(野村證券株式会社 フィデューシャリー・サービス研究センター)

「生命保険契約の価格分析」

吉井 薫(日本大学大学院総合基礎科学研究科)、田中 周二(日本大学文理学部)

「生命保険会社の負債評価」

川辺 幹久(日本大学大学院総合基礎科学研究科)、田中 周二(日本大学文理学部)

第2会場 **保険と最適化**

座長: 吉田 靖(千葉商科大学)

「Optimal Insurance Coverage for a Durable Consumption Good with a Premium Loading in a Continuous Time Economy」

鈴木 輝好(北海道大学大学院経済学研究科)

「最適保険設計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管理工学科)

「多期間最適化モデルを用いた保険 ALM 戦略」

西村 寿夫(三井生命保険株式会社運用企画グループ、慶應義塾大学大学院理工学研究科)

枇々木 規雄(慶應義塾大学理工学部管理工学科)

早稲田大学大学院ファイナンス研究科 日本橋キャンパス

〒103-0027 東京都中央区日本橋 1-4-1

日本橋一丁目ビルディング 5階 (コレド日本橋)

<http://www.waseda.jp/wnfs/campus/index.html>



東京メトロ銀座線・東西線・都営地下鉄浅草線「日本橋」駅出口直結 (B12.C1.C2 出口)

懇親会会場：紅花別館：コレド日本橋より徒歩2分

