

日本保険・年金リスク学会（JARIP）第10回大会プログラム

日時：2012年11月10日（土曜日）10:00－17:40（受付開始9:30）

場所：東京大学 駒場キャンパス 数理科学研究科棟

（〒153-8914 東京都目黒区駒場3-8-1）

大講義室、中講義室（117号室、123号室）

（受付：大講義室前）

（最寄り駅：京王井の頭線 駒場東大前駅徒歩5分）

<http://www.ms.u-tokyo.ac.jp/access/index.html>

プログラム

- | | |
|-------------|--|
| 10:00－11:30 | 楠岡 成雄 会長 会長講演
「金融リスクの計量化の再検討：統計データとは何か」 |
| 11:30－12:45 | 昼食 |
| 12:45－14:45 | 研究報告Ⅰ（第1会場、第2会場、第3会場） |
| 14:45－15:00 | 休憩（15分間） |
| 15:00－17:00 | 研究報告Ⅱ（第1会場、第2会場、第3会場） |
| 17:10－17:40 | 総会（第1会場） |
| 17:50－20:00 | 懇親会 |

於：東京大学駒場キャンパス「駒場レストラン」

駒場コミュニケーション・プラザ 南館 3F

受付開始 9:30～（大講義室前）

会長講演 10:00 – 11:30

座長：菅野 正泰（神奈川大学 経営学部）

「金融リスクの計量化の再検討：統計データとは何か」

楠岡 成雄会長（東京大学 大学院数理科学研究科教授）

研究報告 I 12:45 – 14:45

※研究発表時間:40分（質疑応答 8分含む）

第1会場：大講義室、第2会場：中講義室 117号室、第3会場：中講義室 123号室
いずれも1Fです。

■第1会場 リスク管理・ファイナンス系

座長：乾 孝治（明治大学 大学院グローバルビジネス研究科）

○バブルの生成と崩壊に関する変化点探索

藤崎 朋美（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）

○Nested Stochastic Simulationを用いた変額年金保険のリスク管理

中村 孝行（明治大学 大学院理工学研究科）、西口悠樹（明治大学 大学院理工学研究科）

○カウンターパーティーリスクを考慮したエネルギーデリバティブの価格付け

坂本 秀和（株三井住友銀行）、室町 幸雄（首都大学東京 大学院社会科学研究所）

■第2会場 年金

座長：臼杵 政治（名古屋市立大学 経済学部）

○厚生年金基金の財政運営基準に関する一考察

杉田 健（三井住友信託銀行株式会社）

○母体財務への影響を考慮した年金資産運用

川口 宗紀（株三菱UFJトラスト投資工学研究所）、枇々木 規雄（慶應義塾大学 理工学部）

○CSR評価と株式パフォーマンスの関係について（仮題）

菊池 俊博（公益財団法人年金シニアプラン総合研究機構）、宮井 博（日興フィナンシャル・インテリジェンス株）、白須 洋子（青山学院大学 経済学部）

■第3会場 保険・実証系

座長：小暮 厚之（慶應義塾大学 総合政策学部）

○Wang 変換による保険料算出原理とHermite多項式

近藤 宏樹（日新火災海上保険株式会社）、斎藤 新悟（九州大学 マス・フォア・インダストリ研究所）

○A Continuous-Time Optimal Insurance Design with Costly Monitoring

中村 恒（一橋大学 大学院商学研究科）、高岡 浩一郎（一橋大学 大学院商学研究科）

○ベイズ統計を用いたコーホート合計特殊出生率の分析と予測

渡辺 拓人（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）

研究報告Ⅱ 15:00-17:00

※研究発表時間:40分(質疑応答8分含む)

第1会場:大講義室、第2会場:中講義室117号室、第3会場:中講義室123号室

■第1会場 リスク管理・ファイナンス系

座長:菅野正泰(神奈川大学 経営学部)

○TARCH-DDC/MESによるわが国のSystemic Riskに関する実証分析

永田真一(明治大学 大学院先端数理科学研究科)、乾孝治(明治大学 大学院グローバルビジネス研究科)

○システム上重要な金融機関(SIFIs)の認定手法に関する検証

近藤隆則(一橋大学 大学院商学研究科)、白須洋子(青山学院大学 経済学部)、
吉野直行(慶應義塾大学 経済学部)

○グローバル金融危機時の損害保険会社のシステミック・リスクの影響度分析—銀行との対
比検証—

菅野正泰(神奈川大学 経営学部)

■第2会場 年金

座長:田中周二(日本大学 文理学部)

○Lee-Carterモデルの残差構造のモデリングと死亡率予測

井川孝之(みずほ総合研究所株式会社)

○公的年金と国債金利の影響モデル

浦谷規(法政大学 理工学部)、小澤正典(慶應義塾大学 理工学部)

■第3会場 保険・実証系

座長:岩沢宏和(個人)

○保険会社以外の保険・共済事業者について

相原浩司(有限責任監査法人 トーマツ)

○べき型分布に従うリスクに関する純保険料および準備金の価格付け

小倉宏之(日本経営数理コンサルティング株式会社)

○保険会社等におけるバリュー株投資の可能性—EU危機・国際会計基準の下での銘柄選別に
ついての—考察—

山本信一(立命館大学 経済学部)、中路翔(一橋大学 大学院商学研究科)

総会 17:10-17:40

(1F) 大講義室

懇親会 17:50-20:00

於:東京大学 駒場キャンパス 駒場レストラン
駒場コミュニケーション・プラザ南館3F

以上