JARIP2015　研究発表大会　2015/10/31土　損保会館（東京・御茶ノ水）
タイムスケジュール（ver.3　10/26）

時間帯		第1会場: 502－503号室						第2会場: 404号室					
開始	終了	セッション名	座長	発表タイトル	キーワード	発表者	討論者	セッション名	座長	404	キーワード	発表者	討論者
9:00	9:15	受付											
9:15	9:50	第1セッション 経済物理・数理	岩沢宏和	統計的市場競合モデルにおけるリスク選好が異なる群団の占有図と臨界現象	市場競合、戦略、リスク、相転移、臨界現象	大塚裕次朗（ミリマン）	中島禎志	第1セッション 年金設計・保険教育	金村慶二（住友生命保険相互会社）	障害年金の制度設計を問う ― 若年性アルツハイマー病の視点から ―	若年性アルツハイマー病	鵜田正博（順天堂大学）	藤澤陽介
9:50	10:25			保険会社の存続問題2		西岡國雄（中央大学商学部）、中島禎志（東京電機大学理工学部）、佐藤定夫（東京電機大学理工学部）	大塚裕次朗			我が国におけるアクチュリー 専門職教育の必要性に係る考察	アクチュアリー教育	大塚忠義（早稲田大学院商研究科）、藤澤陽介（RGAリインシュアラスカバニー）、佐藤政洋（東京海上日動火災保険株式会社）	鵜田正博
10:25	11:00	第2セッション プライシング・実証分析	吉田靖（東京経済大学経営学部）	複数の事故の組み合わせからなる保険の価格付けー期間構造のある場合ー	保険料、条件付き確率、相関係数	小倉宏之（日本経営数理コンサルティング株式会社）	森平爽一郎	第2セッション 年金	井川孝之（PwCあらた監査法人）	金利連動型キャッシュバランス制度の市場整合的評価の金利モデルによる差異について	金利、キャッシュバランス制度、企業年金、Vasicekモデル、CIRモデル	杉田健（三井住友信託銀行）	小澤正典、浦谷規
11:00	11:35			インフレ保険とインフレリスクを考慮した保険と年金の価値	インフレ保険、物価に関するコールオプション、物価連動国債、プライシング・カーネル、Fisher 方程式	森平爽一郎（早稲田大学大学院ファイナンス研究科）、湯山智教（早稲田大学大学院商学研究科）	小倉宏之			年金積立金運用ポートフォリオのスライド調整への影響	基本ポートフォリオ、スライド調整、シミュレーション	小澤正典（慶應義塾大学理工学部）、浦谷規（法政大学理工学部）	清水信広
11:35	12:10			再保険の利用による企業価値効果の実証分析 -日本の上場保険会社のリターンとリスクの関係からの考察-	企業価値、リスクの移転、超過リターン、再保険の需要と供給	工藤美保子（ 有限責任監査法人トーマツ）	神谷信一			改訂IAS19による確定給付負債の測定の現状と課題	確定給付義務の測定、IAS19、概念フレームワークの見直し、負債のリスク性、状態価格密度	清水信広（厚生労働省年金局）	臼杵政治
12:10	12:45			Credit Crunch and Insurance Consumption: The Aftermath of the Subprime Mortgage Crisis	banking crisis, credit, auto loan, insurance	神谷信一（Nanyang Technological University, Singapore）	工藤美保子			賃金に連動する公的年金に上乗せされる確定拠出年金の最適資産配分について		臼杵政治（名古屋市立大学大学院経済学研究科）	杉田健
12:45	13:20	昼休み		評議員・理事会									
13:20	13:55	会長講演	菅野正泰(神奈川大学)			楠岡成雄会長							
13:55	14:00	移動											
14:00	14:35	第3セッション 証券分析	菅野正泰(神奈川大学経営学部)	Corporate Bond Portfolio Management using a Global Factor Approach	Term Structure Model, Credit Spreads, Dynamic Factor Model State-Space Model	小林武（名古屋商科大学）	湯前祥二	第3セッション 生命保険	藤澤陽介（RGAリインシュアラスカバニー）	一般化線形モデルを活用した長期第三分野保険の将来給付額の確率評価	長期第三分野保険、入院給付、一般化線形モデル（GLM）、危険準備金Ⅳ、プロセスリスク、パラメータリスク、ブートストラップ、ベイズ	加藤奈々（損害保険料率算出機構）、近藤宏樹（アメリカンホーム医療・損害保険株式会社）	大塚忠義、谷口豊、崔桓碩
14:35	15:10			日本株市場におけるボラティリティ効果について		篠原佑太（法政大学大学院経済学研究科）、湯前祥二（法政大学経済学部）	瀧野一洋			生命保険のプライシングの役割に関する考察ー価格付けか収益検証かー	生保、プライシング	大塚忠義（早稲田大学院商研究科）、谷口豊（ジブラルタ生命保険株式会社）、崔桓碩（八戸学院大ビジネス科）	井川孝之
15:10	15:45			An Equilibrium Model for the OTC Derivatives Market with A Collateral Agreement	OTC derivative market, counterparty risk (right-way risk, wrong-way risk), collateral, incomplete market, utility-based pricing, market equilibrium	瀧野一洋(名古屋商科大学)	小林武			死亡率の地域差の要因分析と将来推計	死亡・寿命リスク	井川孝之（PwCあらた監査法人）	加藤奈々
15:45	15:50	移動											
15:50	16:25	第4セッション システミックリスク・年金運用・ERM	乾孝治（明治大学総合数理学部）	保険ERMにおけるリスク相関分析 ― コピュラによる相関推定とリスク合算時の削減効果の検証―	保険リスク、ERM、リスク相関、コピュラ、ソルベンシーⅡ	野田正勝（日本コープ共済生活協同組合連合会）	菅野正泰	第4セッション ERM	小暮厚之（慶應義塾大学総合政策学部）	ERMの枠組みにおけるRAPM最適化に関する一考察	ERM、RAROC、RAPM、最適化、リスク尺度、期待効用、無差別曲線、期待効用曲面	稲葉大智（明治大学大学院先端数理科学研究科）、松山直樹（明治大学総合数理学部）	神谷信一
16:25	17:00			The Network Structure and Systemic Risk in the Global Non-life Insurance Market	systemic risk, interconnectedness, contagious default, network indicator, G-SIIs	菅野正泰（神奈川大学経営学部）	田中周二			Egalitarian Equivalent Capital Allocation	Insurance, capital allocation, public good	神谷信一（Nanyang Technological University, Singapore）	稲葉大智、松山直樹
17:00	17:35			公的年金運用の基本ポートフォリオの検証-リスクとファクター配分の観点から-	公的年金制度、財政検証、 GPIF、GMV、MDP、ERC、頑健推定LPM、CVaR	新川康青（日本大学大学院）、田中周二（日本大学大学院）	野田正勝						
17:35	17:45	総会準備											
17:45	18:20	総会											
18:30	20:30	懇親会		エル・チャテオ・デル・ブエンテ（スペイン料理店） 損保会館隣									