

平成 17 年 5 月吉日

各位

日本保険・年金リスク学会  
研修会担当理事 金村慶二・河野年洋

## JARIP 平成17年度第1回研修会のご案内

拝啓 時下益々ご清栄のこととお喜び申し上げます。

日本保険・年金リスク学会（JARIP）では、半日程度の研修会を実施しております。

第1回研修会を下記のとおり開催いたしますので、各位の積極的なご参加をお願い申し上げます。

敬具

記

### 1. 研修会の概要（詳細は別紙）

日時： 2005 年 6 月 10 日（金）午後 3 時から 6 時 30 分

場所： 朝日東海ビル 1 F ー会議室（千代田区大手町 2 丁目 6 番 1 号）

講師： 藤田 岳彦 氏（一橋大学大学院商学研究科教授）

テーマ：「数理ファイナンスの基礎（初級編）」

注）今回の研修会は、理系大学卒業程度の数学力を前提とした上で、ブラックショールズ式に至るまで程度の内容です。第2回研修会として、第1回研修会程度の知識を前提とした上で、「数理ファイナンスの中級編（仮題）・・・保険への応用(ワン変換等)を中心とした内容」を実施予定です。

### 2. 参加申込

参加者のお名前・組織名・E-mail アドレス・電話番号を明記の上、E-mail にて日本保険・年金リスク学会事務局 中村迄お申し込み下さい。 メールの件名を必ず「第1回研修会参加申込み」としてください。申込〆切は、2005 年 6 月 6 日（月）です。

#### 【申込み先】

E-mail: [office@jarip.org](mailto:office@jarip.org)

東京都千代田区丸の内2-5-2 三菱ビル9F 〒100-0005 京都大学経済研究所分室 内

Tel: 03-3201-5051 Fax: 03-3201-5058

### 3. 参加費

会員；4,000 円、 学生会員；1,000 円、 非会員；10,000 円

（法人会員は、3 名までは 1 人当り 4,000 円、それ以上は 1 人当り 10,000 円となります）

参加費は、研修会当日、会場受付にてお支払い下さい。

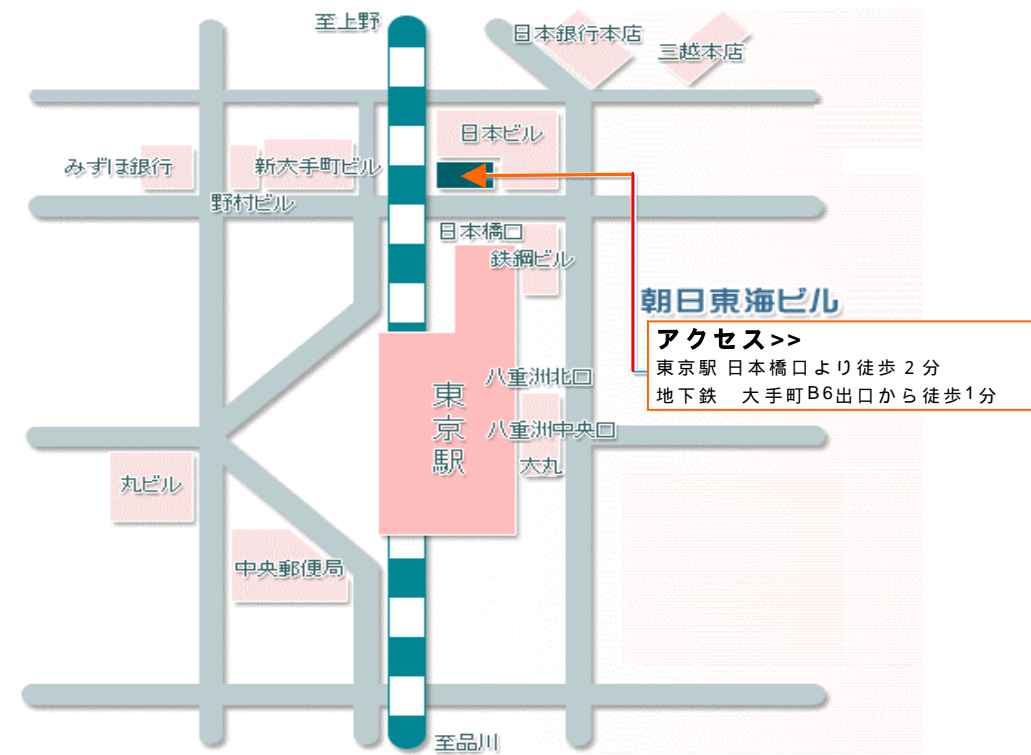
なお、領収書が必要な方は、必ず事前申込時に領収書の宛先をメールに記載して下さい。

以上

## JARIP 平成17年度第1回研修会

A. 日時 ; 2005年6月10日(金)午後3時から6時30分

B. 場所 ; 朝日東海ビル1F 一会議室 (〒100-8103 東京都千代田区大手町2丁目6番1号)



C. テーマ ; 「数理ファイナンスの基礎 (初級編)」

D. 講師・プロフィール

藤田 岳彦 氏 (一橋大学大学院商学研究科教授) 理学博士

- ・ 1978年 京都大学理学部卒業、1981年 京都大学理学部助手、1998年 一橋大学商学部教授
- ・ 主な研究テーマ : 確率解析、ファイナンス数理、力学系
- ・ 著作 : 「ファイナンスの確率解析入門 (講談社サイエンティク、2002年)」「ファイナンスの最適化入門 (講談社サイエンティク、2002年) 他多数
- ・ 論文 : "Pricing pathdependent options in some Black-Scholes market, from the distribution of homogeneous Brownian functionals" : (with Petit, F. and Yor, M.), Journal of Applied Probability, Vol 41 No.1, 2004 他多数

E. 講義の概要

「無裁定」に基づくデリバティブ価格理論を、離散モデルからブラックショールズモデルまで 必要な確率論、確率解析の基礎とともにわかりやすく解説する。

注) 第2回研修会として、第1回研修会程度の知識を前提とした上で、「数理ファイナンスの中級編 (仮題) …… 保険への応用 (ワン変換等) を中心とした内容」を実施予定です。

以上