

## アジア太平洋保険リスク学会の第10回大会 JARIP会員による論文発表と最優秀論文賞の受賞

アジア太平洋保険リスク学会の第10回大会が、7月30日から8月2日までの期間、明治大学（森宮康明治大学教授 Counselor Genera）が中心となり、明治大学リバティータワーで開催された。発表申し込み論文から凡そ200の研究発表が選ばれ、アジアを中心とする世界各国からの研究者、規制当局、実務家による発表がおこなわれた。生命保険、火災保険、自動車保険、年金といったこれまで長く研究されてきた分野に加え、大災害リスクの価格付け、ERM(全社的リスク管理)、保険経済学 (Insurance Economics) ,保険の国際化、リバース・モーゲージ、平均余命長期化リスクモデリングなどに関する新しい分野の多数の論文発表がおこなわれた。詳細は、<http://www.apria.org/2006Tokyo.htm> に示されている。

研究手法として、多くの実証的な研究が目立ったとともに、ファイナンス理論や金融工学、ミクロ経済などから、保険や年金、リスクに対するアプローチが進んでいることが目立った。

森宮 JARIP 評議員が今回の組織委員会の委員長をつとめられたほか、JARIP メンバーによる以下のような論文発表が行われた。

1. *Enterprise Risk Management for Japanese Life Insurers*, Shuji Tanaka (Institute of Actuaries, Japan), Shin-Ichi Yamamoto (Ritsumeikan U, Japan), and Yukio Muromachi (NLI Research Institute, Japan).
2. *Esscher Transforms by an Empirical Moment Generating Function*, Soichiro Moridaira (Keio U, Japan).
3. *Insurance as a Giffen Good under a Bonus-Malus System and its Effect on Adverse Selection*, Shinichi Kamiya (U of Wisconsin–Madison, US).
4. *A Smoothed Poisson Regression Model to Forecast Japanese Mortality Rates and its Application to the Valuation of the Life Annuity Risk*, Tomohiro Hasegawa (Keio U, Japan), and Atsuyuki Kogure (Keio U, Japan).
5. *Dynamic Financial Planning for a Household in a Multi-Period Optimization Approach*, Norio Hibiki (Keio U, Japan), and Katsuya Komoribayashi (Mizuho-DL Financial Technology, Japan).
6. *Some Actuarial Analysis of Japan's Reform of the Social Security Pension Schemes in 2004*, Junichi Sakamoto (Institute of Actuaries, Japan).

また、そのほか、多数の JARIP メンバーが、パネル討論会での報告者、座長などの職務を勤められた。

特筆すべきことは、上記発表論文のうち、枇々木則雄・小守林克哉氏による論文「家計の動的ファイナンス・プランニング：多期間アプローチ」が、最優秀論文賞(Harold Skipper Best Paper Award for Global Insurance)を受賞したことである。

なお、来年2007年7月下旬には、台湾の台北で、国立政治大学の経営大学院、保険、リスクマネジメント学部がホスト校となり、第11回大会が開かれる予定である。また、2008年度は、中国上海での開催が予定されている。

なお、2007年の秋には、日本アクチュアリー会がホスト国となり EAAC (East Asian Actuarial Conference) を東京に招致することになっている。

現在のところ、JARIP が国際大会を主催する予定はないが、会員諸氏が保険、年金、保険数理、リスク管理などの分野における国際大会で積極的な発表を行っていくことを期待したい。

(森平爽一郎、田中周二、小暮厚之)