

## 日本保険・年金リスク学会（JARIP）第6回大会プログラム

日時：2008年9月27日（土曜日）10:00-17:30（受付開始9:30）

場所：こまばエミナース（最寄り駅：京王井の頭線「駒場東大前」駅）

<http://www.komaba-eminence.com/access.html>

### プログラム

10:00-10:30	田中周二会長講演
10:30-12:00	特別講演 楠岡成雄（東京大学） 「リスク尺度の最近の発展」
12:00-13:30	昼食
13:30-15:00	研究報告Ⅰ（第1会場、第2会場）
15:00-15:10	休憩（10分間）
15:10-17:00	研究報告Ⅱ（第2会場は16:00まで）
17:00-17:30	総会（第1会場）
17:30-	懇親会（1階レストラン「エミナース」）

\* 午前の会場は1階「ダイヤモンド」、午後は第1会場が2階「富士の間」、第2会場が3階「鳳凰の間」となります。

午前中に受付をされる方は1階「ダイヤモンド」、午後の場合は2階「富士の間」です。

受付開始 9:30～（1階ダイヤモンドホール）

**会長講演および特別講演（ダイヤモンド）**

**10:00 – 12:00**

座長：木村 和弘（日本興亜生命）

「会長就任にあたって」

田中周二会長（日本大学）

「リスク尺度の最近の発展」

楠岡成雄（東京大学）

午後から参加の方の受付（2階富士の間）

**研究報告 I**

**13:30 – 15:00**

※研究発表時間:30分（質疑応答含む）

第1会場：2階「富士の間」、第2会場：3階「鳳凰の間」

■ 第1会場 **年金**

座長：杉田 健（中央三井アセット信託）

○確定拠出年金における継続投資教育の効果：実験による検証

北村 智紀（ニッセイ基礎研究所）、中嶋 邦夫（ニッセイ基礎研究所）

○確定拠出年金導入と家計の資産選択

中嶋 邦夫（ニッセイ基礎研究所）、北村 智紀（ニッセイ基礎研究所）

○年金制度における世代間リスク分担の価値と制約および事前・事後の給付調整

メカニズムのあり方

清水信広（農業者年金基金）

■ 第2会場 **保険**

座長：福田 敬（日本格付研究所）

○保険料率を予測市場によってプライシングする方法の検討（中間報告）

小倉宏之（東京工業大学大学院）

○Lasso 分位点回帰の理論と損害保険への応用

増田智巳（中央三井アセット信託銀行）・国友直人（東京大学大学院経済学研究科）

・加藤賢悟（東京大学大学院経済学研究科）

○主成分分析を用いた生命保険の負債評価モデル

田中周二（日本大学）、森田朋良（ドイツ証券）

**研究報告 II**

**15:10 – 17:00**

※研究発表時間:30分（質疑応答含む）

第1会場：2階「富士の間」、第2会場：3階「鳳凰の間」

■ 第1会場 **リスク管理**

座長：栗山 晃（朝日生命）

○住宅ローンの統合リスク管理

中井真人（金融エンジニアリング・グループ）

○経済環境の不確実性を有する負債に対応する多期間動的最適化

門田伸一（野村証券）

(5分のインターミッション後16:15から)  
○格付けアナリストから見たソルベンシー規制  
植村 信保 格付投資情報センター (R&I)

座長：金村 慶二(住友生命)

■ 第2会場 保険

座長：金村 慶二(住友生命)

(第2会場のみ 15:50 で終了)

○新設会社におけるEVについて – MCEVとUSGAAPの対比を参考にして –  
野上憲一 (ライフネット生命)

**総会** 17:00–17:30

2階「富士の間」

**懇親会** 17:30–19:30

1階レストラン「エミナース」

以上