

2010年10月吉日

各位

日本保険・年金リスク学会
研修会担当理事

伊藤・河野・栗山・清水・福田

JARIP 2010年度第2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）の2010年度第2回研修会を、下記のとおり開催しますので、各位の積極的なご参加をお願い申し上げます。

なお、会場の関係で募集定員を60名とさせていただきますので、お早目の申し込みをお願いします。

敬具

記

1. 研修会の概要（詳細は別紙）

テーマ：ソルベンシーⅡ QIS5のポイント解説

講師：松平 直之（キャピタスコンサルティング株式会社 マネージングディレクター）

日時：2010年11月1日（月）15：00～17：30

場所：朝日生命大手町オフィス1階大会議室

（地下鉄大手町駅またはJR 東京駅下車、徒歩5分）

（別紙 周辺地図をご参照下さい）

2. 参加申込（E-mailで申し込み願います）

- ・ **申込方法**：メール・タイトルは「11月1日 JARIP研修会申込」として下さい。
参加者氏名、個人会員・法人会員・学生会員・非会員の区別、組織名、E-mailアドレス、
電話番号、及び領収書が必要な場合はその旨を明記
（事前に領収書必要の連絡がなかった方には、領収書を発行しません）。
- ・ **申込先**：TO: office@jarip.org （JARIP事務局）
CC: kazuhira.itou@ms-ins.com （〃 研修会担当 伊藤 和平）
- ・ **申込〆切**：10月22日（金）
ただし、申込者数が会場定員60名に達した場合は、その時点で締め切ります。

3. 参加費

会員；1,000円、学生会員；無料、非会員；5,000円

（法人会員は、3名までは1人当たり1,000円、それ以上は1人当たり5,000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。

以上

A. 講義概要

保険会社に対する新たな健全性規制として欧州で導入される予定のソルベンシーⅡに関して、5回目の定量的影響度調査(QIS)であるQIS5が、本年8月から11月にかけて実施されている。

2008年のQIS4の実施後、2010年の1月までにCEIOPS(欧州保険・年金監督者会議)から具体的な実施基準に関する助言が行われ、その修正案を受けて、2010年4月にQIS5の技術的詳細に関するドラフトが公開され、さらに7月に最終版が公開された。

本講義では、QIS5の技術的詳細の最終版のポイントとして、資産評価、保険負債評価(現在推計とリスクマージン)、SCR(ソルベンシー資本要件)標準フォーミュラ(リスク種類別、およびリスク統合、損失吸収効果)、Own funds(自己資本)の解説を行う。また、ソルベンシーⅡによる健全性評価の基本的考え方や、QIS4からQIS5ドラフト、QIS5最終版にかけての主な変更点にも言及する。

B. 講師プロフィール

松平 直之(キャピタスコンサルティング株式会社 マネージングディレクター)

- ・ 東京海上火災保険を経て、ティリングハストータワーズペリンおよび投資銀行にて、生命保険会社のEV算出・ALM、損害保険会社の必要資本モデル構築・再保険戦略分析等に関するアドバイザリー業務を行い、2007年1月にキャピタスコンサルティング株式会社の設立に参加。現在同社にて、生命保険会社および損害保険会社に対して、経済価値ベースのリスク管理態勢導入、保険リスク・資産運用リスク計量モデル高度化、ALM、資産運用戦略構築等のサポートを行っている。
- ・ 日本アクチュアリー会にて、国際基準実務検討部会、ALM研究会他の委員を務める。
- ・ 日本アクチュアリー会正会員、日本証券アナリスト協会検定会員。
- ・ 著書・寄稿として、「金融機関の市場リスク・流動性リスク管理態勢」(金融財政事情研究会、2008年)、「保険会社によるERM導入について」(週刊金融財政事情、2009年8月31日号)等がある。

C. 研修会日時: 2010年11月1日(月) 15:00~17:30

D. 場所: 朝日生命大手町オフィス1階大会議室

(地下鉄大手町駅またはJR東京駅下車、徒歩5分)

(別紙 周辺地図をご参照下さい)

以上

朝日生命大手町ビル周辺地図

【朝日生命本社へのアクセス】

〒100-8103 千代田区大手町2-6-1
朝日生命大手町ビル

アクセス : JR東京駅八重洲北口改札を出て左に曲がり直進し、日本橋口より2分。または地下鉄大手町駅B6番出口より1分。

