

2010年11月吉日

JARIP会員各位

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

## JARIP2010年度第3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3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:「ファイナンスと保険の数理」について

講師:井上 昭彦氏(広島大学大学院理学研究科教授)

日時:2010年12月22日(水) 15:30~17:30

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「12月22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: tasogarenomahoroba@gmail.com (〃 研修会担当 福田敬)  
CC: kuriyama\_akira@mail.asahi-life.co.jp (〃 研修会担当 栗山晃)
- ・ 申込〆切:12月15日(水)  
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

## JARIP 第 3 回研修会

## A. 講演概要

本講演では、福田 敬氏および中野 張氏との共著の拙著「ファイナンスと保険の数理」(岩波書店より出版予定)を材料にしたお話をさせていただきます。著者のうち、井上と中野は大学に勤める研究者、(JARIP 理事でもある)福田は実務家です(全員数学科出身)。

この本は、岩波数学叢書という数学のシリーズの中の一冊です。このシリーズ全体の PR 文に「執筆にあたっては、概念の定義や構成の体系性に重きを置き、定理や補題の証明も丁寧に記述する」とあるのですが、この本の大きな部分は実際そのような記述の仕方では書かれていません。一方、導入編において実務家の視点で金融と保険の基本事項を解説し、また数学的にハードな証明は付録に回すなど、読者の理解のための工夫も行っています。

本全体の大まかな構成は次の通りです：

第 1 部 (導入偏)：金融と保険の基本事項、および離散時間モデルを材料にした数理ファイナンスのイントロダクション (資産価格評価の基本定理に基づく非完備市場の一般的枠組み等)

第 2 部 (基礎編)：確率解析、数理ファイナンスの基礎 (金利モデル等)、保険の基礎 (確率過程と保険等) などの解説

第 3 部 (続論)：ファイナンスと保険を統一的に理解するために一步進んだ内容を記述

本講演では、上記の本の内容と執筆に際して感じたり考えたりした様々なことについて、お話ししたいと思います。

## B. 講師プロフィール

井上 昭彦 (広島大学 大学院理学研究科数学専攻教授)

1982 年 東京大学理学部数学科卒業

1984 年 東京大学理学系大学院修士課程数学専攻終了

現在 広島大学大学院理学研究科数学専攻教授  
理学博士

研究テーマ：数理ファイナンス、保険数理、記憶を持つ確率過程、確率過程の予測、タウバー型定理、時系列解析、単位円周上の直交多項式

C. 研修会日時:2010 年 12 月 22 日(水) 15:30~17:30

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)

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。

