

日本保険・年金リスク学会 (JARIP) 第9回大会プログラム

日時：2011年11月5日（土曜日）9:30-17:50（受付開始 9:00）

場所：明治大学 駿河台校舎（東京都千代田区神田駿河台1-1）

リバティタワー6F（1063、1065号室）・7F（1076号室）

（受付：6F）

（最寄り駅：JR中央線・総武線、東京メトロ丸ノ内線／御茶ノ水駅 下車徒歩3分

東京メトロ千代田線／新御茶ノ水駅 下車徒歩5分

都営地下鉄三田線・新宿線、東京メトロ半蔵門線／神保町駅 下車徒歩5分）

http://www.meiji.ac.jp/koho/campus_guide/suruga/access.html

プログラム

- | | |
|-------------|--|
| 9:30-10:00 | 田中周二 会長講演 |
| 10:00-11:45 | 特別講演「保険をめぐる二つの世界
—大学で保険を教育することの意味—」
米山 高生（一橋大学 大学院商学研究科教授） |
| 11:45-13:00 | 昼食 |
| 13:00-14:45 | 研究報告Ⅰ（第1会場、第2会場、第3会場） |
| 14:45-15:00 | 休憩（15分間） |
| 15:00-17:20 | 研究報告Ⅱ（第1会場、第2会場、第3会場） |
| 17:20-17:50 | 総会（第1会場） |
| 18:00-20:00 | 懇親会（明治大学 駿河台校舎アカデミーコモン
「カフェパンセ」） |

受付開始 9:00～(6F)

会長講演および特別講演

9:30 – 11:45

座長：菅野 正泰 (神奈川大学経営学部)

「会長講演」

田中 周二 会長 (日本大学 大学院総合基礎科学研究科 教授)

特別講演「保険をめぐる二つの世界—大学で保険を教育することの意味—」

米山 高生 (一橋大学 大学院商学研究科 教授)

研究報告 I

13:00 – 14:45

※研究発表時間:35分 (質疑応答含む)

■ **第1会場 保険・リスク管理** (6F) 1063号室 座長：伊藤 和平 (三井住友海上火災保険)

○借入制約の下での生命保険と終身年金の最適加入解約戦略

鈴木 輝好 (北海道大学 大学院経済学研究科)

○A Continuous-Time Optimal Insurance Design with Costly Monitoring under Moral Hazard and Adverse Selection

中村 恒 (一橋大学 大学院商学研究科)

○Division of Roles between Compulsory and Voluntary Insurance: The Case of Japanese Automobile Liability Insurance Scheme

(強制保険と任意保険の機能分担に関する経済分析—わが国の自動車保険制度を中心に—)

米山 高生 (一橋大学 大学院商学研究科)、諏澤吉彦 (京都産業大学 経営学部)

■ **第2会場 年金** (6F) 1065号室 座長：杉田 健 (中央三井アセット信託銀行)

○個人年金の資産効果

浦谷 規 (法政大学 理工学部経営システム工学科)

○サープラス最適なポートフォリオ構成

田中 英治 ((財)年金シニアプラン総合研究機構)

○VaR責任準備金とその応用

岩沢 宏和 (個人)

■ **第3会場 実証・シミュレーション**(7F) 1076号室 座長：山内 恒人 (ネクスティア生命保険)

○生命保険会社の健全なる経営を目指して—健全性低下要因のパネルデータ分析—

山本 信一 (立命館大学 経済学部)、中路 翔 (立命館大学 経営学部)

○損害保険会社の保険引受ベータと資本コスト：2000年代金融危機における実証分析

森平 爽一郎 (早稲田大学 大学院ファイナンス研究科)、

野尻 大輔 (東京海上日動火災保険株式会社)

○多項分布の近似による保険収支シミュレーション

相原 浩司 (有限責任監査法人 トーマツ)

※研究発表時間:35分(質疑応答含む) (但し、第2、第3会場は16:45まで。)

■ 第1会場 保険・リスク管理 (6F) 1063号室 座長:河原崎 純一 (三井住友海上あいおい生命保険)

- コンピュータ関数を活用したグループ・ソルベンシー最適化モデル
菅野 正泰 (神奈川県立大学 経営学部)
- Market-Consistent Valuation of Insurance Liabilities with special emphasis on illiquidity risk premium and Insurance ALM in Japanese context
田中 周二 (日本大学 大学院総合基礎科学研究科)、
乾 孝治 (明治大学 専門職大学院グローバル・ビジネス研究科)
- Pricing reverse mortgages using Bayesian risk-neutral predictive distributions
小暮 厚之 (慶応大学 総合政策学部)、高松 良光 (一橋大学 大学院商学研究科)
- ストレステストの構築と活用に関する考察
森本 祐司 (キャピタスコンサルティング株式会社)

■ 第2会場 年金 (6F) 1065号室 座長:臼杵 政治 (名古屋市立大学経済学部)

- 企業年金における給付約束の「柔らかさ」と世代間の公平
清水 信広 (農業者年金基金)
- Corporate Pension Funding Without Mandatory Contribution: Its Implications for Firm Fundamentals and Stock Returns
柳瀬 典由 (東京経済大学経営学部)、後藤 晋吾 (University of South Carolina)
- A new comparison of the Standard Mortality Table 2007 with time-simultaneous prediction bands for the Cairns-Blake-Dowd model
藤澤 陽介 (ライフネット生命保険株式会社)、
Johnny Siu-Hang Li (University of Waterloo, Canada)

■ 第3会場 実証・シミュレーション (7F) 1076号室 座長:松山 直樹 (明治大学理工学部)

- 現実確率下のLIBORマーケットモデルとリアルワールドシミュレーションの効果
安岡 孝司 (芝浦工業大学 大学院工学マネジメント研究科)
- Bayes 推定によるパラメータリスク・モデルリスクの評価に向けた一考察
近藤 宏樹 (日新火災海上保険株式会社)、
斎藤 新悟 (九州大学 マス・フォア・インダストリ研究所)
- 少額短期保険業・認可特定保険業の現状と保険数理的課題
小倉 宏之 (日本経営数理コンサルティング株式会社)

総会

17:20–17:50

(6F) 1063号室

懇親会

18:00–20:00

明治大学 駿河台校舎アカデミーコモン「カフェパンセ」