

# 日本保険・年金リスク学会（JARIP）第11回大会プログラム

日時：2013年11月16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 リバティタワー （東京都千代田区神田駿河台 1-1）

受付：1F 1012号室前

第1会場：1F 1012号室

第2会場：8F 1084号室

第3会場：8F 1085号室

（最寄駅 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）

アクセスは以下を参照下さい。

[http://www.meiji.ac.jp/koho/campus\\_guide/suruga/access.html](http://www.meiji.ac.jp/koho/campus_guide/suruga/access.html)

## プログラム

9:30-10:00 楠岡 成雄 会長講演

10:10-11:30 研究報告Ⅰ（第1会場、第2会場、第3会場）

11:30-13:00 昼食

13:10-14:20 特別講演「今後の国際規制の日本の保険会社への影響」（仮題）

三輪 純平（金融庁総務企画局 総務課国際室 国際保険調整官）

竹内 秀輝（金融庁総務企画局 総務課国際室 課長補佐）

14:25-17:15 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（会場 「ナポリの下町食堂 お茶の水店」）

受付開始 9:00～ (1F 1012 号室前)

**会長講演** **9:30 - 10:00** 第1会場: 1F 1012 号室

座長: 菅野 正泰 (神奈川県立大学 経営学部)

「会長講演」 楠岡 成雄 (東京大学大学院 数理科学研究科)

**研究報告 I** **10:10-11:30** ※研究発表時間:40分 (質疑応答 8分含む)

■第1会場: 1F 1012 号室 **リスク管理・ファイナンス系**

座長: 乾 孝治 (明治大学 総合数理学部)

○Markov switching を取り入れたCIR型倒産強度過程

稲生 剛士(横浜国立大学大学院 国際社会科学研究科)

○カウンターパーティリスクがOTC デリバティブ市場に与える影響

瀧野 一洋 (名古屋商科大学 商学部)

■第2会場: 8F 1084 号室 **年金**

座長: 臼杵 政治 (名古屋市立大学 経済学部)

○金利連動型キャッシュバランス型年金制度の市場整合的評価について

杉田 健 (三井住友信託銀行)

○公的年金財政シミュレーションツールについて

稲垣 誠一 ((株) シーエーシー)、小澤 正典 (慶応義塾大学 理工学部)、寺西 教高 ((株) シーエーシー)、日隈 美奈子 (同)、石田 朗大 (同)

■第3会場: 8F 1085 号室 **保険・実証系**

座長: 山本 信一 (立命館大学 経済学部)

○消費者から見た銀行窓販一サーベイ調査による窓販ユーザーの特性分析一

近藤 隆則 (一橋大学大学院 商学研究科)、白須 洋子 (青山学院大学 経済学部)、三隅 隆司 (一橋大学大学院 商学研究科)

○健康保険組合レセプトデータを使った医療費の分析

村松 容子 (ニッセイ基礎研究所 保険研究部)

**特別講演** **13:10 - 14:20** 第1会場: 1F 1012 号室

「今後の国際規制の日本の保険会社への影響」(仮題)

三輪 純平 (金融庁総務企画局 総務課国際室 国際保険調整官)

竹内 秀輝 (金融庁総務企画局 総務課国際室 課長補佐)

**研究報告 II** **14:25 - 17:15** ※研究発表時間:40分 (質疑応答 8分含む)

(2つ目と3つ目の発表の間に10分の休憩あり。第1・2会場は16:35終了。)

■第1会場：1F 1012号室      **リスク管理・ファイナンス系**

座長：菅野 正泰（神奈川大学 経営学部）

○変額年金保険の再保険に係る信用リスクの評価と市場リスクとのリスク統合

市川 太佳之（東京海上日動フィナンシャル生命保険）

○国内金融機関のシステミック・リスク計測の試み

永田 真一（明治大学大学院 先端数理科学研究科）、乾 孝治（明治大学 総合数理学部）

○資本配賦原理と信頼水準の整合性に関する一考察

坂本 瑛樹（明治大学大学院 理工学研究科）、松山 直樹（明治大学 総合数理学部）

■第2会場：8F 1084号室      **実証系**

座長：神楽岡 優昌（武蔵大学 経済学部）

○男性高齢社員の雇用形態及び退職行動の分析—中高年縦断調査を利用した固定効果ロジット分析—

北村 智紀（ニッセイ基礎研 金融研究部門）、中嶋 邦夫（同）、上村 敏之（関西学院大学 経済学部）

○スーパー商品価格の曜日別マーケティング戦略—統計学を用いた実証分析—

山本 信一（立命館大学 経済学部）、井上 麻央（同）、谷口 晴香（同）

○極値理論とその応用；沖縄における巨大台風リスクの統計解析

野原 佑太（大同火災海上保険）

■第3会場：8F 1085号室      **保険**

座長：小暮 厚之（慶應義塾大学 総合政策学部）

○保険解約モデルの再検討

猪狩 誠（明治大学大学院 理工学研究科）、松山 直樹（明治大学 総合数理学部）

○確率のコヒーレントアグリゲーションの保険数理への応用

西屋 知英（明治大学大学院 理工学研究科）、松山 直樹（明治大学 総合数理学部）

○パレート分布に従うリスクに関する純保険料計算について

小倉 宏之（日本経営数理コンサルティング株式会社）

○業界データにもとづく損害保険リスクモデル

栗山 晃（損害保険料率算出機構）、田中 周二（日本大学大学院 総合基礎科学研究科）

**総会**

**17：20—17：50**

1F 1012号室

**懇親会**

**18：00—20：00**

於：「ナポリの下町食堂 お茶の水店」

以 上