

## 日本保険・年金リスク学会（JARIP）第12回大会プログラム

日時：2014年11月1日（土曜日）10:00-17:40（受付開始9:30）

場所：東京大学 駒場キャンパス 数理科学研究科棟

第1会場：1F 大講義室

第2会場：1F 中講義室 117号室

〒153-8914 東京都目黒区駒場 3-8-1

（最寄り駅：京王井の頭線 駒場東大前駅）

<http://www.ms.u-tokyo.ac.jp/access/index.html>

受付：1F 大講義室前

### プログラム

9:30～	受付開始（大講義室前）
10:00-10:40	楠岡成雄会長 会長講演
10:40-12:00	研究報告Ⅰ（第1会場、第2会場）
12:00-13:20	昼食
13:20-15:20	研究報告Ⅱ（第1会場、第2会場）
15:20-15:40	休憩（20分間）
15:40-17:00	研究報告Ⅲ（第1会場、第2会場）
17:10-17:40	総会（第1会場）
18:00-20:00	懇親会（東京大学 駒場キャンパス 生協食堂 3F）

\*\*\*\*\*

### ■会長講演 10:00-10:40

座長：菅野 正泰（神奈川大学 経営学部）

楠岡 成雄会長（東京大学 大学院数理科学研究科教授）

**■研究報告 I** 10:40-12:00 ※研究発表時間:40分 (討論・質疑応答 15分含む)

●**リスク管理** 第1会場:1F大講義室

座長:乾 孝治 (明治大学 総合数理学部)

○Dynamic Risk Modelingによる生命保険会社のリスク管理

倉田雄介 (日本生命保険相互会社国際投資部)、森平爽一郎 (早稲田大学大学院ファイナンス研究科)

討論者:吉田 靖 (東京経済大学経営学部)

○東日本大震災における銀行株の伝染効果

吉田靖 (東京経済大学経営学部)

討論者:森平 爽一郎 (早稲田大学大学院ファイナンス研究科)

●**プライシング・リスク管理** 第2会場:1F中講義室117号室

座長:神楽岡 優昌 (武蔵大学 経済学部)

○確率ボラティリティ下における最低年金額保証オプションの分散漸近展開を用いた評価法について

木崎恵介 (東北大学経済学研究科博士課程前期課程)

討論者:市川 太佳之 (東京海上ホールディングス)

○SABR-LIBORマーケット・モデルを用いた保険負債の経済価値評価

市川太佳之 (東京海上ホールディングス)

討論者:中村 恒 (一橋大学大学院商学研究科)

**■研究報告 II** 13:20-15:20 ※研究発表時間:40分 (討論・質疑応答 15分含む)

●**プライシング・リスク管理** 第1会場:1F大講義室

座長:岩沢 宏和 (個人)

○Phase-type approximation of the Gerber-Shiu function

山崎和俊 (関西大学・システム理工学部)

討論者:五十嵐 徹 (一橋大学商学研究科修士課程)

○Lundbergモデルにおける存続確率

五十嵐徹 (一橋大学商学研究科修士課程)、西岡國雄 (中央大学商学部)

討論者:室町 幸雄 (首都大学東京)

○超長期の金利と期限前償還率の変動特性を考慮したRMBSの価格付け

室町幸雄 (首都大学東京)、黄文峰 (株式会社AFG)、岸田則生 (株式会社AFG)

討論者:山崎 和俊 (関西大学・システム理工学部)

●**年金・保険** 第2会場:1F中講義室117号室

座長:臼杵 政治 (名古屋市立大学 経済学部)

○公的年金再設計の提案 <介護年金制度の導入>

田中 周二 (日本大学総合基礎科学研究科)

討論者:小澤 正典 (慶應義塾大学理工学部)

○年金財政検証における経済シナリオの検討

小澤 正典（慶應義塾大学理工学部）、浦谷 規（法政大学理工学部）

討論者：井川 孝之（あらた監査法人）

○Moral-hazard premium

Hisashi Nakamura, Takashi Misumi, and Koichiro Takaoka (Graduate School of Commerce and Management, Hitotsubashi University)

討論者：内山 朋規（野村證券株式会社金融工学センター）

**■研究報告Ⅲ 15：40－17：00** ※研究発表時間：40分（討論・質疑応答 15分含む）

●年金ほか 第1会場：1F 大講義室

座長：藤澤 陽介（RGA リインシュアランスカンパニー）

○貸金上昇率をヘッジするポートフォリオとは—構造 VAR を用いた分析

臼杵政治（名古屋市立大学経済学研究科）、三澤哲也（名古屋市立大学経済学研究科）

討論者：山本 信一（立命館大学経済学部）

○金融緩和政策の有効性—高橋是清とバーナンキからみる金融政策—

杉田貴宏（立命館大学経済学部）、木下亮（立命館大学経済学部）、尾崎暢（立命館大学経済学部）、山本信一（立命館大学経済学部）

討論者：臼杵 政治（名古屋市立大学経済学研究科）

●プライシング・リスク管理 第2会場：1F 中講義室 117号室

座長：吉田 靖（東京経済大学）

○Social Risk-Benefit Analysis on iPS/Stem Cells Application for Medical Treatment

鶴田正博（順天堂大学大学院医学研究科）

討論者：小倉 宏之（日本経営数理コンサルティング株式会社）

○複数の事故の組み合わせからなる保険の価格付け

小倉宏之（日本経営数理コンサルティング株式会社）

討論者：鶴田 正博（順天堂大学大学院医学研究科）

**■総会 17：10－17：40**

1F 大講義室

**■懇親会 18：00－20：00**

於：東京大学駒場キャンパス「駒場レストラン」  
駒場コミュニケーション・プラザ 南館 3F

以 上