

2015年6月吉日

各位

日本保険・年金リスク学会
研究会担当理事
伊藤・金村・河野・原田

JARIP 研究会のご案内

拝啓 時下益々ご清栄のこととお慶び申し上げます。

日本保険・年金リスク学会（JARIP）の研究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50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いたします。

敬具

記

1. 研究会の概要

日時：2015年6月24日（水曜日） 午後2時から5時

場所：TKP 東京駅八重洲カンファレンスセンター

カンファレンスルーム 4R

〔住所〕東京都中央区京橋1-7-1 戸田ビルディング

講師：安道知寛 博士（数理学）

慶應義塾大学ビジネススクール 准教授

（講師略歴をご参照ください）

講演題目：

「高次元データのモデリング理論と金融市場の実証分析」

講演概要：

情報処理技術の発展により、個人投資家もノートパソコンである程度大規模な金融市場データを分析できる時代へ突入した。

日々蓄積されている様々な情報は、金融市場の特徴を把握するための重要な材料で、その材料を、「どのように実務（資産運用、トレーディング、企業価値評価、リスク管理など）に生かすのか？」という問いは、現場実務のみならず、学術的にも継続的に検討すべき課題である。

その問いを検討するに際しては、まず、対象となる金融市場の特徴を的確に把握する必要がある。その目的のために「計量的手法」を活用する場合、根本的な問題は、金融市場に対する仮定が現実の金融市場と比較してどの程度整合的であるかという点にある。

本講演では、大規模な金融市場データに内在する構造を（市場に対する仮定が弱いという意味で）柔軟に把握するための手法とその応用例について紹介していきたい。

まず、金融市場の分析に「計量的手法」を利用する場面において、本質的な問題は何であるのかについて議論を交わしたい。特に、何が今後の課題となるのかについても検討していきたい。その後に、金融市場でよく観察される大規模パネルデータの分析について触れたい。数理的側面についてはその本質的な部分だけに限定しつつ、最近の研究の進展状況、それによってどのようなことが把握できるようになったのか、中国株式、世界株式市場などの分析例を交えながら解説していきたい。

2. 参加申し込み

期日：2015年6月22日（月）

（JARIP会員以外も参加可能です。）

学会サイトの【専用申込フォーム】よりお願い申し上げます。

ただし、申込者数が会場定員50名に達した場合は、その時点で締め切ります。

<http://www.jarip.org/>

3. 参加費

無料。なお、資料代等の実費をカバーするためにお願いしていたカンパも今回から不要です。

4. 講師略歴

2000年3月 九州大学理学部数学科卒業

2002年3月 九州大学大学院数理学府修士課程修了

2004年3月 九州大学大学院数理学府博士課程修了

2004年4月 東京大学医科学研究所 リサーチアソシエイト

2005年4月 慶應義塾大学ビジネススクール 専任講師

2007年4月 慶應義塾大学ビジネススクール 准教授

現在に至る

以 上

[会場地図]



アクセス；

- JR 山手線 東京駅 八重洲中央口 徒歩 5分
- 東京メトロ銀座線 京橋駅 7番出口 徒歩 2分
- 東京メトロ東西線 日本橋(東京都)駅 徒歩 5分
- 都営浅草線 日本橋(東京都)駅 徒歩 5分