

JARIP2017 研究発表大会 2017/12/2(土) 日本大学商学部砦キャンパス
 タイムスケジュール (ver.3 11/27更新)

時間帯	第1会場: 1202教室					第2会場: 2201教室					第3会場: 2202教室					
	セッション名	発表タイトル	キーワード	発表者	討論者	セッション名	発表タイトル	キーワード	発表者	討論者	セッション名	発表タイトル	キーワード	発表者	討論者	
9:20-	受付	1202教室前の受付で大会参加登録・受付をし、参加証の交付を受けてから教室にお入りください。参加証によるチェックを教室前で行います。														
9:40-10:20	第1セッション 生命保険	健康寿命と平均要介護期間に関する考察	平均寿命、健康寿命、不健康な期間、平均要介護期間	大塚 忠義・谷口 豊	米山高生・山本信一・田中貴・高松良光	第1セッション ファイナンス・年金	監督者から見たDCのリスク・マネジメント-IOPSの報告書を踏まえて	DC、リスク・マネジメント、IOPS、投資リスク、自動加入	杉田 健	湯山智教・森平爽一郎						
10:20-11:00		「健康年齢」と医療費の関係に関する計量分析-健康増進型保険に関する基礎研究	簡易健康年齢、健康増進型保険、シグナリングコスト、保険市場の効率化、医療費削減	米山高生・山本信一・田中貴・高松良光	小倉 宏之		市場データ等を活用したデフレ確率の推計とその課題	デフレ確率、物価目標、順序ロジットモデル、デジタル・オプション期待インフレ率	湯山智教・森平爽一郎	毛冠群・湯前祥二						
11:00-11:40		座長: 金村慶二 (住友生命)	有病率と疾病発生率の関係に関する基礎的な問題とその解法	保険料、状態遷移モデル、多重脱退モデル	小倉 宏之		大塚 忠義・谷口 豊	日本株式市場におけるボラティリティ効果の検証	ボラティリティ、10分位、クロスセクションリスク、株価モデル、ポートフォリオ	毛冠群・湯前祥二	杉田 健					
11:40-13:00	昼休み	理事・評議員会:2601教室 理事・評議員の方は、大会参加登録・受付を済ましてから参加願います。														
13:00-13:40	会長講演 米山高生会長			座長:菅野正泰(大会担当理事・日本大学)												
13:40-13:50	JARIP学会賞表彰式 米山高生会長															
14:00-15:00	基調講演: 田中周二 元JARIP会長 「保険リスクマネジメント—モデリングの課題—」															
15:10-15:50	第2セッション リスク管理	Marginal Cost of Risk-Based Capital and Risk-Taking	Risk-based capital, capital regulation, investment, risk taking	Shinichi Kamiya・Tao Chen・Pingyi Lou	小野崎純人・今井潤一	第2セッション 保険・医療リスク	Credibility Theoryを用いた小地域の将来死亡率予測	死亡率推定, Lee-Carter モデル, Bülmann-Straub モデル, 信頼性理論, 小地域	小林周史・清水泰隆	田中周二・長谷川敏彦	第2セッション ファイナンス	長期負債と異時点間代替弾力性を考慮したポートフォリオの多期間最適化	ALM・アセットアロケーション・多期間最適化・カルマンフィルタ・異時点間代替弾力性	小林 弘樹・森平爽一郎	小林武・牧本直樹	
15:50-16:30		プロスペクト確率優越に整合的なリスク尺度 Reference-dependent Expected Shortfallの提案	記述的リスク尺度、期待ショートフォール、プロスペクト確率優越、Range Value-at-Risk、マニタリ性	小野崎純人・今井潤一	本田亜望・清水泰隆		介護状態生命表の作成—高齢期のライフコース分析のために—	介護保険、要介護度、認知度、寝たきり度、マルコフ過程モデル、推移確率行列、多状態生命表	田中周二・長谷川敏彦	野村 俊一・高橋 宏典		Bond Portfolio Optimization using Regime Switching Dynamic Nelson Siegel Models	Term structure model; Regime shifts; Portfolio optimization	小林武・牧本直樹	小林 弘樹・森平爽一郎	
16:30-17:10		座長: 菅野正泰 (日本大学)	Parisian ruinにおける破産確率のノンパラメトリック推定	破産確率, Parisian ruin, Oram er-Lundberg モデル, Laguerre polynomials	本田亜望・清水泰隆		Shinichi Kamiya・Tao Chen・Pingyi Lou	一般化Fused Lassoによるクラス料率算定	タリフ分析、一般化線形モデル、一般化fused lasso、交互方向乗数法、自動車損害賠償責任保険	野村 俊一・高橋 宏典		小林周史・清水泰隆	座長: 小暮厚之 (慶応義塾大学)			
17:20-17:45	総会															
18:00-20:00	懇親会	Cafe Apartment 183(日本大学商学部南門を出て左に世田谷通り沿い100mほど行く)														

受付けにて配布する参加証はお帰りの際、受付けにご返却ください。
 懇親会参加者は懇親会後にご返却ください。