

2018年12月吉日

各位

日本保険・年金リスク学会
研究会担当理事 大塚・杉田・滝澤・田中・吉田・野村

JARIP 特別研究会のご案内

拝啓 時下益々ご清栄のこととお慶び申し上げます。

コペンハーゲン大学の Mogens Steffensen 教授が来日された機会をとらえまして日本保険・年金リスク学会 (JARIP) の特別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。

敬具

記

1. 研究会の概要

日時 2019年1月10日(木曜日) 開始:17:00、 終了:18:30

場所 法政大学市ヶ谷キャンパス ボアソナードタワー19階会議室(東京都千代田区富士見2-17-1,地図は次頁)

講師 Professor Mogens Steffensen (Department of Mathematical Science, University of Copenhagen)

講演題目 Consumption-Investment-Insurance Problems (講演は英語で行われます)

講演概要 We consider generalizations of

classical continuous-time consumption-investment problem with fixed time horizon.

The generalizations include uncertain lifetime with access to life insurance and events like disability or unemployment with access to insurance, correspondingly. We discuss

how frictions in the market can solve the so-called life insurance and life annuity

puzzles. We also discuss the separation of risk aversion (aversion towards consumption uncertainty) and elasticity of inter-temporal substitution (aversion towards

consumption variability over time) with and without presence of insurable life events.

This relates to so-called recursive utility. Aversion towards consumption variability in different states of the lifecycle model can explain the observed hump-shaped pattern

of consumption, even among patient consumers paying a fair price for insurance. All

works and results can be seen as input to better product advice and better product

design of life insurance and pension savings products.

2. 参加費 無料

3. 申し込み

期日:2018年12月20日(木) 下記【専用申込フォーム】より申し込みください。

【専用申込フォーム】 : <https://fs222.formasp.jp/c442/form6/>

4. 講師略歴および実務経験

2001, Ph.D. in Actuarial Mathematics, University of Copenhagen

2012 以降. Professor in life insurance mathematics, Uni. Of Cph.

2008-2012. Professor (with special duties) in life insurance mathematics, Uni. Of Cph.

2004-2008. Associate Professor, Laboratory of Act. Math., Uni. of Cph.

2013 以降 Editor-in chief : Risks, Associate editor : Insurance: Mathematics and Economics

2018-. Member of the board of directors at PFA Pension.

以上

【会場地図】 〒102-8160 東京都千代田区富士見 2-17-1

