

2023年11月吉日

各位

日本保険・年金リスク学会
研究普及委員会 原田・野村

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。

敬具

記

1. 研究会の概要

講演題目：「Cross Risk Apportionment and Non-financial Correlated Background Uncertainty」

日時：2023年12月22日（金曜日） 開始：15:05、 終了：16:45

場所：早稲田大学 早稲田キャンパス 11号館9階913教室(エレベーター9階を降り正面突当り)

早稲田大学へのアクセスはこちらをご参考にしてください

<https://www.waseda.jp/top/access/waseda-campus>

早稲田大学のキャンパスマップはこちらです

<https://waseda.app.box.com/s/ctvnsi6nckz4yk9kkrch64av0od0ai9t>

講師：尾崎 祐介 氏（早稲田大学商学学術院 教授）

（講師略歴は次項）

講演概要：

この論文では、バックグラウンドリスクが存在する状況での安全資産とリスク資産のポートフォリオ問題を考えます。バックグラウンドリスクは非金融変数として、分かりやすさのために健康状態と特定化します。金融リスクと健康リスクに相関がある状況を考えたうえで、この論文ではその相関がポートフォリオ選択にどのような影響を与えるのかを明らかにします。相関回避的な投資家を考えた場合、相関の増加は期待効用を増加させると予想できます。そして、その予想が正しいことが示されます。また、相関回避的な投資家は、リスク資産に対する投資を減少すると予想できます。安全資産を増やすことで、相関を減少する効果があるからです。しかし、この予想は必ずしも正しくないことが理論的に示されて、その予想が成立する条件を明らかにします。この論文では、効用関数に対する三つの条件が特定化され、それらの全てがくじの選好に対して特定のパターンを持つことが分かりました。また、相関に対するあいまい性を導入して、その効果も考えました。

2. 参加費

無料

3. 参加申し込み

期日:2023年12月11日(月)

学会サイトの【専用申込フォーム】より申し込みください。 <http://www.jarip.org/>

4. 講師略歴

尾崎祐介氏（早稲田大学商学大学院 教授）

2006年大阪大学大学院経済学研究科博士後期課程修了（博士（経済学））。2008年京都大学大学院経済学研究科寄付講座准教授，2009年大阪産業大学経済学部准教授，2018年早稲田大学商学大学院准教授を経て，2023年より現職。関西大学ソシオネットワーク戦略研究機構研究員。