

JARIP 2024 第22回研究発表大会 2024/11/2(土)慶應義塾大学矢上キャンパス

タイムスケジュール(更新 2024/10/23) 研究発表セッションの*は報告者を示す。 本大会の開催にあたり、慶應義塾大学OLIS生命保険寄附講座様に協賛いただきました。

第1会場 : 12-210教室(12棟2階)			第2会場 : 12-211教室(12棟2階)		
第1セッション: 予測手法I 座長: 柳瀬典由(慶應義塾大学)【言語は英語及び日本語】			第2セッション: 予測手法II 座長: 井川孝之(明治大学)		
発表タイトル	発表者	討論者	発表タイトル	発表者	討論者
9:50 - 10:30	Estimating the Effective Reproduction Number of COVID-19: Addressing Reporting Delays with Actuarial Methods Lin Xuanan(慶應義塾大学大学院)	討論: 鈴木理史	クレーム件数とクレーム単価の依存性を考慮したクレーム総額の予測モデル *宮地桜(早稲田大学大学院会計研究科) 野村俊一(早稲田大学大学院会計研究科) 岩沢宏和(早稲田大学大学院会計研究科)		討論: 岩沢宏和
10:35 - 11:15	A New Framework to Quantify Insurance Liabilities Prediction Error Applicable to Machine Learning Models (発表言語: 日本語) 高橋智嗣(アクサ生命) *鈴木理史(ミュンヘン再保険) 岩沢宏和(早稲田大学大学院会計研究科)	討論: Lin Xuanan	ブラックボックスモデルの解釈を最大化する関数分解手法 岩沢宏和(早稲田大学大学院会計研究科) *松森至宏(SOMPOリスクマネジメント)		討論: 宮地桜
11:15 - 12:30	休 憩				
第3セッション: 金融工学 座長: 白須洋子(青山学院大学)			第4セッション: 経済シナリオ・実証分析 座長: 山内恒人(慶應義塾大学)		
12:30 - 13:10	A note on ambiguity-adjusted asset pricing *岩城秀樹(東京理科大学) Daisuke Yoshikawa(関西大学)	討論: 浦谷規	Black-Scholes-Hull-White モデルにおける経済シナリオの生成と分散減少法 宅味丈夫(SOMPO ホールディングス株式会社)		討論: 湯前祥二
13:15 - 13:55	局面転換を考慮した金利・信用リスク評価モデルによる資産負債クラス間の損益の同時分布 室町幸雄(東京都立大学)	討論: 岩城秀樹	ベンフォードの法則による日本企業の売上高分析 湯前祥二(法政大学)		討論: 宅味丈夫
14:00 - 14:40	大地震に対する再保険とCAT Bond 浦谷規(法政大学)	討論: 室町幸雄			
15:00 - 15:40	会長よりご挨拶・講演「積立投資の理論: 平均・分散アプローチ」 枇々木規雄 JARIP会長 会場: マルチメディアルーム(14棟地下2階)				
15:45 - 17:45	パネルディスカッション「機械学習技術のアクチュアリー実務への活用に関する展望」 - 岩沢宏和氏 早稲田大学大学院会計研究科 客員教授 - 佐藤欣也氏 金融庁監督局保険課 保険商品室長 - 海野良太氏 金融庁監督局保険課 保険モニタリング室係長 - 藤田卓氏 日本アクチュアリー会データサイエンス関連基礎調査WG 座長 - 佐野誠一郎氏 共栄火災海上保険株式会社 商品開発部 - モデレーター 大塚忠義氏 早稲田大学大学院会計研究科 教授 会場: マルチメディアルーム(14棟地下2階)				
17:45 - 17:50	日本アクチュアリー会「ICA2026組織委員会広報部会からのお知らせ」 会場: マルチメディアルーム(14棟地下2階)				
17:50 - 18:20	総会 会場: マルチメディアルーム(14棟地下2階)				
18:30 - 20:00	懇親会 会場: フォーラム(14棟7階)				

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。