

JARIP2016 研究発表大会 2016/11/19(土) 明治大学中野キャンパス

タイムスケジュール (ver.5 11/2更新)

時間帯	第1会場: 413教室					第2会場: 402教室					第3会場: 403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	
9:10-9:30	受付															
9:30-10:10	第1セッション 年金	公的年金システムにおけるスライド調整の終了条件の考察	公的年金システム, スライド調整, 運用利率, 確率過程	小澤正典(慶應義塾大学理工学部)・浦谷規(法政大学)	杉田健(年金シニアプラン総合研究機構)											
10:10-10:50		年金数理計算におけるモンテカルロシミュレーションの活用	年金数理, モンテカルロシミュレーション, GPIF	杉田健(年金シニアプラン総合研究機構)	田中周二(日本大学大学院総合基礎科学研究科)	第1セッション 生命保険・金融政策	複数事故の組み合わせからなる保険の価格付け(入院給付への応用)	保険料, 条件付き確率, オプションプライシング	小倉宏之(日本経営数理コンサルティング)	山本信一(立命館大学経済学部)	第1セッション 医療保険	高額療養費制度改正による患者個人の負担額への影響	高額療養費制度, 自己負担額, レセプトデータ	村松 容子(ニッセイ基礎研究所)	鵜田正博(順天堂大学大学院医学研究科博士課程学生)	
10:50-11:30		リスクベースの資産配分と実証研究	低リスク運用 FRP シュリンケージ法 ブラック・リッターマン・モデル ロバスト推定	新川康青(日本大学大学院総合基礎科学研究科博士前期課程学生)・田中周二(日本大学大学院総合基礎科学研究科)	小澤正典(慶應義塾大学理工学部)		座長:小暮厚之(慶應大学総合政策学部)	VARモデルを用いた日米の量的緩和政策の効果分析	VARモデル 量的緩和政策 流動性のわな ポートフォリオリバランス効果	山本信一(立命館大学経済学部), 徳山隼也(立命館大学経済学部学生)		小倉宏之(日本経営数理コンサルティング)	座長:金村慶二(住友生命保険相互会社)	わが国の国民皆保険制度の理念と現実のはざまでの一考察ー日本の不平等と健康格差が国民皆保険制のほころびとなるのだろうか?ー		鵜田正博(順天堂大学大学院医学研究科博士課程学生)
11:30-12:50	昼休み	理事・評議員会:401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。														
12:50-13:30	会長講演「高齢化社会における保険の役割」			米山高生会長		座長:菅野正泰(日本大商学部)										
13:30-15:00	基調講演「最近の保険監督行政について」			金融庁監督局参事官 栗田 照久氏		座長:菅野正泰(日本大商学部)										
15:00-15:40	第2セッション ファイナンス・リスク管理	企業利益に関する保険:オプションとしての保険から何を得るか?	企業利益, プライシング・カーネル, ボラティリティ, 無裁定条件, マイナスの行使価格, 正規分布, 算術ブラウン運動, バシュリエ	森平爽一郎(早稲田大学大学院ファイナンス研究科)	柳瀬典由(東京経済大学)	第2セッション 生命保険	長寿化を考慮した要介護状態別死亡率の推定と予測ー混合Lee-Carterモデルによるアプローチー	長期介護ケア(LTC), 弱者者保険, 要介護状態別死亡率, 混合Lee-Carterモデル	小暮厚之(慶應大学総合政策学部)・神谷信一(ナンヤン工科大学)・伏見考弘	井川孝之(PwCあらた有限責任監査法人)	第2セッション 保険モデル	動的一般化線形モデルによる年齢層別交通事故死傷者数の予測	クラス料率算定法, 動的一般化線形モデル, 状態空間モデル, 交通事故統計	叶開(ヨウカイ)(東京工業大学情報理工学院学生)・野村俊一(東京工業大学情報理工学院)	松山直樹(明治大学大学院先端数理科学研究科)	
15:40-16:20		日本における大震災の地震保険需要に与える空間的・時間的効果	Catastrophe insurance, earthquake, demand, heuristic	神谷信一(ナンヤン工科大学)・柳瀬典由(東京経済大学)	瀧野一洋(名古屋商科大学商学部)		平均余命の地域差を表す社会・経済指標と寿命リスク評価	死亡率, 異質性, 都道府県別生命表, 平均余命, リスク相関	井川孝之(PwCあらた有限責任監査法人)	田中周二(日本大学文理学部)		報告件数を用いたMack model によるIBNR 備金評価	IBNR, Mack condition, ロスディベロップメント, チェーンラダー法, 報告件数	中平圭亮(早稲田大学大学院基幹理工学研究科学生)・高橋快士(同上)・掛川勝寛(同上)・清水泰隆(早稲田大学大学院基幹理工学研究科)	野村俊一(東京工業大学情報理工学院)	
16:20-17:00		カウンターパーティリスク制約下での均衡プライシング	派生証券評価, カウンターパーティリスク, リスク制約	瀧野一洋(名古屋商科大学商学部)	森平爽一郎(早稲田大学大学院ファイナンス研究科)		日本人の寿命ー過去・現在・未来ー	藤澤陽介(RGAラインシュアラスカバニー)	田中周二(日本大学文理学部)・長谷川敏彦(未来医療研究機構)・伊藤憲祐(日本医科大学大学院医学研究科)	小暮厚之(慶應大学総合政策学部)		データ同化によるがん多重脱退モデル推定	死亡率, 有病率, 罹患率, データ同化, クロスタレーション, 区分的積分補間	尾上辰徳(明治大学大学院先端数理科学研究科学生)・松山直樹(明治大学大学院先端数理科学研究科)	中平圭亮(早稲田大学大学院基幹理工学研究科学生)・高橋快士(同上)・掛川勝寛(同上)・清水泰隆(早稲田大学大学院基幹理工学研究科)	
17:00-17:10	総会準備															
17:10-17:40	総会															
18:00-20:00	懇親会	唐菜 中野セントラルパーク店(明治大学中野キャンパスからJR中野駅に行く途中のビルの2F)														