

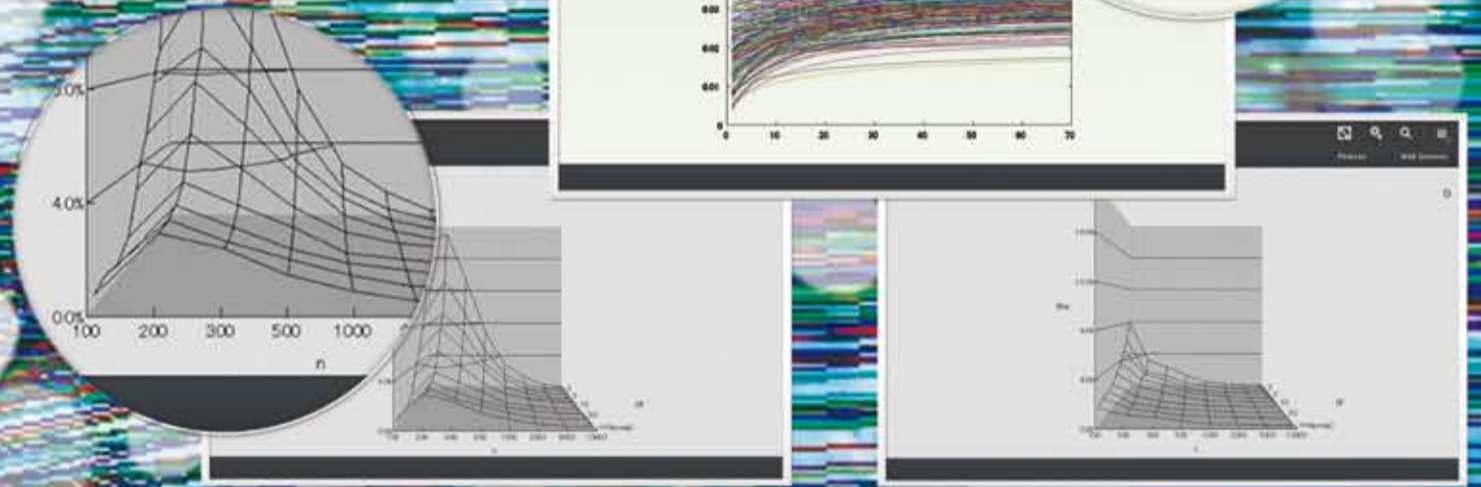
2013年8月8日(木)~10日(土)
 明治大学中野キャンパス
 1階交流ギャラリー

※会場が変更になる場合があります。

- ◆事前申し込み制となります。
- 「氏名、所属、聴講希望日、連絡先メールアドレス」を明記の上、下記メールアドレスまでお申し込みください。
- ・申し込み先 E-Mail : mims@mics.meiji.ac.jp
- ・申し込み締切 : 2013年7月31日

アクチュアリーと ファイナンスの融合

リスクの数理



8月8日(木)

9:00~10:30	松山直樹 (明治大学)	「オリエンテーション」
10:40~12:10	松山直樹	「リスク管理の現状と課題」
13:00~14:30	清水邦夫 (慶應義塾大学)	「損害保険数理に現れる離散分布 (1)」
14:40~16:10	清水邦夫	「損害保険数理に現れる離散分布 (2)」
16:20~17:50	清水邦夫	「損害保険数理に現れる離散分布 (3)」

8月9日(金)

9:00~10:30	田中周二 (日本大学)	「保険ERM (1)」
10:40~12:10	田中周二	「保険ERM (2)」
13:00~14:30	田中周二	「保険ERM (3)」
14:40~16:10	乾 孝治 (明治大学)	「市場の構造と流動性リスク (1)」
16:20~17:50	乾 孝治	「市場の構造と流動性リスク (2)」

8月10日(土)

9:00~10:30	乾 孝治 (明治大学)	「市場の構造と流動性リスク (3)」
10:40~12:10	森本祐司 (キャピタスコンサルティング(株))	「経済価値とリスクマージン (1)」
13:00~14:30	森本祐司	「経済価値とリスクマージン (2)」
14:40~16:10	森本祐司	「経済価値とリスクマージン (3)」
16:20~17:50	松山直樹 (明治大学)	「総括とディスカッション」

一般にはリスクは回避すべきものだが、保険や金融の事業は他者のリスクを引き受けることで成立し、これらの事業の成否はリスクを定量化する数理モデルとその活用(定量的リスク管理)に大きく依存している。リスクの数理モデルは、主に保険分野で発達したアクチュアリー数理と金融分野で発達したファイナンス数理に大別され、それぞれが独自の進化をとげてきたため、用いる確率測度や前提となる市場のモデルなどに大きな違いが見られる。しかしながら、近年の度重なる金融危機の背景となったリスク管理の失敗事例を踏まえ、従来型のリスクの数理モデルの有効性に疑問が生じており、アクチュアリー数理とファイナンス数理の垣根を越えた融合が模索されている。このような文脈で、リスクの数理モデルの基本的な構造を理解し、両者の融合を含む今日的課題への取り組みについて学ぶことをこの講座の目的とし、この分野に注力するJARIP、アクチュアリー数理コンソーシアム(明治大学・慶應義塾大学・日本大学)に関係する研究者と実務家による講義を行う。

Speakers :



乾 孝治
明治大学



清水邦夫
慶應義塾大学



田中周二
日本大学



松山直樹
明治大学



森本祐司
キャピタスコンサルティング(株)



明治大学先端数理科学インスティテュート
現象数理学研究拠点

問い合わせ先 :
 〒164-8525
 東京都中野区中野 4-21-1 明治大学中野キャンパス 8階
 明治大学先端数理科学インスティテュート
 Tel. 03-5343-8067, E-mail : mims@mics.meiji.ac.jp