

保険数学 集中講義 (協賛:日本アクチュアリー会)

## ケント大学 Paul Sweeting教授による「ERMセミナー」

最新のリスク管理手法 : Enterprise Risk Management

企業におけるリスク管理では、従来は個別のリスクに対応してモデル化し管理されてきましたが、近年、特に金融機関においては、企業の抱える様々なリスクを統合的に管理するERM(Enterprise Risk Management)の重要性が高まっています。保険リスクの専門家であるアクチュアリーの間でも、保険会社のリスクを統合的に管理するための取り組みが各国のアクチュアリーにより活発に行われおり、イギリスでは、2010年4月からイギリスアクチュアリー会の資格試験科目にERMが追加されるなどアクチュアリーにとって必須のものになってきています。

アクチュアリーサイエンスのこのような世界的な動向を踏まえ、このたびグローバルCOEプログラムの多様な人材育成プログラムの一環として、イギリスの試験制度の策定にも参加したケント大学 Paul Sweeting 教授をお招きし、最新のリスク管理手法ERMに関する集中講義を行います。

開催日 2010年 1月5日、6日、7日 (3日間) 、 講義回数は4回

時間 5日(火) 講義①. 14:00 - 15:30  
6日(水) 講義②. 10:30 - 12:00 、 講義③. 14:00 - 15:30  
7日(木) 講義④. 10:30 - 12:00

場所 京都大学理学研究科3号館 127講義室 (定員80名)

講演者 Paul Sweeting 教授(ケント大学 アクチュアリーサイエンス)  
コンサルティングアクチュアリーとして活躍後、ケント大学教授に就任。現在、イギリスアクチュアリー会のファイナンス・投資実務委員会(Finance and investment Practice Executive Committee)の委員長。また評議委員。最近はERMに関して幅広い活動をしており、新しいERM試験制度のシラバス作成や試験委員を務めています。

対象者 リスク管理やアクチュアリーサイエンスに興味のある学部生、大学院生  
日本アクチュアリー会の会員 (事前の申込は不要。理学部以外の学生の参加も可。)

講義概要 ERM(Enterprise Risk Management)に関して、次の講義を行う予定です。

- 講義①. Introduction (概要)
- 講義②. Financial Institutions (金融機関のリスク)
- 講義③. The Mathematics of ERM (ERMの数学的基礎)
- 講義④. Some case studies (ERMの実例)

京都大学大学院理学研究科数学・数理解析専攻 グローバルCOE <http://goe.math.kyoto-u.ac.jp/>

お問い合わせ先: 京都大学大学院理学研究科 数学事務室 GC0E 担当

〒606-8502 京都市左京区北白川追分町

E-mail: [gjimu@math.kyoto-u.ac.jp](mailto:gjimu@math.kyoto-u.ac.jp)

Tel: 075-753-2666

Fax: 075-753-3711

会場へのアクセスは京都大学理学研究科ホームページをご覧ください。

<http://www.sci.kyoto-u.ac.jp/modules/tinycontent9/index.php?id=1>