

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プログラム

「数学のトップリーダーの育成 -コア研究の深化と新領域の開拓」

保険数学 集中講義 (協賛 日本アクチュアリー会)



“Stochastic Modeling”

「確率論的モデリング」



2010.11.30(火)-12.2(木)



理学部 3号館
127大会議室

京都大学大学院理学研究科 集中講義

11月30日(火) 10:30 - 12:00 経済シナリオ (リスク中立とリアルワールド)

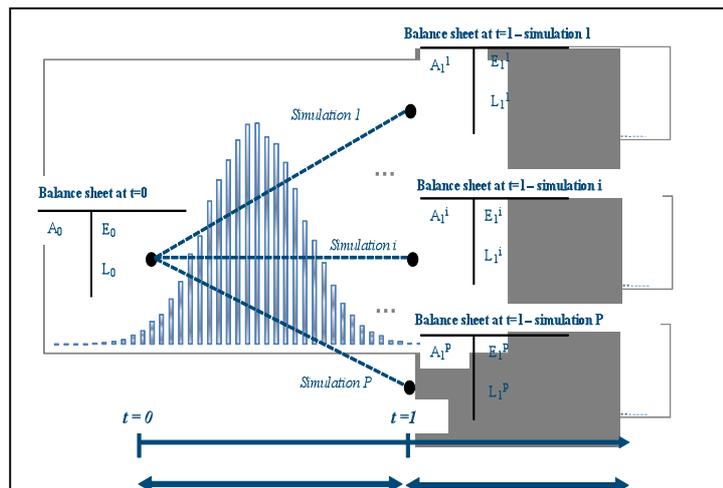
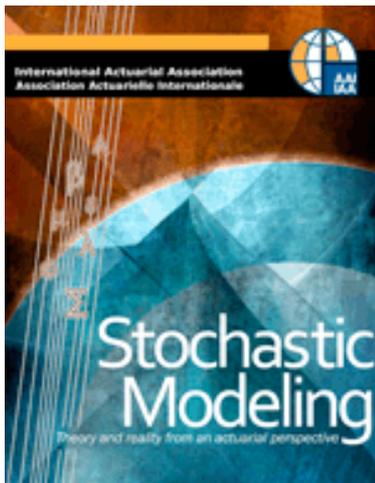
11月30日(火) 14:00 - 15:30 死亡・長寿リスクと契約者行動

12月1日(水) 10:30 - 12:00 損害保険リスクのモデリング

12月2日(木) 10:30 - 12:00 エコノミック・キャピタルとソルベンシー II

国際アクチュアリー会のモノグラフ「Stochastic Modeling – Theory and Reality from an Actuarial Perspective」

(ミリマン・インク編纂) をテキストとし、確率論的モデリングの理論的背景と実務への応用を解説します。





講師：Laurent Devineau

フランス・アクチュアリー会正会員

アクチュアリー・コンサルティング会社ミリマン・インクのパリ・オフィス研究調査部門ディレクターとして、生命保険および損害保険における様々なモデリングの研究および実務への応用をサポートしています。現在の主な業務は、ソルベンシーII 内部モデルにおける計算手法の開発およびその具体化です。経済シナリオ・ジェネレーター構築およびキャリブレーション、信用リスクのモデリング、確率論的死亡モデリング、損害保険における確率論的リザーブ積立手法を始めとするリスクモデリングにも注力しています。また、変額年金のプライシングおよびヘッジや保険リスク証券化の経験もあります。

フランス・リヨンの ISFA (Insurance and Financial Sciences Institute) 数理学部において、保険数理およびファイナンスの講義および共同研究を行っています。



会場：京都大学理学部3号館 127大会議室（定員80名）

対象者：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）

主催：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プログラム
「数学のトップリーダーの育成 -コア研究の深化と新領域の開拓」

協賛：社団法人日本アクチュアリー会

問い合わせ先：京都大学大学院理学研究科数学事務室（Tel. 075-753-2666）

