

On risk models with applications in life and non-life insurance

－ 生命保険・損害保険におけるリスクモデルの応用 －



10月20日（月）～10月23日（木）

京都大学理学研究科3号館110講義室

23日の午後のみ108セミナー室

会場への交通については、理学研究科ウェブページをご参照ください。

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

Prof. Vladimir K. Kaishev (City University London,
Cass Business School)

ウラジミール・カイシェフ教授

シティ大学ロンドン キャス・ビジネス・スクールの教授

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。他大学、理学部・理学研究科以外の学生の参加も可)

言語：英語

主催：京都大学大学院理学研究科数学教室

協賛：公益社団法人日本アクチュアリー会

10月20日(月)	110講義室	14:00～15:30	Introduction and Copulas
10月21日(火)	110講義室	10:30～12:00	Competing Risks Models I
	110講義室	14:00～15:30	Competing Risks Models II
10月22日(水)	110講義室	10:30～12:00	Risk models in non-life insurance I
10月23日(木)	110講義室	10:30～12:00	Risk models in non-life insurance II
	108セミナー室	14:00～15:30	Discussion time

講義概要：

本セミナーでは、生命保険と損害保険の両分野において、リスクモデルをどう構築して実務に適合させるかというテーマを扱う。初日の講義では、アクチュアリーが扱う様々なモデル手法を概観し、多変量分布のリスクモデル、コピュラ関数などに言及する。2日目の2回の講義では、死因を説明変数に加えた生存モデルを考え、ケーススタディとして特定の死因を除去した場合の余命への影響を考察する。3日目と最終日の講義では、損害保険の集合リスクモデルを取り上げ、総契約数を与えないモデル (Collective Risk Model) と固定したモデル (Individual Risk Model) の事例をケーススタディと共に紹介する。受講希望者で講義関連資料 (講義ノートおよび参照論文) を事前入手したい方は、下記の問い合わせ先に照会すること。

問い合わせ：京都大学大学院理学研究科数学教室
〒606-8502 京都市左京区北白川追分町 Tel：075-753-3700
E-mail：jimushitsu@math.kyoto-u.ac.jp