

On the fair valuation of insurance liabilities: merging market-consistency and actuarial considerations (保険負債の公正価値評価について：市場整合性と保険数理的考察)

平成30年10月29日(月)～11月2日(金)

京都大学理学研究科3号館127大会議室

会場への交通については、理学研究科数学教室 ウェブページをご参照ください。

<https://www.math.kyoto-u.ac.jp/ja/overview/access>

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(事前申込不要。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

Prof. Jan Dhaene

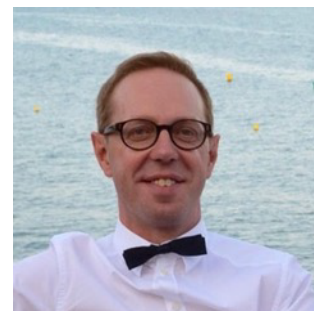
KU Leuven, Belgium

Faculty of Business and Economics

Head of the Research Centre Insurance

(Actuarial Research Group)

ベルギーアクチュアリー会 (IA|BE) 会員



スケジュール

10月29日(月)	14:45	～	16:15	Introduction & Modelling the financial-actuarial world
10月30日(火)	10:30	～	12:00	Fair valuation
10月31日(水)	10:30	～	12:00	Hedging
11月1日(木)	10:30	～	12:00	Hedge-Based valuation
11月2日(金)	10:30	～	12:00	Two-Step valuation
	14:00	～	15:30	Discussion Session

講義概要

本セミナーでは、2016年1月に導入された欧州保険資本規制 (Solvency II) で要請されている保険負債の公正価値評価 (fair valuation) について1期間モデルを用いた考察を行う。公正価値を市場整合的 (market-consistent) かつ保険数理的 (actuarial) な評価として定義し、ヘッジを用いた評価 (hedge-based valuation) では、まず保険負債に対する最良ヘッジを設定し、残りの部分を保険数理的手法で評価する。また2段階評価 (two-step valuation) の手法を紹介し、これらがいずれも同一となることを導く。Discussion Session では、学生の様々な質問に対して、講師がアクチュアリーや大学での経験をふまえたアドバイスを行う。

講師はアクチュアリー教育における幅広い知識と経験を有しており、著書 (共著) に「Modern Actuarial Risk Theory-Using R」「Actuarial Theory for Dependent Risks-Measures, Orders and Models」などがある。また保険数理・保険分野の複数のジャーナルの編集委員を務めている。

問い合わせ: ☎606-8502 京都市左京区北白川追分町

主催: 京都大学大学院理学研究科数学教室

京都大学大学院理学研究科 数学事務室

協賛: 公益社団法人日本アクチュアリー会 (IAJ)

E-mail: jimushitsu@math.kyoto-u.ac.jp

Tel: 075-753-3700