

ACTUARIAL MODELLING

日程:2019年11月5日(火)~11月8日(金)

会場: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
(<https://www.math.kyoto-u.ac.jp/ja/overview/access>)をご参照ください。



■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(English)

■講義概要

第1部は、初学者を対象として、アクチュアリー業務の最新トピックから、「保険に内在する保証の評価」「ERM」「ニューラルネットワーク」の3つを取り上げて紹介する。

第2部は、保険会社のリスク測定とモデリング手法に着目した4回の講義から構成される。まず、代表的なリスク指標であるバリュー・アット・リスク(VaR)と期待損失(Expected Shortfall)とその特徴を紹介し、欧州保険資本規制(Solvency II)や国際会計基準(IFRS17)においてどのようにリスクを測定しているかを論じる。その後、多変量損失モデル、コピュラ、従属性尺度など従属事象を扱うモデルを紹介し、実際にExcelを用いたリスク測定を試みる。

第3部は、学生の様々な質問に対して、講師が大学やコンサルティング会社における実務経験をふまえたアドバイスを行う。

講師: Prof. Łukasz Delong
Associate Professor, SGH Warsaw
School of Economics
Vice-President of the Polish Society
of Actuaries

■スケジュール(Schedule)

第1部(初学者向け)

11月5日(火) 14:45 ~ 16:15

From actuary of the 1st kind to the
actuary of the 5th kind

第2部(メインピック)

11月6日(水)

10:30 ~ 12:00

Risk measures and their properties

14:00 ~ 15:30

Copulas and their properties, part I

11月7日(木) 10:30 ~ 12:00

Copulas and their properties, part II

11月8日(金) 10:30 ~ 12:00

One-year risk, ultimate risk and
capital requirement – a practical
example

第3部(質疑・討議)

11月8日(金) 14:00 ~ 15:30

Discussion Session

問い合わせ: ☎606-8502

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 (IAJ)

京都市左京区北白川追分町
京都大学理学研究科数学教室
E-mail: jimushitsu@math.kyoto-u.ac.jp
TEL: 075-753-3700