

2020年度 第8回例会(Webinar) 「確率的死亡率モデルとその応用：ベイズのすゝめ」

公式CPD：2.0単位
＜その他＞

人口集団における死亡率の時間的変動は長寿リスクを引き起こし、その評価や管理のために確率的死亡率モデル (Stochastic Mortality Models, SMM)が活用されています。

この例会の前半では、我が国データへの推定例を示しながら、Lee-Carter(LC)モデルをはじめとする代表的なSMMを概観します。

後半では、パラメータ不確実性を考慮して、ベイズ法によるSMMの利用を考えます。LCモデルを例にとり、状態空間モデルの枠組みで、ベイズ法の推定、予測、計算の手順を説明します。また、その応用例を紹介します。

- ◆日時 : 2021年3月31日(水) 18:00 ~ 20:00
※今回は再放送の実施はありません。
- ◆会場 : ZoomによるWebinar開催 (定員 先着500名)
- ◆講師 : **小暮 厚之 氏**
東京経済大学教授, 慶應義塾大学名誉教授, 日本保険・年金リスク学会会長, 株式会社ProbSpace技術顧問
- ◆参加登録 : 別紙をご参照ください。定員に空きがあれば、開催時刻まで登録は可能です。
**※登録の際にご入力いただく氏名・会員番号は、例会当日のCPD単位のための出席確認に利用します。
お間違えないよう、正確にご入力をお願いいたします。**
※Q&Aについて、前回例会はSlidoを使用しましたが、今回の例会は配信場所の関係でZoomのQ&A機能による対応(前々回以前の例会と同様の方法)となりますことご注意ください。
- ◆講演資料 : 当会会員ホームページからダウンロードしてください(3月18日(木)頃掲載予定)。

講師プロフィール



小暮 厚之 氏

1986年イェール大学統計学部博士課程修了(Ph.D. in Statistics)。千葉大学, 慶應義塾大学等を経て現職。

最近の主な関心は、長寿リスク, 介護リスク, 健康リスクの統計モデリング。

2018年にSt. John's University School of Risk Management Award for Best APJRI paper, 2019年に日本統計学会賞を受賞。