

## 2019年度 第7回例会

# 「IFRS17号におけるイールドカーブ・モデリング：理論と実践の課題」

公式CPD：2.0単位  
＜会計基準＞

今回はウィル ハーリー 氏を講師に迎え、IFRS17号におけるイールドカーブ・モデリングについてご講演いただきます。

IFRS17号におけるイールドカーブの仕様(及び流動性プレミアム)に対して、保険会社各社は苦勞を重ねています。ただし、イールドカーブを用い、負債を評価する際、特に確率論的な評価原則に則った場合、理論面と実践上の両方で特有な課題があり、保険会社は注視しています。

本日は、これまで保険会社はどのように流動性プレミアムを取り入れてきたのか(例えば、ソルベンシーⅢにおける変額年金等)、IFRS17号アプローチとの差異、そして保険会社において採用できるソリューションについての紹介等、これまでの重要な論点を振り返ります。

- ◆日時 : 2020年3月4日(水) 17:00 ~ 19:00
- ◆会場 : TKP市ヶ谷カンファレンスセンター ホール7A (定員 400名程度)
- ◆講師 : ウィル ハーリー 氏  
(ムーディーズ・アナリティクス ERSインシュアランス(アジア太平洋地域) アクチュアリアル・モデリング・サービス ディレクター)  
※英語での講演となります。当日は日本語通訳があります。
- ◆参加申込 : 2月26日(水)までに当会Webサイトの会員サイトにログインし、会員ごとにお申し込みください。  
→画面中央の「申し込み・アンケートのお知らせ」タブをクリック  
→「2019年度第7回例会参加申し込み」をクリック  
→所属先や連絡先に必要事項を設問に沿って入力  
→設問画面最下部の「回答」ボタンをクリックして完了  
**定員を超えるお申し込みがあった場合に、参加者の抽選を行う・事前連絡なしに締切日を早める等の必要な対応を行う場合がございますので、予めご了承ください。**  
参加を強く希望される方は、お早めにお申し込みをお願いいたします。
- ◆講義資料 : 当会Webサイトの会員サイトからダウンロードしてご持参ください(2月26日(水)頃掲載予定)。  
当日の資料配布はございません。
- ◆その他 : 公式CPDの対象となります。正会員の方は出席確認のため、CPDカードを忘れずにお持ちください。

## 講師プロフィール

### ウィル ハーリー 氏

ウィル ハーリー 氏は、ムーディーズ・アナリティクスのディレクターで、アジア太平洋地域のアクチュアリアル・モデリング・サービス・チームを統括されています。

2011年にスコットランド、エディンバラに本社を置くBarrie & Hibbert(B&H、その後ムーディーズ・アナリティクスが買収)に入社し、モデリング・サービス・チームの一員としてモデル・カリブレーションや投資ガバナンス・サービスに従事されました。

2012年にアジアに拠点を移し、同地域の保険会社を支援されています。

B&H入社前は、パフォーマンス・リスク・マネージャーとしてAlliance Trust Asset Managementに勤務されています。

エディンバラ大学数学学部卒業。ヘリオットワット大学応用数学修士号取得。CFA協会認定証券アナリスト。

## 会場のご案内



### TKP市ヶ谷カンファレンスセンター ホール7A

東京都新宿区市谷八幡町8番地  
TKP市ヶ谷ビル  
(JR総武線 市ヶ谷駅徒歩2分)

お問い合わせ：日本アクチュアリー会 事務局 荒岡・尾花

TEL 03-5548-6033

Email araoka@actuaries.jp

ohana@actuaries.jp