

目 次

■ 「リスクと保険」創刊にあたって	1
■ 論文の募集について	2
■ 論 文	
・ 共単調性による多変量保険リスクの評価	小暮 厚之
・ ウェザーデリバティブの価格決定とその方向	若浦 雅嗣
・ 生命保険の証券化とその証券化商品の価格付け	小島 茂
・ ソルベンシー規制の国際的動向とEUソルベンシー II	河野 年洋
・ 「契約者の合理的期待 (PRE)」の 「契約者の公正な取扱い (TPF)」への変貌	山本 祥司
・ 米国キャッシュバランス制度と年齢差別問題	小野 正昭

目 次

■ 「リスクと保険」第三号の発行にあたって	1
■ 特別寄稿	
・ リスク尺度 - 理論と統計手法	塚原 英敦
	3
■ 論文	
・ 国民年金1号被保険者の加入・納付行動の分析 - なぜ、保険料を払わないのか	臼杵 政治・中嶋 邦夫・北村 智起
	21
・ 年金リスクを内包した企業の最適資本構成モデル	川上 高志・木島 正明・湯前 祥二
	43
・ 経験積率母関数によるエッシャー変換 ノンパラメトリック・アプローチ	森平 爽一郎
	67
■ 論文の募集について	85

目 次

■「リスクと保険」第四号の発行にあたって	1
■特別寄稿	
●「内部モデルのベンチマーク・スタディー」(CRO フォーラム) 調査結果について 白須 洋子・松山 直樹・森本 祐司	3
■論 文	
●新人口推計下における公的年金財政の持続可能性について 北村 智紀	41
●公的医療保険の効率性—情報の非対称性が存在する市場における政府介入の是非— 山本 信一・宮下 洋	63
■論文の募集について	85

目 次

■「リスクと保険」第五号の発行にあたって	1
■講 演	
● リスク尺度の最近の発展	楠岡 成雄 3
■論 文	
● NIG 分布：非正規分布を身近なものにするために	水野 敬 39
● 企業年金における「連帯」の構造と積立基準・会計基準のあり方	清水 信広 87
■寄 稿	
● 保険金不適切不払い・支払漏れとその行政対応	保井 俊之 123
■論文の募集について	137

目 次

■「リスクと保険」第六号の発行にあたって	1
■講 演	
● 定量的リスク管理、極値事象、数学と今回の金融危機 ポール・エンブレヒツ	3
● スイスソルベンシーテストについて フィリップ・ケラー	35
■論 文	
● 生命保険事業における複製ポートフォリオの応用 三石 宣史	69
■論文の募集について	91

目 次

■「リスクと保険」第七号の発行にあたって	1
■論 文	
●退職給付会計の国際基準 IAS19 改正のための討議資料の問題	
杉田 健・大森 孝造	3
●一時金選択率の推定と会計上のリスク評価	井川 孝之
	25
●年金負債固有リスクと金利期間構造リスクを考慮した LDI の再評価	
乾 孝治	43
●リスクと保険(2009)所収「NIG 分布：非正規分布を身近なものにするために」についての補足	
水野 敬	65
■論文の募集について	71

目 次

■「リスクと保険」第八号の発行にあたって	1	
■JARIP フォーラム ソルベンシー II と保険会社の ERM		
● 基調講演「国際的な規制・会計動向と金融機関 ERM への影響」		
白川 俊介	4	
● 「日本の MCEV と生命保険会社の資本リスクマネジメント」	花津谷 徹	19
● 基調講演「最近のソルベンシー規制の動向と ERM – 保険行政の現場から –」		
植村 信保	30	
● 「損害保険会社における ERM とその課題」	玉村 勝彦	36
● 「経済価値と保険 ERM」	松山 直樹	53
● 「ソルベンシー II と保険 IFRS：欧州保険会社における挑戦と今後の展開」		
エリック・ヴィエ	66	
● パネルディスカッション 「ソルベンシー II と保険会社の ERM」	74
■論 文		
● 拠出建て年金における自己責任とパターンリズムー老後の所得保障の観点から		
臼杵 政治	95	
● 確定拠出年金への加入で家計の株式投資は増加し得るのか？ー投資教育改善への示唆ー		
北村 智紀・中嶋 邦夫	119	
■論文の募集について	137	

目 次

■ 「リスクと保険」第九号の発行にあたって	1
■ 講 演	
● 金融リスクの計量化の再検討 ―統計データとは何か―	楠岡 成雄
	3
■ 論 文	
● 取引所の高速化が市場流動性に与えた影響―日経平均指数取引に関するティックデータ分析―	
	向殿 和弘・乾 孝治
	39
● 生命保険相互会社の株式会社化時における現行の寄与分基準による株式割当ての 公正・衡平性について	我妻 佳祐
	65
■ 論文の募集について	87

目 次

■「リスクと保険」第十号の発行にあたって	1
----------------------------	---

■特別講演

● 今後の国際規制の日本の保険会社への影響	三輪 純平・竹内 秀輝	3
-----------------------	-------------------	---

■論 文

● 公的年金の積立金に関する実質的な乖離状況の分析について	渡邊 千里	33
-------------------------------	-------------	----

● 生命保険の動的解約モデルの再検討	猪狩 誠・松山 直樹	65
--------------------	------------------	----

● 確率のコヒーレント・アグリゲーションの保険数理への応用	西屋 知英・松山 直樹	81
-------------------------------	-------------------	----

■論文の募集について	95
------------------	----

注 意

本会は、本書に掲載した論説及び資料中の意見並びに内容について責任を負いません。

また、本書に掲載した論説及び資料中の意見並びに内容については、本会・作成者が所属する組織等の見解を表すものではありません。

目 次

■「リスクと保険」第11号の発行にあたって	1
■講 演	
● 金融リスクの計量化 理論と実際	楠岡 成雄 3
■特別寄稿	
● 金利リスク評価のための金利シミュレーションの方法	安岡 孝司 35
■論 文	
● 地域差指数等の各種指標と公的医療保険制度における 各種財政調整の仕組みの統一的な理解について	渡邊 千里 67
● バリュエーション・アット・リスクの ヒストリカル・シミュレーション法に関する比較分析	岩本 菜々 97
■論文の募集について	111

注 意

本会は、本書に掲載した論説及び資料中の意見並びに内容について責任を負いません。

また、本書に掲載した論説及び資料中の意見並びに内容については、本会・作成者が所属する組織等の見解を表すものではありません。

目 次

■「リスクと保険」第12号の発行にあたって	1
■講 演	
●金融リスクの計量化 統計学の思想	楠岡 成雄 3
●オペレーショナル・リスクと極値理論	中川 秀敏 17
■論 文	
●韓国における生命保険商品の多様化と料率自由化の進展	崔 桓碩・大塚 忠義 61
■論文の募集について	73

注 意

本会は、本書に掲載した論説及び資料中の意見並びに内容について責任を負いません。

また、本書に掲載した論説及び資料中の意見並びに内容については、本会・作成者が所属する組織等の見解を表すものではありません。

目 次

■「リスクと保険」第13号の発行にあたって	1
■講 演	
● 金融リスクの計量化 一期間モデル	楠岡 成雄 3
● リスクアベタイト・フレームワークとストレステストについて	内田 善彦 29
■論 文	
● 生命保険における新契約収益検証と調和する保険料計算方法に係る考察	大塚 忠義・谷口 豊 83
● 学習アルゴリズムによる整合的多重脱退モデル推定	尾上 辰徳・松山 直樹 123
■論文の募集について	139

注 意

本会は、本書に掲載した論説及び資料中の意見並びに内容について責任を負いません。

また、本書に掲載した論説及び資料中の意見並びに内容については、本会・作成者が所属する組織等の見解を表すものではありません。

目 次

■「リスクと保険」第14号の発行にあたって	1
■講 演	
● 国際的な金融規制改革を見直す動き～プロシクリカリティ対策を踏まえて～	
	宮内 惇至 3
● 金融リスク管理の現状と方向性	藤井 健司 29
● 現代リスク理論の広がり～破産理論を中心に～	清水 泰隆 47
■寄 稿	
● ISAP 6 の公開草案の概要と論点	藤澤 陽介 61
■論 文	
● 経済価値評価の下で持続可能な資本配賦原理	三輪 将也・松山 直樹 69
■論文の募集について	79

注 意

本会は、本書に掲載した論説及び資料中の意見並びに内容について責任を負いません。

また、本書に掲載した論説及び資料中の意見並びに内容については、本会・作成者が所属する組織等の見解を表すものではありません。

目 次

■「リスクと保険」第15号の発行にあたって	1
■講 演	
●サイバー耐性の改善に向けて～金融機関と金融監督当局の取組み～ 山田 隆人	3
●産学共同による ERM 文献翻訳の取組み 田中 周二・岡田 秀路・渡辺 裕介	11
■寄 稿	
●ISAP6 成立までの議論の経緯 藤澤 陽介	23
●AGLM：アクチュアリー実務のためのデータサイエンスの技術を用いた GLM の拡張 藤田 卓・田中 豊人・岩沢 宏和	45
■論 文	
●Economic IRR とその活用 木村 健一・砂本 直樹	75
■論文の募集について	89

注 意

本会は、本書に掲載した論説及び資料中の意見並びに内容について責任を負いません。

また、本書に掲載した論説及び資料中の意見並びに内容については、本会・作成者が所属する組織等の見解を表すものではありません。

目 次

■「リスクと保険」第16号の発行にあたって	1
-----------------------------	---

■講 演

- 経済価値ベースの資本規制の導入をめぐる課題－産官学の交流の場で考える－

米 山 高 生	
森 本 祐 司	
白 藤 文 祐	
松 山 直 樹	
河 合 美 宏	3

■論 文

- テンソル解析を用いた死因別将来死亡率の同時推定

鈴 木 孝 太 郎	
松 山 直 樹	35

■論文の募集について	59
------------------	----

注 意

本会は、本書に掲載した論説及び資料中の意見並びに内容について責任を負いません。

また、本書に掲載した論説及び資料中の意見並びに内容については、本会・作成者が所属する組織等の見解を表すものではありません。

目 次

■「リスクと保険」第17号の発行にあたって	1
■寄 稿	
● 経済価値ベースのソルベンシー規制 — 規制か、レジームの転換か —	
米 山 高 生	3
● 経済価値ベースのソルベンシー規制導入へ今こそ注力すべき時	河 合 美 宏
河 合 美 宏	7
● 有識者会議を振り返って：「3つの柱」を機能させるために	森 本 祐 司
森 本 祐 司	11
■講 演	
● 経済価値ベース規制の導入を踏まえた ERM のあるべき姿	島 村 浩 太 郎
	鈴 木 敦 之
	板 場 建
	辻 野 菜 摘
辻 野 菜 摘	15
■論 文	
● Cramér-Lundberg モデルにおける生命保険会社の公平性をふまえた契約者配当政策	
下 山 法 之	57
下 山 法 之	57
■論文の募集について	73

注 意

本会は、本書に掲載した論説及び資料中の意見並びに内容について責任を負いません。

また、本書に掲載した論説及び資料中の意見並びに内容については、本会・作成者が所属する組織等の見解を表すものではありません。

目 次

■「リスクと保険」第18号の発行にあたって	1
-----------------------------	---

■講 演

- 経済価値ベースのソルベンシー規制の検討状況に関するフォローアップ

米 山 高 生	
白 藤 文 祐	
松 山 直 樹	
森 本 祐 司	
河 合 美 宏	3

■論 文

- 健康保険データに基づく糖尿病重症化の予測モデリング
—新たな引受査定ルール構築を目指して—

松 崎 達 哉	
小 暮 厚 之	
藤 澤 陽 介	
久 野 芳 之	
田 中 貴	41

■論文の募集について	69
------------------	----

注 意

本会は、本書に掲載した論説及び資料中の意見並びに内容について責任を負いません。

また、本書に掲載した論説及び資料中の意見並びに内容については、本会・作成者が所属する組織等の見解を表すものではありません。

目 次

■「リスクと保険」第 19 号の発行にあたって	1
■特別寄稿	
● 生命保険システムのダイナミズム：生命保険 140 年の歴史からの教訓 米 山 高 生	3
■講 演	
● 行動経済学で考える保険：共同体メカニズムの観点を中心に 大 垣 昌 夫	17
■論 文	
● 改良型 SVR 感度分析法による地域間死亡率格差の要因分析 田 中 草 平 松 山 直 樹	39
■論文の募集について	63

注 意

本会は、本書に掲載した論説及び資料中の意見並びに内容について責任を負いません。

また、本書に掲載した論説及び資料中の意見並びに内容については、本会・作成者が所属する組織等の見解を表すものではありません。

目 次

■「リスクと保険」第20号の発行にあたって	1
■講 演	
● 気候変動リスクへのアプローチ	
1. 特別講演	天 谷 知 子 3
2. パネルディスカッション	天 谷 知 子 西 原 亮 二 野 村 俊 一 酒 井 重 人 15
■論 文	
● 交互作用効果の計量化および可視化に関する考察	岩 沢 宏 和 大 塚 忠 義 35
● 交通量変動を考慮した新型コロナウイルス感染症の流行期における 都道府県別自動車事故頻度の分析	谷 川 祥 太 野 村 俊 一 佐 野 誠 一 郎 57
■論文の募集について	79

注 意

本会は、本書に掲載した論説及び資料中の意見並びに内容について責任を負いません。

また、本書に掲載した論説及び資料中の意見並びに内容については、本会・作成者が所属する組織等の見解を表すものではありません。