



委員会等活動成果

国際関係委員会 欧州調査部会

“The Actuary”の記事紹介

Pick Up

英国アクチュアリー会月刊誌「The Actuary」2004年9月号から

2004年9月21日

英国アクチュアリー会の共同研究・研究助成活動 A partnership approach to research

英国アクチュアリー会は、英国最大の公的研究助成機関である EPSRC（工学・自然科学研究会議：Engineering and Physical Science Research Council）と共同で研究するとともに多額の研究助成をおこなっている。The Actuary 9月号の記事では、この活動の最近の状況についてレポートしている。

●EPSRC とは

EPSRC とは、英国政府の科学技術院（Office of Science and Technology）傘下の7つの研究助成機関のうち最大のもので、年間予算は4億ポンド（2002年）に上る。対象分野は、物理、化学、数理科学などの基礎的研究から材料、高分子化学、電子工学、通信、建設、情報技術などの応用まで非常に幅広く、英国の研究の質を全体的・総合的にレベルアップすることを目的としている。

●英国アクチュアリー会と EPSRC の関係

EPSRC では、過去3年間に数量的投資金融（Quantitative Finance）研究に百万ポンドの予算を投入してきたが、その一部が英国アクチュアリー会からの研究助成金で賄われている。英国アクチュアリー会は、継続教育理事会（Education and CPD Board）の研究運営委員会（Research Steering Committee）が中心となって、2001年から EPSRC との共同研究・助成（EPSRC Joint Funded Grants）を実施しており、2004年がその最終年度となっている。英国アクチュアリー会からの拠出は毎年5万ポンド（約1000万円）に上る。共同研究内容としては、保険におけるアクチュアリアルな技術・知識の数学的・統計学的研究、アクチュアリアルな技術・知識の保険以外の分野への応用の研究などが挙げられる。これらの実績およびアクチュアリーが公益に資する研究者であることが評価され、英国アクチュアリー会は EPSRC の理想的パートナーとして認識されるようになってきている。



●2004年の共同研究

毎年英国アクチュアリー会の研究運営委員会が、EPSRCとの共同研究にふさわしい調査対象を選定している。今年の共同研究調査対象は次の3つが予定されており、最終的には12月に決定される。

資産と負債に対する金融経済学アプローチが顧客へもたらす利益について
投資戦略を含む個人のための貯蓄モデル作成
リスク把握手法改善のための新しい分析ツールの開発

●3月のワークショップ

今年3月に、英国アクチュアリー会とEPSRCはこれまでの共同研究内容を学者、研究者、企業関係者に広報するためのワークショップを開催した。サザンプトン大学リン・トーマス教授による顧客価値マネジメント (Customer Value Management) 研究、インペリアル大学マーク・デイビス氏によるデフォルトの相関関係 (Default Correlation) の統計的研究などが報告された。

原文をお読みにになりたい方は英国アクチュアリー会のHPをご覧ください。

<http://www.the-actuary.org.uk/>

"A PARTNERSHIP APPROACH TO RESEARCH"