

## 第二回

# 死亡率と出生率のモデリング

## ー長生きリスクヘッジの理論ー

講師：門田伸一氏

Aon Hewitt Japan シニアコンサルタント

日本アクチュアリー会正会員、日本年金数理人会正会員

日時：6月15日（金）16:00-17:30

場所：総合研究2号館3階「ケーススタディ演習室」（南東角）

参加：自由

生命保険における代表的な保険事故は「死亡」である。当該イベントは信用リスクモデルにおけるデフォルトと本質的に同じであり、事実連続的な保険数理モデルは Reduced-Form Approach と非常によく似た記述が行われる。

デフォルト強度に相当する死亡率のモデリングは過去からの研究課題であり、近年では経年要因と年齢要因に分解する Lee-Carter 法が広く採用・拡張されている。

今回の講義では Lee-Carter 法の概要と拡張例、過去において実際に取引された Mortality Derivatives を紹介する。

京都大学大学院 経済学研究科 附属プロジェクトセンター主催

# 金融工学理論研究会

<金融工学理論研究会の趣旨>

最先端の実務と理論研究に携わる金融機関や企業の研究者を講師として招き、最新の金融工学理論について学ぶ。（加藤康之 教授）