

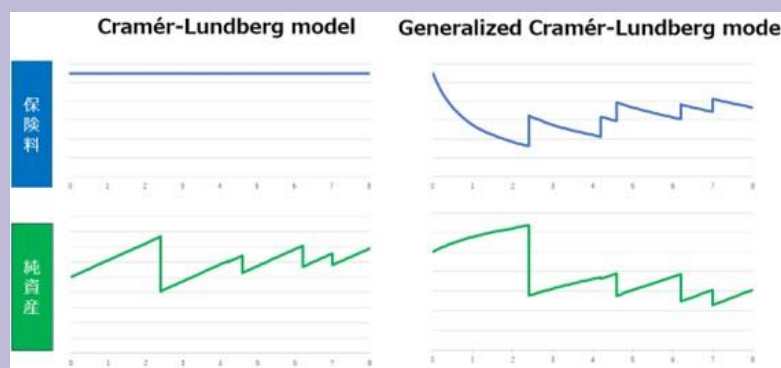
富田 昌 氏

(明治安田生命 収益管理部)



保険料改定を含む破産モデルと破産確率 ~ Cramér-Lundberg modelの一般化と その数学的性質~

破産理論は損害保険数理の一分野であり、保険会社の純資産（サープラス）の変動を確率過程を用いてモデル化し、破産確率などのリスク指標を用いて評価する。モデル化の方法については、Cramér-Lundberg modelが提案された後、様々な拡張が試みられてきた。本講演では発生頻度の不確実性と保険料の改定に着目して、信頼性理論との整合性を踏まえたモデルの一般化であるGeneralized Cramér-Lundberg modelを紹介し、破産確率を含めたその数学的性質を説明する。説明に際しては、（１）保険契約者数を複数とすることの影響、（２）発生頻度で条件づけた破産確率の単調性、といった論点に言及する。



↓参加登録はこちら↓



6月6日 (木) 17:00-18:30

武蔵野大学有明キャンパス, 4号館411教室, ハイブリッド開催

参加ご希望の方は、右上のQRコードより参加登録をお願いいたします。

参加費無料

登録締切: 6/5 (水)

国際展示場駅 徒歩7分
東京ビッグサイト駅 徒歩6分



コーディネーター: 篠崎 裕司 (武蔵野大学工学部数理工学科 准教授)

問い合わせ先: 武蔵野大学数理工学センター

https://www.musashino-u.ac.jp/research/laboratory/mathematical_engineering/世界の幸せをカタチにする。
Creating Peace & Happiness for the World