

9月フォーラム（第381回）

「お金のリスクを科学する ～金融工学への招待～」

講師： 枇々木 規雄 先生

慶應義塾大学理工学部 管理工学科 教授

●開催形式：

1. 会場開催

日時：2025年9月17日（水）18:00～19:00
（講演はどなたでもお申込みいただければ参加可能です）

会場：千里ライフサイエンスセンタービル
6階「千里ルームA」

2. オンデマンド配信（講演録画収録分の後日配信）

配信対象および期間：

- ・千里ライフサイエンスクラブ会員は約2週間
- ・一般（会員以外：要申込み）は3日間

●申込方法：

下記当財団ホームページか二次元バーコードの
「参加申込」からお申込み下さい。

https://www.senri-life.or.jp/event_upcoming/forum/



●講演要旨：

金融工学は、金融市場や金融取引における様々な問題に対して、工学的な手法(数理的な理論やモデル)を用いて、解決を試みる分野です。ただ、一般にはあまり馴染みがないと思います。ですので、まず始めに金融工学の概要を簡単に紹介し、さらに、お金に関する身近な問題として住宅ローンを例にして話をします。

また、知っておいてほしいこととして、「一つのかごにすべてのたまごを入れてはいけない」(分散投資の重要性)、「ただ飯はない」(リスクなしに利益は得られない)の2つの考え方を紹介します。金融工学で対象となる代表的な金融商品であるデリバティブ(派生商品)の利用例についても説明します。

後半では、私の行った研究として、投資資金の資産運用(ポートフォリオの最適化)、信用リスク管理(銀行融資、カードローンのリスクのモデル化)、家計のファイナンス(退職後の資金計画、積立投資)について、簡単に紹介する予定です。

●講師プロフィール：

学歴：

慶應義塾大学大学院理工学研究科管理工学専攻修了(博士(工学))

職歴：

慶應義塾大学理工学部助手、専任講師、助教授、2009年より現職

専門分野： 金融工学(資産運用、リスク管理)

主なる著書： 枇々木規雄「金融工学と最適化」朝倉書店

主なる講演テーマ：

金融工学の紹介と応用事例(資産運用、信用リスク管理、家計のファイナンスなど)

問合せ先： 公益財団法人 千里ライフサイエンス振興財団

「千里ライフサイエンスフォーラム」担当

〒560-0082 大阪府豊中市新千里東町1-4-2

Tel：06-6873-2006 Fax：06-6873-2002

E-mail：srlf-forum@senri-life.or.jp

