

富士大学研究者情報

経済学部経営法学科

教授

吉澤 容一

よしざわ やすかず

研究者基本情報	
最終学歴	一橋大学大学院経済学研究科博士後期課程修了
取得学位	博士(経済学)(一橋大学)、修士(国際経営学)(青山学院大学)、理学士(東京大学)
学位取得年月	平成27(2015)年3月、平成12(2000)年3月、昭和55(1980)年3月
出身地	東京都
専門分野	保険数理 (Actuarial Science)、定量的リスク管理、経営学
担当科目	経済数学基礎、経済数学、オペレーションズ・リサーチ、市場調査論、経営管理論Ⅰ・Ⅱ、国際経営論、経営史
所属学会	日本アクチュアリー会 (正会員)、IAA (Fellow)、日本応用数理学会、日本保険学会
長期研究テーマ	金融、経済を始めとする社会現象を対象とする数理理論
短期研究テーマ	コンピュータを活用した動的な定量的リスクの総合的研究
1年以内に発表予定の研究業績	

研究業績 (2024年9月末日現在)

【著書】

1	『諸外国の企業年金制度』(共)社会保険研究所, 1996年12月.
2	『海外の年金制度』(共)東洋経済新報社, 1999年9月.
3	『欧米保険市場における個人向け保険商品の特性と販売・募集の実態』(共)損害保険事業総合研究所, 2007年9月.
4	『主要国の保険業界関連組織の役割・活動と法的背景』(共)損害保険事業総合研究所, 2008年3月.
5	『欧米損害保険会社における損害調査実務の現状分析』(共)損害保険事業総合研究所, 2008年9月.
6	『諸外国における保険制度の官民役割の実態について』(共)損害保険事業総合研究所, 2009年3月.
7	『欧米主要国におけるERM(統合リスク管理)およびソルベンシー規制の動向について』(共)損害保険事業総合研究所, 2009年9月.
8	『欧米主要国における保険規制、監督、市場動向について－保険販売の規制と実務－』(共)損害保険事業総合研究所, 2010年3月.

【論文】

1	"The Structure and Pricing of Savings-type Policies in Japan"(共), Casualty Actuarial Society CAS Proceedings, May 1991, pp.213-252,
2	「新しい視点からの企業年金の財政運営(受給保護と支払能力確保)」(単)『季刊年金と雇用』年金総合研究センター14(3)(52), 1995年11月, 56-68頁.
3	「保険商品の価格(予測と調整)」(単)『損保総研レポート』第83号, 2008年3月, 31-85頁.
4	「気象現象と損害保険 -天候デリバティブの価格など-」(単)『損保総研レポート』第86号, 2008年12月, 23-60頁.
5	「定量的リスク管理のためのモデリング -エコノミック・キャピタル&ストレステスト-」(単)『損保総研レポート』第90号, 2009年12月, 1-49頁.
6	「極値事象のリスク管理 -カタストロフィ (CAT) と極値理論 (EVT) など-」(単)『損保総研レポート』第92号, 2010年6月, 35-90頁.
7	"Note on the Time Evolution of Bivariate Copulas"(共)International Conference Financial and Actuarial Mathematics FAM-2011 (ISSN:1314-460X), August 2011, pp.3-7.
8	「時間発展コピュラと順位相関」(共)『JCROSSAR2011論文集』, 2011年9月, 121-128頁.
9	"Evolution of bivariate copulas in discrete processes"(共)応用数理学会JSIAM Letters, Vol.3, October 2011, pp.77-80.
10	"On time dependent bivariate copulas"(共) NCTAM Theoretical and Applied Mechanics Japan, Vol.59, November 2011, pp.303-307.
11	"Evolution of Multivariate Copulas in Discrete Processes"(共)ICOAE 2012 Economics and Finance, September 2012, pp.186-192.
12	"Evolution of Copulas : Continuous, Discrete, and its application to Quantitative Risk Management"(単), 一橋大学機関リポジトリHERMES-IR, March 2015, pp.1-75.
13	"Risk estimation model on epidemic outbreaks for an insurer"(共), Instituto dos Atuários Portugueses ASTIN Colloquium in web site, May 2016, pp.1-11.
14	"Generalized evolution of copulas in discrete processes"(共)計算社会科学研究会 第1回計算社会科学ワークショップweb site, February 2017, pp1-8.
15	"Evolution of copulas in discrete processes with application to a numeric modeling of dependence relation between exchange rates"(共), Numerical Analysis and Its Applications NAA2016 Lozenetz, Lecture Notes in Computer Science vol. 10187(ISBN : 978-3-319-57098-3)Springer, May 2017, pp.359-366.
16	"Evolution of multivariate copulas in continuous and discrete processes"(共), Intelligent Systems in Accounting, Finance and Management, Vol.25, Wiley, March 2018, pp.44 - 59.
17	"Time evolution of copulas and foreign exchange markets"(共), Information Sciences, Vol. 467, Elsevier, July 2018, pp.163 - 178.

18	"Value at Risk for the portfolio problem with copulas"(共), Empowering Science and Mathematics for Global Competitiveness (ISBN: 978-1-138-61666-0) , CRC Press (Taylor & Francis Group), June 2019, pp.371-376.
19	"Long memory estimation in a non-Gaussian bivariate process"(共), Applied Mathematics and Computation, Volume 420, Article 126871, Elsevier, May 2022, pp.1-16.

【その他の執筆】

1	『企業年金改革 公私の役割分担をめぐって』(翻訳)(共)東洋経済新報社, 1997年5月, 127-151頁.
---	---

【学会発表】

1	"Proposal for New Management System of Employees' Pension Fund", International Meeting of Insolvency Insurers for occupational benefits, Cologne, Germany, September 1995.
2	"Invitation to Institute of Actuaries of Japan", 5th International Conference of Actuaries, Actuarial Society of India, New Delhi, India, February 2003.
3	「保険数理へのコピュラの応用」, NCTAM第59回理論応用力学講演会, 2010年6月.
4	「時間推移コピュラによる順位相関の考察」, 応用数理学会2011年研究部会連合発表会, 2011年3月.
5	"Evolution of copulas and risk management", 東北大学 研究集会「数理ファイナンスとその周辺」, 2012年1月.
6	"Value at Risk for the portfolio problem with copulas", Science and Mathematics International Conference (SMIC) 2018, Jakarta, Indonesia, November 2018.
7	「定量的リスク管理について」, 中央大学企業研究所チュートリアル (Zoom) , 2022年2月.

【競争的外部資金による研究】

1	一般化時間発展コピュラを中心とする動的な定量的リスク管理の研究、科学研究費助成金、研究代表 吉澤容一：2018年度-2019年度
2	コピュラを活用した動的な定量的リスクの総合研究：平常時と非常時、科学研究費助成金、研究代表 吉澤容一：2019年度-2024年度

【教職歴】

1	2018年4月～2023年3月 東洋大学経営学部准教授
2	2023年4月～現在 東洋大学経営学部非常勤講師
3	2023年4月～現在 富士大学経済学部教授

【実務研究歴】

1	企業年金連合会数理部上席数理役 国内外の企業年金制度を調査・研究 1993年-1996年, 2003年-2005年
---	---

2	損害保険事業総合研究所研究部主席研究員 海外の保険制度の調査・研究および保険数理の研究, 2007年-2010年
---	--

【社会的活動】

1	2017年4月～現在 中央大学企業研究所客員研究員
2	2022年10月～現在 東洋大学現代社会総合研究所客員研究員