

科研費シンポジウム

「多様な分野における統計科学の新展開」

日時：日時：2015年10月24日（土）～10月26日（月）

場所：富山県民会館 704号室

（TEL:076-432-3111）

<http://www.bunka-toyama.jp/kenminkaikan/facilityguide/index.html>

科学研究費・基盤研究（A）（課題番号：15H01678）

「大規模複雑データの理論と方法論の総合的研究」

研究代表者：青嶋 誠（筑波大学）

開催責任者：蛭川 潤一（新潟大学），星野 伸明（金沢大学）

Program

Saturday, 24, October

Reception 13:00-13:10

Opening 13:10-13:15 **Junichi HIRUKAWA** (Niigata University)

Afternoon Session I 13:15-15:15

Chair **Junichi HIRUKAWA** (Niigata University)

1. 13:15-13:55 **大石 惇喜 (Atsunobu Oishi)**, 白石 博 (Hiroshi Shiraishi)

慶應義塾大学理工学研究科 (Graduate School of Mathematical Sciences, Keio University)

慶應義塾大学理工学部 (Department of Mathematics, Keio University)

「最適配当境界の統計的推定」 (Statistical Estimation for Optimal Dividend Barrier)

abstract

2. 13:55-14:35 **細野 剛二郎 (Tsuyojiro Hosono)**, 加藤 剛 (Takeshi Kato)

上智大学大学院理工学研究科数学領域・院 (Mathematics, Graduate School of Science and Technology, Sophia University)

上智大学理工学部情報理工学科 (Department of Information and Communication Sciences, Faculty of Science and Technology, Sophia University)

「重複ありのウェーブレット変換を利用した原油先物のリスクに関する考察」

(A risk analysis for crude oil futures by nondecimated discrete wavelet transform)

abstract

3. 14:35-15:15 **若林 光太 (Kota Wakabayashi)**, 加藤 剛 (Takeshi Kato)

上智大学大学院理工学研究科数学領域・院 (Mathematics, Graduate School of Science and Technology, Sophia University)

上智大学理工学部情報理工学科 (Department of Information and Communication Sciences, Faculty of Science and Technology, Sophia University)

「ウェーブレット分散を利用した原油先物のリスクに関する考察」

(A risk analysis for crude oil futures by wavelet variance)

abstract

Coffee Break 15:15-15:30

Afternoon Session II 15:30-17:30

Chair **Takayuki Shiohama** (Tokyo University of Science)

4. 15:30-16:10 **上原 悠植 (Yuma Uehara)**

九州大学大学院数理学府 (Graduate School of Mathematics, Kyushu University)

「エルゴード的レヴィ駆動型確率微分方程式の段階的推定」

(Stepwise estimation of ergodic Levy driven stochastic differential equation)

abstract

5. 16:10-16:50 **布能 英一郎 (Eiichiro Funo)**

関東学院大学経済学部 (School of Economics, Kanto Gakuin University)

「Pooling incomplete samples を伴う多変量離散分布における Kullback 情報量の直和分解について」

(Decomposition of the Kullback information in discrete multivariate distributions by pooling incomplete samples)

abstract

6. 16:50-17:30 新村 秀一 (SHUICHI SHINMURA)

成蹊大学経済学部 (Faculty of Economics, Seikei University)

「判別関数の誤分類確率と判別係数の 95 %信頼区間」

(The 95% confidence intervals of error rates and discriminant coefficients)

abstract

Sunday, 25, October

Morning Session 9:10-11:50

Chair **Takeshi Kato** (Sophia University)

7. 9:10-9:50 **Simon Clinet**

The university of Tokyo, grad. school of Mathematical sciences

Statistical inferences for ergodic point processes and applications to Limit Order Book
abstract

8. 9:50-10:30 **POTIRON Yoann**

The University of Chicago, Statistics Department

Parametric time series analysis and forecasting while taking proper account of the possible non-constancy of the underlying parameters of the model

abstract

9. 10:30-11:10 **Muneya Matsui**

Nanzan University

The extremogram and the cross-extremogram for a bivariate GARCH (1,1) process

abstract

10. 11:10-11:50 **金川 秀也 (Shuya Kanagawa)**

東京都市大学 共通教育部 (Department of Mathematics, Tokyo City University)

「株価日次収益率分析におけるジャンプ拡散過程モデルの同定とそのジャンプ時点推定への応用について」

(Estimation of Jump-Times of daily share prices of Nikkei 225 Stock Index using a jump diffusion model)

abstract

Lunch 11:50-13:15

Afternoon Session I 13:00-15:40

Chair **Yoshihiko MAESONO** (Kyushu University)

11. 13:15-13:55 **小部 敬純 (Takasumi KOBE)**, 種市 信裕 (Nobuhiro Taneichi), 関谷 祐里 (Yuri Sekiya)

鹿児島大学大学院 理工学研究科 (Graduate School of Science and Engineering KAGOSHIMA UNIVERSITY)

鹿児島大学・理工 (Department of Mathematics and Computer Science, Graduate School of Science and Engineering, Kagoshima University)

北海道教育大学・釧路 (Kushiro Campus, Hokkaido University of Education)

「3次元分割表における1要因対2要因の独立性検定による改良変換統計量」

(Improved transformed statistics for the test of one factor independence from the other two in an 3 ways contingency table)

abstract

12. 13:55-14:35 **西山 貴弘 (Takahiro Nishiyama)**, 山田 雄紀 (Yuki Yamada), 兵頭 昌 (Masashi Hyodo)

専修大学 経営学部 (Department of Business Administration, Senshu University)

東京理科大学大学院 理学研究科 (Graduate School of Science, Tokyo University of Science)
大阪府立大学 工学部 (Department of Mathematical Sciences, Osaka Prefecture University)
「高次元枠組みにおける共分散構造に関する検定について」

(On a test for covariance structure in high-dimensional settings)

abstract

13. 14:35-15:15 牛嶋 大 (Masaru Ushijima)

(公財) がん研究会ゲノムセンター (Genome Center, Japanese Foundation for Cancer Research)

「Dirichlet Process を用いた遺伝子発現データのクラスタリング」

(Clustering of gene expression data using Dirichlet process model)

Coffee Break 15:15-15:30

Afternoon Session II 15:30-17:30

Chair **Hiroshi Shiraishi** (Keio University)

14. 15:30-16:10 阿部 俊弘 (Abe Toshihiro), 小方 浩明 (Ogata Hiroaki), 塩濱 敬之 (Takayuki Shiohama), 谷合 弘行 (Taniai Hiroyuki)

南山大学・理工 (Department of Mathematical Science, Nanzan University)

首都大学・都市教養 (Department of Business Administration, Tokyo Metropolitan University)

東京理科大学・工 (Department of Management Science, Tokyo University of Science)

早稲田大学・国際教養 (School of International Liberal Studies, Waseda University)

「時変自己相関を持つ円周上のマルコフ過程」

(Modeling Circular Markov Processes with Time Varying Autocorrelation)

15. 16:10-16:50 島谷 健一郎 (Kenichiro Shimatani)

統計数理研究所 (The Institute of Statistical Mathematics)

「非定常空間クラスター点過程におけるパラメータ推定：田中・尾形の Palm 尤度法の拡張」

(Statistical inference for nonstationary cluster point processes: an extension of Tanaka-Ogata's Palm likelihood method)

abstract

16. 16:50-17:30 張 元宗 (Yuan-Tsung Chang)

目白大学 (Mejiro University)

「順序制約がある2つの正規母平均の推定—分散共分散が既知の場合」

(Estimation of Two Ordered Normal Means with Known Covariance Matrix)

abstract

Conference Dinner 18:30-20:30

パレブラン高志会館 旬彩千歳

(PALAIS BLANK KOSHIKAIKAN Shunsai Chitose)

5,000 yen

(TEL: 0 7 6 - 4 4 1 - 2 2 5 5)

<http://www.koshikaikan.com/information/2015/09/post-67.html>

map

Monday, 26, October

Morning Session 9:10-11:50

Chair **Nobuaki Hoshino** (Kanazawa University)

17. 9:10-9:50 **森山 卓 (Taku MORIYAMA)**, 前園 宜彦 (Yoshihiko MAESONO)

九州大学大学院数理学府 (Graduate School of Mathematics, Kyushu University)

九州大学大学院数理学研究院 (Faculty of Mathematics, Kyushu University)

「比のカーネル型推定量の漸近的性質について」

(Asymptotic properties of kernel estimators of ratios)

abstract

18. 9:50-10:30 **石井 晶 (Aki Ishii)**

筑波大学数理物質科学研究科 (Graduate School of Pure and Applied Sciences, University of Tsukuba)

First principal component and its applications to tests of means and covariance matrices for high-dimensional data

abstract

19. 10:30-11:10 **関谷 祐里 (Yuri Sekiya)**, 種市 信裕 (Nobuhiro Taneichi)

北海道教育大学・釧路 (Kushiro Campus, Hokkaido University of Education)

鹿児島大学・理工 (Department of Mathematics and Computer Science, Graduate School of Science and Engineering, Kagoshima University)

「漸近展開の不連続項を利用した離散バートレット型変換統計量の性質について」

(On the properties of discrete Bartlett-type transformed statistics using a discontinuous term of asymptotic expansion)

abstract

20. 11:10-11:50 **種市 信裕 (Nobuhiro Taneichi)**, 関谷 祐里 (Yuri Sekiya), 外山 淳 (Jun Toyama)

鹿児島大学・理工 (Department of Mathematics and Computer Science, Graduate School of Science and Engineering, Kagoshima University)

北海道教育大学・釧路 (Kushiro Campus, Hokkaido University of Education)

数学利用研究所 (The Institute for the Practical Application of Mathematics)

「二項反応における一般化線型モデルのリンク関数の拡張」

(On an extension of link functions for binomial generalized linear models)

abstract

Closing 11:50-11:55 Makoto Aoshima (University of Tsukuba)