

平成 23 年度統計数理研究所公開講座

「マルチンゲール理論による統計解析の基礎」

西山陽一 講師

| | | |
|------------------|-------------|--|
| 11 月 10 日 (木) | 10:00～12:30 | イントロダクション ・なぜマルチンゲールは役に立つのか ・準備 (ルベーク積分の復習, 条件付き期待値) ・離散時間マルチンゲール |
| | 13:30～16:00 | 連続時間マルチンゲール理論 ・定義, 例 ・任意抽出定理の使用上の注意 ・確率積分 ・伊藤の公式 |
| 11 月 11 日 (金) | 10:00～12:30 | 「確率過程の推定」への最短入門 ・確率変数の収束に関する諸概念 (準備) ・マルチンゲール中心極限定理 ・最尤推定量の漸近正規性 |
| | 13:30～16:00 | 「確率過程の推定」の実践的話題 ・Cox 回帰モデル ・拡散過程の高頻度データ解析 |

- * 玄関入口傘たてをご利用ください。
- * 領収書をご希望の方には受付で申請書をさしあげます。
- * 受講生カードは最後にご返却ください。