

## 平成 24 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

6 月 4 日 (月)	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
6 月 5 日 (火)	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。
- \* 受講生カードは最終日にご返却ください。