



2021  
July

2021年7月



Risk Analysis Research Center

## CONTENS

- 01 1. 今月のトピックス
- 01 2. 各プロジェクトからのお知らせ
  - 金融・保険リスクの計量化と戦略的制御プロジェクト
  - データ中心リスク科学基盤整備プロジェクト
  - リスク基盤数理プロジェクト
  - 環境情報に関する統計解析手法開発プロジェクト
  - 地震予測解析プロジェクト
  - 資源管理リスク分析プロジェクト
- 02 3. センター事務局からのお知らせ

## 1. 今月のトピックス

9月2日(木)にリスク解析戦略研究センターシンポジウムとリスク研究ネットワーク年次総会をオンラインにて開催する運びとなりました。シンポジウムは、特別講演とチュートリアル講演の2部構成となっており、下記の方々の講演を予定しております。

### <特別講演>

- ・青嶋 誠 教授 (筑波大学)
- ・塚原 英敦 教授 (成城大学)

### <チュートリアル講演>

- ・長尾 大道 准教授 (東京大学地震研究所)
- ・岩田 貴樹 准教授 (県立広島大学)

申込みなどの詳細が決まりましたら、リスク解析戦略研究センターウェブサイトにて順次お知らせいたします。

## 2. 各プロジェクトからのお知らせ

### ■ 金融・保険リスクの計量化と戦略的制御プロジェクト

- 8月4-5日に「第8回金融シンポジウム」をZoom ウェビナーを使ったオンラインで開催いたします。本シンポジウムは毎年開催しており今年で8回目を迎えました。今年「確率・統計モデルによる金融データの数理」「アクチュアリー実務と理論の融合」「コロナ感染症と企業、金融、公的融資への影響」「LIBOR 公開停止問題への対応」の4つのセッションテーマで、2日間にわたり開催を予定しております。(要申込み・参加費無料)

[https://www.ism.ac.jp/risk/finance\\_sympto2021.html](https://www.ism.ac.jp/risk/finance_sympto2021.html)

**第8回 統計数理研究所  
リスク解析戦略研究センター  
金融シンポジウム**

**金融が直面する  
新環境への対応と方法論Ⅲ**

2021年  
**8/4 水・5 木**  
13:30-16:45 13:30-17:30  
ZOOM ウェビナーによるオンライン開催

**事前登録制(先着順)・参加費無料**

最終局面を迎えたLIBOR移行対応  
大谷 聡 (日本銀行 金融市場部長)

A rough SABR formula  
深澤 止彰 (大阪大学大学院基礎工学研究科 教授)

LIBOR 公表停止に向けた対応と課題  
堀本 善雄 (全労済 総合政策局 専務)

LIBOR の廃止とマルチカーブ環境への影響  
室町 幸雄 (東京大学大学院経済学系 教授)

ご登録・詳細はホームページをご覧ください  
[https://www.ism.ac.jp/risk/finance\\_sympto2021.html](https://www.ism.ac.jp/risk/finance_sympto2021.html)

お問い合わせ先▶  
統計数理研究所 リスク解析戦略研究センター シンポジウム開催事務局  
山下 智志、長橋 英明 (rsec[at]ism.ac.jp)

荒川 研一 (株式会社リネオ銀行) 坂本 誠 (株式会社QUICKベトナムズ)  
池森 俊文 (統計数理研究所 特命教授) 板井 悠司 (リッチモンド湖沼博物館)  
大和田 孝文 (損害保険料率算出機構) 下山 法之 (富国生命保険相互会社)  
栗栖 大輔 (東京工業大学 助教) 高橋 淳一 (一般社団法人CRD協会)  
小池 祐太 (東大大学院 准教授) 野村 俊一 (早稲田大学 准教授)

(五十音順)

主催 / 大学共同利用機関法人 情報・システム研究機構 統計数理研究所 リスク解析戦略研究センター  
※当シンポジウムは JSPS 科研費 JP18H05290 (山口正徳, 早稲田大学) の助成を受けたものです

第8回金融シンポジウムポスター

(所内責任者: 山下 智志 教授)

### ■ データ中心リスク科学基盤整備プロジェクト

- 公的統計マイクロデータを利用した研究にご関心のある研究者を対象に、5月11日から1ヵ月間オンラインのアンケートを実施し、26件の回答を得られました。結果は順次 公的統計マイクロデータ研究コンソーシアムのウェブサイトなどで公開していく予定です。
- 公的統計マイクロデータ研究コンソーシアムでは、独立行政法人統計センターが公開する調査票情報のオンサイト利用に関する「オンサイト利用手引」と「オンサイト利用規約」の英語版をコンソーシアムのウェブサイトにて公開しました。  
<http://jmodc.org/online/>

この英語版は統計センターが発行する正式の書類ではありませんが、海外の研究者による公的ミクロデータを利用した学術研究を推進する目的で「行政における統計データの利活用の推進に関する研究」（研究代表者：椿広計）において作成されたものとなっています。

（所内責任者：南 和宏 教授）

## ■ リスク基盤数理プロジェクト

- 7月3日-4日に東京大学吉田朋広教授のJSTクレストによる「確率微分方程式のデータサイエンス入門 2021」がオンラインにて開催されます。  
[http://www.sigmath.es.osaka-u.ac.jp/statmodel/?page\\_id=2028](http://www.sigmath.es.osaka-u.ac.jp/statmodel/?page_id=2028)

（所内責任者：鎌谷 研吾准教授）

- 8月16日～26日に共同研究集会「極値理論の工学への応用」をオンデマンド形式で開催する予定です。

<https://sites.google.com/view/takaakishimura>

（所内責任者：志村 隆彰 准教授）

- 「情報量規準に関する国際集会」は開催を検討中です。決まりましたら順次お知らせいたします。

（所内責任者：二宮 嘉行教授）

- 「国際MOUに基づくウルム大-東北大-ISM 集会」については、2022年5月下旬に延期することになりました。

（所内責任者：栗木 哲教授）

## ■ 環境情報に対する統計解析手法開発プロジェクト

- 9月以降にオンラインでの共同研究集会の開催を予定しています。

（所内責任者：金藤浩司 教授）

## ■ 地震予測解析プロジェクト

- 6月3日に日本惑星科学連合（JpGU2021）大会の中で、報道関係者向けにむけた日本地震学会の記者懇談会が行われ、尾形良彦名誉教授が「ETAS モデル - 地震活動の可視化と地震予測」について講演を行いました。

<https://www.zisin.jp/publications/pdf/nf-vol117.pdf>

- 6月24日に統計地震セミナー、7月5日-30日にサマースクールを実施予定です。今年度もオンライン開催となっています。

（所内責任者：庄 建倉 准教授）

## ■ 資源管理リスク分析プロジェクト

- 当初予定していたベトナムでのワークショップは、感染拡大のため開催が厳しい状況となっています。また開発途上国に対するリモート環境支援については、手続きを確認しながら順次活動を進めていく予定です。

（所内責任者：吉本 敦 教授）

## 3. センター事務局からのお知らせ

次回の会議は2021年7月14日（水）11:00～の予定です。

2021/7/5