

# 目 次

渋谷 政昭 (慶應義塾大学 理工学部) .....	1
一般極値分布の推定, 再論	
北野 利一 (名古屋工業大学 社会工学専攻) .....	9
トレンドを有する極大外力に対する経験度について	
中島 上智 (Duke University 日本銀行), 國濱 剛 (東京大学 経済学研究科), 大森 裕浩 (東京大学 経済学研究科), Sylvia Frühwirth-Schnatter (Johaneers Kepler University Linz) .....	13
Generalized extreme value distribution with time-dependence using the AR and MA models in state space form	
神田 順, 羅 元隆 (東京大学 新領域創成科学研究科) .....	43
Annual maximum wind speed simulations based on moment parameters of parent distributions	
高橋 倫也 (神戸大学 海事科学研究科) .....	51
極値の線型トレンド	
永井 義満 (青山学院大学 理工学部) .....	62
環境の効果を受けるワイブル競合リスクモデルにおける故障原因不明を 含むデータに基づくパラメータ推定	
小松 高広, 牧本 直樹 (筑波大学 ビジネス科学研究科) .....	80
株式ポートフォリオにおけるファクター間相関と裾指数	
志村 隆彰 (統計数理研究所 数理・推論研究系) .....	95
続・最大値吸引領域と吸引係数について	
志村 隆彰 (統計数理研究所 数理・推論研究系) .....	102
グンベル分布の吸引領域の対数変換	