



Risk Analysis
Research Center

リスク解析戦略研究センター ニュースレター

News Letter

2024
December

2024 年12 月



韓国ソウル大学演習林でのマツ枯れと紅葉の様子(資源管理リスク分析プロジェクト)

CONTENS

- 02 1. 今月のトピックス
- 02 2. 各プロジェクトからのお知らせ
- 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
 - データ駆動型リスク解析のための計算数理プロジェクト
 - 環境情報に関する統計解析手法開発プロジェクト
 - 資源管理リスク分析プロジェクト
 - 金融リスクの計量化と戦略的制御プロジェクト
 - 地震予測解析プロジェクト
 - 時空間データ解析プロジェクト
- 04 3. センター事務局からのお知らせ

Risk Analysis Research Center

1. 今月のトピックス

12月17日(火)リスク解析戦略研究センター・金融リスクの計量化と戦略的制御プロジェクトでは第10回金融シンポジウムをZoomウェビナーにて開催します。

https://www.ism.ac.jp/risk/finance_sympto2024.html

統計数理研究所 リスク解析戦略研究センター

第10回 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V～

12月17日(火)
13:30～17:00

ZOOM ウェビナーによるオンライン開催
参加費無料：事前登録制
https://www.ism.ac.jp/risk/finance_sympto2024.html

テニカルセッション(登壇者)
木下 亮(東京経済大学・准教授)
篠崎 裕司(武蔵野大学・准教授)
崔 恒碩(八戸学院大学・准教授)
谷口 豊(早稲田大学・非常勤講師)

特別講演
川崎 能典
統計数理研究所 副所長

安原 貴彦
みずほ第一フィナンシャルテクノロジー 代表取締役社長

荒川 研一
リソナホールディングス 金融イノベーション研究所 所長

2. 各プロジェクトからのお知らせ

■ データ中心リスク科学基盤整備プロジェクト

- 11月5日 公的統計マイクロデータコンソーシアム運営委員会を開催し、評議会の開催、次年度の活動計画、ワークショップの開催などについて議論しました。

(所内責任者：南 和宏 教授)

- 11月18日 公的マイクロデータ研究コンソーシアムに連携するイベントとして、独立行政法人統計センターで「公的統計マイクロデータ利活用に関する研究集会」が開催されました。

https://www.nstac.go.jp/use/archives/event/setumeikai_20241118/

- 11月19日 「公的統計マイクロデータ研究コンソーシアムシンポジウム2024」をオンラインで開催しました。午前のセッションでは、疑似マイクロデータの研究利用に関するチュートリアルを、午後のセッションでは、行政記録情報をテーマにした講演が実施されました。



https://jmodc.org/event/sche_repo_2024sympo.php

(所内責任者：南 和宏 教授)

- 11月29日 統計数理研究所のプレスリリースで、村上隆夫准教授の所属する研究グループの成果「新しいプライバシー保護データ解析プロトコル「local-noise-free protocol」を開発 ～安全で高精度な頻度分布の推定を可能に～」が、報告されました。

<https://www.ism.ac.jp/ura/press/ISM2024-05.html>

- 12月10日 公的マイクロデータ研究コンソーシアム評議会を開催します。
- 12月12-13日 公的マイクロデータ研究コンソーシアム2024 連携イベントとして、共同研究集会「大規模データ公開におけるプライバシー保護に関する理論の研究」を開催します。

<https://jmodc.org/schedule/>

■ リスク基盤数理プロジェクト

- 11月6-8日 共同研究集会「無限分解可能過程に関連する諸問題」を統数研のセミナー室1及びオンラインのハイブリッドで開催しました。参加登録は48名で、対面での参加は各日約19名程でした。

<https://sites.google.com/view/takaakishimura#h.4ssy88uy2klm>

(所内責任者：志村 隆彰 准教授)

■ データ駆動型リスク解析のための 計算数理プロジェクト

- 『Computational Optimization and Applications』に論文が採択されました。
「On a minimization problem of the maximum generalized eigenvalue: properties and algorithms」

(A. Nishioka, M. Toyoda, M. Tanaka, and Y. Kanno)

■ 環境情報に対する統計解析手法開発 プロジェクト

- 10月24-26日 統計思考院の人材育成事業での研究会「生物多様性と群集動態：定量化の数理と統計的推定法」を長野県上田市で開催しました。

(所内責任者：島谷 健一郎 准教授)

- 2025年3月24日 統計数理研究所にて「ISM Symposium on Environmental Statistics 2025」の開催を予定しています。現在、加藤昇吾准教授、村上大輔准教授及び外部の先生のご協力で準備を進め、招聘する外国人の先生の人選等を考えています。

(所内責任者：金藤 浩司 教授)

■ 資源管理リスク分析プロジェクト



- 11月11日 ソウル大学農学生命学部(韓国)

にて統計数理ワークショップを企画し、開催しました。

(所内責任者：吉本 敦 教授)

- 12月18-19日 Benguet State Univ(フィリピン)にて、統計数理ワークショップを企画・開催する予定です。

(所内責任者：吉本 敦 教授)

- 2025年3月 例年開催のFORMATH国際シンポジウムを実施予定です。

(所内責任者：吉本 敦 教授)

■ 金融リスクの計量化と戦略的制御 プロジェクト

- 12月17日 トピックスで紹介している通り、第10回金融シンポジウムをオンラインで開催します。全体で6本の講演を実施します。

《プログラム》

13:30 ~ 開会挨拶(山下智志 統計数理研究所副所長)

テクニカルセッション(座長：鎌谷研吾教授)

「条件付きベータを用いたリスクの価格の推定における小標本バイアスの修正」

(木下亮 東京経済大学准教授)

「数理・計算ファイナンスの最近の問題意識」

(篠崎裕司 武蔵野大学准教授)

「低所得世帯の生命保険・共済加入行動に関する考察」

(登壇者：谷口豊 早稲田大学非常勤講師)

崔桓碩 八戸学院大学准教授)

特別講演(座長：池森俊文特命教授)

「時系列モデルと極値理論による金融リスク管理」

(川崎能典 統計数理研究所副所長)

「みずほ第一フィナンシャルテクノロジーの金融技術応用と研究開発のご紹介」

(安原貴彦 みずほ第一フィナンシャル

テクノロジー代表取締役社長)

「金融リスク管理における数理統計活用の潮流」

(荒川研一 りそなホールディングス

金融イノベーション研究所所長)

16:55 ~閉会挨拶(山下智志 統計数理研究所副所長)

※参加費は無料、事前登録制となっています。

(所内責任者：山下 智志 教授)

■地震予測解析プロジェクト

- 10月1日 第98回統計地震学セミナーを4階ラウンジ及びオンラインで開催しました。講演者は Wu, Stephen 准教授、外来研究員の詹 成祥 (Zhan, Chengxiang) 氏 (北京大学)、庄健倉教授、Clements, Timothy 氏 (米国地質調査所(USGS)地震科学センター) でした。18名 (うち外国人10名) の参加がありました。

https://www.ism.ac.jp/~ogata/Ssg/ssg_statsei_seminars.html

(世話人: 熊澤 貴雄 特任准教授)

- 10月4日 牛源源 (Niu Yuanyuan) 特任研究員が新しく着任しました。

- 10月30日 第99回統計地震学セミナーを4階ラウンジ及びオンラインで開催しました。講演者は Hsieh, Ming-Che (謝 銘哲) 氏 (台湾国立中央大学 地震災害・リスク評価管理センター (E-DREaM)、Petrillo, Giuseppe 氏 (NTU, Singapore) でした。12名 (うち外国人8名) の参加がありました。

https://www.ism.ac.jp/~ogata/Ssg/ssg_statsei_seminars.html

(世話人: 熊澤 貴雄 特任准教授)

- 10月31日 客員研究員の三井雄太准教授 (静岡大学理学部地球科学科) が第32回日本測地学会坪井賞を受賞し、記念講演「地震学的要素を取り入れた測地学研究の新展開」を行いました。

<https://geod.jpn.org/tsuboi/index.html>

■時空間データ解析プロジェクト

- 11月28-30日 カリフォルニア大学サンタバーバラ校の Gareth Peters 教授、統計数理研究所の松井知子教授らが、気候変動と金融に関するシンポジウム「Climate Finance & Risk 2024」をハイブリッド形式で開催しました。

<https://sites.google.com/view/climate-finance-and-risk-2024/home>

(所内責任者: 松井 知子 教授)

- 2025年1月8日 慶應義塾大学の菅澤翔之助准教授と共同で、応用空間統計ワークショップをハイブリッドで開催の予定です。現在プログラム

等を作成しています。

(所内責任者: 村上 大輔 准教授)

3. センター事務局からのお知らせ

- 11月のリスクセンター運営会議の議題

- ・本年度予算の執行について
- ・ハブ形成事業の申請について
- ・NOE 委員会提出資料 (中間活動報告) について
- ・各プロジェクトからの報告
- ・その他

- ・次回の会議は2025年1月15日 (水) 11:00 への予定です。

2024/12/2