

共同研究集会「極値理論の工学への応用」

日程：2019年7月18日（木）12:50～17:10, 7月19日（金）9:30～16:30

場所：統計数理研究所 3F セミナー室5（〒190-8562 東京都立川市緑町10-3）

7月18日（木）

- | | | |
|-------------|---|-------------|
| 12:50 | 開会挨拶 | 研究代表者 北野 利一 |
| 13:00-13:40 | 西郷 達彦（山梨大学 大学院 総合研究部）
極値入門としての気象データ解析 | |
| 13:40-14:20 | 貝淵 響（総合研究大学院大学 統計科学専攻／統計数理研究所）
VaR and extreme expectile estimation:
A novel GARCH-EVT approach dealing with bias and heteroscedasticity | |
| 14:20-15:00 | 渋谷 政昭（慶応義塾大学 名誉教授）
最大値安定基準の実用性 | |
| 15:00-15:20 | 休憩 | ★注 |
| 15:20-16:00 | 高橋 倫也（神戸大学 名誉教授）
極値データに当てはめる分布について | |
| 16:00-16:40 | 田中 智大（京都大学大学院地球環境学）
極値理論とコピュラ関数を利用した河川氾濫リスクの定量化 | |
| 16:40-17:00 | 北野 利一（名古屋工業大学 大学院工学研究科社会工学専攻）
（話題提供）ノンパラメトリックのようなパラメトリック解析 | |
| 17:00-17:10 | 事務連絡 | 志村 隆彰・北野 利一 |
| 18:00- | 懇親会（il-CHIANTI NORD（イルキャンティ ノルド）東京都立川市曙町2-10-12 1F
tel. 050-5355-7439, https://ilchiantinord.owst.jp ） | ★注 |

7月19日（金）

- | | | |
|-------------|--|----------------|
| 9:30-10:10 | 植田 優基（北海道大学 大学院理学院）
非可換確率論における極値分布 | |
| 10:10-10:50 | 竹内 敦司（東京女子大学 現代教養学部）
Rates of convergence of extreme value distributions via the IBP formulas | |
| 10:50-11:00 | 休憩 | |
| 11:00-12:00 | 池森 俊文（統計数理研究所統計思考院特命教授，ロボット投信株式会社顧問）
（招待講演）銀行経営の数理手法と極値理論 | |
| 12:00-13:00 | 昼食休憩 | ★注 |
| 13:00-13:40 | 吉羽 要直（首都大学東京 大学院経営学研究科）
裾依存性とポートフォリオリスクの定量化について | |
| 13:40-14:20 | 田中 茂信（京都大学防災研究所 水資源環境研究センター）
大規模アンサンブルシミュレーションの閾値 | |
| 14:20-14:40 | 休憩 | |
| 14:40-15:20 | 清水 啓太（中央大学 大学院理工学研究科）
信頼区間・予測区間に基づく水文頻度解析における不確実性評価 | |
| 15:20-16:00 | 北野 利一（名古屋工業大学 大学院工学研究科社会工学専攻）
ノンパラメトリックな2変量極値解析 | |
| 16:00-16:30 | 研究会打ち合わせ（次年度の企画案など）・事務連絡 | 進行：北野 利一・志村 隆彰 |

★注：2日目の昼食の仕出し弁当の予約を前日の休憩に確認します。弁当ならびに懇親会費は実費を徴収します。

申込は、こちら → <https://forms.gle/c3idLDPV71LmodX79>

また、入館証は各日、開始時にお渡しして、退室時に返却をおねがいします。

お断り：19日の発表予定者のご都合で、18日の発表と入換えがありました（前日の修正となり申し訳ありません。ご理解いただけるとさいわいです）