

目 次

【招待講演】

池森 俊文 (統計数理研究所統計思考院特命教授)	1
銀行経営の数理手法と極値理論	
西郷 達彦 (山梨大学大学院 総合研究部)	21
極値入門としての気象データ解析	
貝淵 響 (総合研究大学院大学 統計科学専攻)・川崎 能典 (統計数理研究所) ..	34
A bias-reduced GARCH-EVT approach for financial risk estimation	
高橋 倫也 (神戸大学 名誉教授)	49
極値データに当てはめる分布	
田中 茂信 (京都大学防災研究所 水資源環境研究センター)	61
閾値超過資料の閾値選定手法の提案	
植田 優基 (北海道大学 大学院理学院)	69
非可換確率論における極値分布	
竹内 敦司 (東京女子大学 現代教養学部)	84
Rates of convergence of extreme value distributions via the IBP formulas	
吉羽 要直 (首都大学東京 大学院経営学研究科)	91
裾依存性とポートフォリオリスクの定量化について	
田中 智大 (京都大学大学院 地球環境学堂)	111
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	
清水 啓太 (中央大学大学院 理工学研究科)・山田 正 (中央大学 理工学部)	
山田 朋人 (北海道大学 工学研究院)	123
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	
北野 利一 (名古屋工業大学大学院 工学研究科)	141
恋する極値統計	