

**研究集会「第18回ノンパラメトリック統計解析とベイズ統計」**

本年度は、基盤研究(B)「多様なノンパラメトリック推測法の融合による新たな高精度統計手法の開発」(研究代表者 前園 宜彦 (九州大学))、基盤研究(C)「モデル不確実性を考慮したベイジアン・プライシング法の構築とその長寿リスクへの応用」(研究代表者 小暮厚之(慶應義塾大学))、基盤研究(C)「ネットワーク統計学の開拓と災害・防災ネットワーク分析への展開」(研究代表者 寒河江雅彦(金沢大学))による共同開催の研究集会として実施させて頂く事になりました。

日程と場所は下記のとおりです。

日程 3月28日(火)~29日(水)

場所 慶應義塾大学三田キャンパス 南館2B41教室

<http://www.keio.ac.jp/ja/access/mita.html>

研究集会世話人 寒河江雅彦(金沢大学) 小暮厚之(慶應義塾大学)

---

3月28日(火曜日)

<8:55-9:00> はじめに 寒河江雅彦(金沢大学)

<9:00-9:30>

①「確率分布及びその台のノンパラメトリック同時推定」 森山卓(九州大学)

<9:30-10:00>

②「高次元データにおけるコピュラ」 小林凌雅(慶應義塾大学)、小暮厚之(慶應義塾大学)、深澤風土(慶應義塾大学)

<10:00-10:30>

③「方向統計学におけるノンパラメトリック回帰」 鶴田靖人(金沢大学)、寒河江雅彦(金沢大学)

<10:30-10:45> 休憩

<10:45-11:30>

④「少数データのための予測推定量」 竹澤邦夫(中央農業総合研究センター)

<11:30-12:00>

⑤「Modified gamma kernel density estimator by variance reduction」 Rizky Reza Fauzi(九州大学)、前園宜彦(九州大学)

<12:00-13:30> 昼休み

<13:30-14:15>

⑥「Amoroso カーネル密度推定量とその改良について」 五十嵐岳(筑波大学)、柿沢佳秀(北海道大学)

<14:15-15:00>

⑦「境界バイアスのない、対称分布をベースにした q-MIG カーネル密度推定量とその関連した話題について」 柿沢佳秀(北海道大学)

<15:00-15:15> 休憩

<15:15-16:00>

⑧「Bias Correction for Asymmetric Kernel Density Estimation with a Parametric Start」 作道真理(日本政策投資銀行)、蛭川雄之(摂南大学)

<16:00–16:45>

⑨「Nonparametric Estimation and Testing on Discontinuity of Positive Supported Densities: A Kernel Truncation Approach」 蛭川雄之(摂南大学)、Benedikt Funke(TU Dortmund)

<16:45–17:30>

⑩「Skewing Methods for Variance-Stabilizing Kernel Regression Estimator」 西田 喜平次(兵庫医療大学)

3月29日(水曜日)

<9:00–9:30>

⑪「Bayesian Modeling of Autocorrelation and Intraday Seasonality in Financial Durations」 鳥谷部智規(慶応義塾大学)、中妻照雄(慶応義塾大学)

<9:30–10:00>

⑫「Bayesian Analysis of Intraday Stochastic Volatility Models with Leverage and Skew Heavy-Tailed Error in High-Frequency Commodity Market」 中北誠(慶応義塾大学)、中妻照雄(慶応義塾大学)

<10:00–10:30>

⑬「New Sequential Monte Carlo methods and extension for rolling window estimation」 粟屋直(東京大学)、大森裕浩(東京大学)

<10:30–10:45> 休憩

<10:45–11:15>

⑭「Modeling strategic interaction of manufacturers and retailer via Nash bargaining model accommodating retailer Stackelberg game」 構井友人(筑波大学)、金澤雄一郎(ICU)

<11:15–11:45>

⑮「On parallelizing MCMC」 松本知巳(筑波大学)、金澤雄一郎(ICU)

<11:45–12:30>

⑯「産業連関表に対する次元縮約法とクラスター分析～都道府県クラスターと産業構造推移の可視化～」 山本けい子(函館高専)、寒河江雅彦(金沢大学)

<12:30–13:45> 昼休み

<13:45–14:30>

⑰「Regression for High Dimensional Sparse Data – Measuring Large Scale Market Response from Aggregated Sales –」 照井伸彦(東北大学)、李銀星(東北大学)

<14:30–15:15>

⑱「A brief statistical analysis on long-term care insurance in Japan」 田中周二(日本大学)、Toshihiko Hasegawa(Future Medical Research Institute)、Kenyu Ito(Nihon Medical Institute)

<15:15–16:00>

⑲「A Bayesian Method for Forecasting Mortality Rates by Health Status」 小暮厚之(慶応義塾大学)、Shinichi Kamiya(Nanyang Technological University)、Takahiro Fushimi(Stanford University)

<16:00–16:05> –おわりに 小暮厚之(慶応義塾大学)