

科研基盤A「統計科学における数理的手法の理論と応用」

研究代表者：谷口正信（早稲田大学）によるシンポジウム

題目：「多変量モデル・時系列モデルにおける統計的推測の理論と応用」

研究分担者等：近藤正男(鹿児島大学)，種市信裕(鹿児島大学)

場所：鹿児島大学理学部（理系先端研究棟 大会議室）

日時：平成21年12月3日（木）～12月5日（土）

プログラム

12月3日（木）

(1) 14:20-15:00

種市信裕（鹿児島大学）、関谷祐里（北海道教育大学）、外山淳（北海道大学）

「ロジスティック回帰分析の検定統計量の分布の漸近展開」

(2) 15:00-15:40

世古規子（サノフィ・アベンティス（株））、山崎 彰子（東京理科大学）、瀬尾 隆（東京理科大学）

「2-Step 単調欠測データにおける平均ベクトルの検定と同時信頼区間」

(3) 16:00-16:40

天野友之（早稲田大学）

「Asymptotic efficiency of estimating function estimators for nonlinear time series models」

(4) 16:40-17:20

庄司直史（東京理科大学）、小方浩明（首都大学東京）、玉置健一郎（早稲田大学）、塩濱敬之（東京理科大学）

「Empirical likelihood ratio test of the change-point problem for stationary processes」

12月4日（金）

(5) 9:30-10:10

田中 潮（統計数理研究所）

「On parameter estimation based on the contact distance for certain superposed Neyman-Scott cluster fields」

(6) 10:10-10:50

白石博（東京慈恵会医科大学）

「Resampling Procedure in estimation of Optimal Portfolios for Time-Varying ARCH Processes」

(7) 10:50-11:30

小笠原春彦（小樽商科大学）

「四分相関係数の分布に関する漸近展開」

昼休み

Celbration Session for Prof. Marc Hallin's retirement.

Chairman: M. Taniguchi (Waseda Univ)

(8) 13:00-13:40

David Stoffer (Univ. Pittsburgh)

「Spectral Magic」

(9) 13:40-14:20

Vladimir Ulyanov (Moscow State Univ.)

「On approximations for power-divergence family of statistics」

(10) 14:20-15:00

Junichi HIRUKAWA (Niigata Univ.)

「On the asymptotic property of unit root process generated by locally stationary processes」

(11) 15:20-16:00

David Veredas (Univ. Libre Bruxelles)

「The method of simulated quantiles」

(12) 16:00-16:40

Valentin Patilea (IRMAR-INSa and CREST-Ensai, Rennes)

「A uniform Berry-Esseen bound for M-estimators for geometrically ergodic Markov chain」

(13) 16:40-17:20

Marc Hallin (Univ. Libre Bruxelles)

「On testing for symmetry in skew-normal families」

12月5日 (土)

(14) 10:00-10:40

稲葉太一 (神戸大学)

「パーセンタイル値の推定を目的とした折れ線回帰分析のアルゴリズム」

(15) 10:40-11:20

今井英幸 (北海道大学)、田中章 (北海道大学)、池田盛一 (釧路工業高等専門学校)

「カーネル法を用いた判別分析の誤判別率について」

(16) 11:20-12:00

三浦良造 (一橋大学)

「ブラウン運動上の統計量とエキゾチックオプション」