

62nd ISI World Statistics Congress 2019での研究発表



仲北 祥悟*

Presentation at 62nd ISI World Statistics Congress 2019

Key Words : diffusion processes, high-frequency data, observation noise, quasi-likelihood analysis

<参加会議名>

ISI WSC 2019 (62nd International Statistical Institute World Statistics Congress)

<開催場所> Kuala Lumpur, Malaysia

<渡航期間> 17th - 25th August, 2019

<発表タイトル>

Adaptive estimators for noisily observed diffusion processes

私は今回マレーシアの首都クアラルンプールで2019年8月18日から23日にかけて開催された統計学分野の国際会議 ISI WSC 2019 (62nd International Statistical Institute World Statistics Congress 2019)に参加し、Contributed Paper Sessionsにおいて自身の博士後期課程における研究内容であるノイズ付き拡散過程の適応的推定量についての口頭発表を行いました。本会議は国際統計協会によって2年に1度開催される統計学における最大級の国際会議の1つであり、今回は130を超える国から2500名以上の参加者が集う盛況ぶりでした。また発表内容も数理統計学や機械学習から政府統計まで幅広く、広範な統計学の様々な研究を一度に見ることができる貴重な機会となりました。

研究発表は4日目の統計的推測理論のセッション

で行いました。今回は、ノイズ付きエルゴード的拡散過程モデルの高頻度データ解析として、未知パラメータの適応的推定量のモーメント収束と数値シミュレーションについて発表しました。更に発表の進行についてもどこが肝なのか、何を目的としているのかを明瞭にするために何度も要所を強調し、その甲斐あってか後に良い発表であったという感想を複数戴くことが出来ました。また発表後の質疑応答において、確率過程の統計学において著名な先生から今回の研究において用いたノイズ除去の手法についてのコメントを戴き、今後の研究に役立つヒントを得られました。

最後に、今回の研究発表においてご支援戴きました生産技術振興協会に厚く御礼申し上げます。この経験を今後の研究生活に活かしていけるよう一層精進して参ります。



図1 発表風景



図2 会場の垂れ幕



* Shogo NAKAKITA

1992年12月生まれ
現在、大阪大学大学院基礎工学研究科
システム創成専攻 博士後期課程2年
修士(工学) 数理統計学
TEL: 06-6850-6111
E-mail: nakakita@sigmath.es.osaka-u.ac.jp



図3 ツインタワー



図4 発表者のパネル