

2021年11月吉日

各位

日本保険・年金リスク学会
研修会担当理事 田中・原田・野村

JARIP 研修会のご案内

拝啓 時下益々ご清栄のこととお慶び申し上げます。

日本保険・年金リスク学会（JARIP）の研修会を下記のとおり開催しますので、各位の積極的なご参加をお願い申し上げます。

敬具

記

1. 研修会の概要

日時：2021年12月23日（木曜日） 開始：13:30、 終了：16:00

場所：Zoomによるオンライン開催（接続情報は参加登録者に後日お知らせします）

講師：野村 俊一 氏

早稲田大学商学学術院大学院会計研究科 准教授（講師略歴は次頁）

講演題目：「Rによるスプライン回帰（一般化加法モデル）入門」

講演概要：

実世界において説明変数と目的変数の関係が線形回帰モデルで正確に記述できる場面は非常に稀であり、大抵は非線形な関係を持ちます。本講義では、単純な非線形回帰モデルとして多項式回帰、区分定数回帰、区分線形回帰を紹介した後、実データ解析に特に有用なモデルとしてスプライン関数を用いた一般化加法モデルを解説します。スプライン関数とは、単純な形の（基底）関数を重ね合わせることで滑らかな任意の関数を表現したものであり、目的変数の時間推移や地理的变化をも表現できます。一般化加法モデルでは説明変数の効果を滑らかなスプライン関数で推定する罰則付き回帰モデルであり、Rのmgcvパッケージを用いることで簡単に扱うことができます。本講義では実データを用いた解析例を交えて、一般化加法モデルの概要とRによる解析方法を解説いたします。

なお、本講義ではRの基本操作の理解と回帰分析の基本知識を前提とさせていただきます。また、講義内で紹介するデータとRの解析コードを参加者に提供させていただきます。

2. 参加費 会員・学生会員；無料、 非会員の方はご入会いただきます。

（年会費 正会員：5000円 学生会員：2000円）

法人会員は、3名までは無料、4名からは非会員のお取り扱いとなり、個人会員としてご入会いただきます。

3. 参加申し込み

期日:2021年12月9日(木)

学会サイトの【専用申込フォーム】より申し込みください。 <http://www.jarip.org/>

4. 講師略歴

2007年3月東京大学大学院情報理工学系研究科修士課程修了、2007年4月株式会社損害保険ジャパンにて主計業務等に従事。2012年3月総合研究大学院複合科学研究科後期博士課程修了(学位:統計科学)、2013年7月東京工業大学情報理工学系研究科助教、2017年5月情報・システム研究機構統計数理研究所データ科学研究系助教、2021年4月早稲田大学商学学院大学院会計研究科准教授(現職)。日本アクチュアリー会正会員。

著書に「カルマンフィルターRを使った時系列予測と状態空間モデル」「点過程の時系列解析」など。統計的地震予測と保険数理分野のデータ解析を主な研究テーマとしている。

以 上