

《風保中心國際傑出學者學術講座》

Professor Peter W. Glynn (Stanford University, USA)

時間：2017/12/12 (二) 15:30~17:30

地點：政治大學逸仙樓二樓 201 室 (臺北市文山區指南路二段 64 號)

主題：**Robust Optimization, Empirical Likelihood, and Regularization**

主辦單位：

政治大學商學院風險與保險研究中心

政治大學商學院 CARDIF 銀行保險研究發展中心

政治大學商學院保險業永續發展研究中心

政治大學風險管理與保險學系

財團法人繼耘保險文教基金會

時間	預定會議內容	
15:30~16:00	報到	
16:00~16:10	講者介紹	政治大學商學院風險管理與保險學系 謝明華教授
16:10~17:10	學術專題演講	<u>主講人：</u> Professor Peter W. Glynn (美國 Stanford 大學教授) Glynn 博士於 2010 年獲得 John von Neumann Theory Prize 的殊榮，並於 2012 年入選為美國國家工程學院院士 (National Academy of Engineering)。目前為 Journal of Applied Probability & Advances in Applied Probability 主編，研究專長為 Simulation, Computational Probability, Statistical Inference for Stochastic Processes, 與 Stochastic Modeling. <u>演講主題：</u> Robust Optimization, Empirical Likelihood, and Regularization
17:10~17:25	問題與討論 Q & A	
17:25~17:30	閉幕致詞	政治大學商學院 鄭宗記副院長

Title:

Robust Optimization, Empirical Likelihood, and Regularization

Abstract:

We discuss stochastic optimization problems, in which the underlying probability distribution is unknown and needs to be estimated from observed data. Such optimization problems arise in many different settings, including online applications, finance, etc. We make clear the connection between a certain class of robust optimization procedures and generalized empirical likelihood. From this connection, we show how one can construct confidence intervals for optimal values and solutions that achieve exact coverage asymptotically. A key finding is that the distributionally robust formulation essentially regularizes the problem via the sample variance. This work is joint with John Duchi and Hongseok Namkoong.

歡迎免費報名，報名網址：<https://goo.gl/hv6noP>

場地名額有限，請盡早報名，以免向隅！

承辦人：政大風險與保險研究中心 林冠杏小姐、張維娟小姐

電話：(02)2939-3091 轉 65331/65307

email：angellin@nccu.edu.tw