

## 長倉ゼミ入ゼミについて

**募集人数:** 特に決めていませんが、例年 A 日程, B 日程 あわせて 10 人から 15 人くらい

**(以下の内容は A 日程、B 日程、共通です)**

**試験内容:** 筆記試験、成績、レポート、面接を行います。可否は総合的に判断します(成績が悪くてもレポートが良かったり、筆記試験が悪くても面接が良かったりすると合格もありえます)

**筆記試験の範囲:** 微積分、線形代数、統計学の講義で学んでいるはずの基本的なことを聞きます。それらの講義で学んだことを復習しておくといでしょう。

**面接試験:** 筆記試験後、1 人あたりおおむね 5- 15 分くらい行います。

**レポート:** 下記の論文の少なくとも 1 つについても読み(2 つ以上でも構いません)、その内容を要約し、長倉のメールアドレス(nagakura@z7.keio.jp)まで A 日程は 3 月 9 日までに(B 日程は 3 月 23 日までに)送って下さい。このレポート課題は難しいと思いますが、参考までに行っているの、まったくできなくても合格はありえます(合格はあくまで総合的に判断します)。これらの論文は Google Scholar で検索しても見つけられますし、keio.jp の電子ジャーナルのところからも手に入れることができます。入手方法がわからない場合は私 (nagakura@z7.keio.jp)まで連絡してください。

- (1) "A State Space Approach to Estimating the Integrated Variance under the Existence of Market Microstructure Noise" (with Toshiaki Watanabe), *Journal of Financial Econometrics*, 2015, Vol. 13(1), pp. 45-82.
- (2) "Asymmetry in Government Bond Returns" (with Ippei Fujiwara and Lena M. Körber), *Journal of Banking and Finance*, 2013, Vol. 37, pp. 3218-3226.
- (3) "Explicit Vector Expression of Exact Score for Time Series Models in State Space Form", *Statistical Methodology*, 2013, Vol. 13, pp.69-74.
- (4) "Spurious Regressions in Technical Trading" (with Mototsugu Shintani and Tomoyoshi Yabu), *Journal of Econometrics*, 2012, Vol. 169 (2), pp. 301-309.
- (5) "Asymptotic Theory for Explosive Random Coefficient Autoregressive Models and Inconsistency of a Unit Root Test against a Stochastic Unit Root Process", *Statistics and Probability Letters*, 2009, Vol. 79 (24), pp. 2476-2483.
- (6) "Testing the Sequential Logit Model against the Nested Logit Model" (with Masahito Kobayashi), *Japanese Economic Review*, 2009, Vol. 60 (3), pp. 345-361.
- (7) "Testing for Coefficient Stability of AR(1) Model When the Null is an Integrated or a Stationary Process", *Journal of Statistical Planning and Inference*, 2009, Vol. 139 (8), pp. 2731-2745.
- (8) 「GARCH 型モデルと Realized Volatility を用いた TOPIX 日次リターンの非線形性の検証」(渡部敏明氏との共著)、*日本統計学会誌*、第 39 巻シリーズ J 第 1 号、pp.65-94(2009 年 9 月)。

**成績:** 成績表を提出してもらいます。春学期と秋学期の成績が記載されたものを、A 日程は 3 月 9 日までに (B 日程は 3 月 23 日までに) 研究室棟の長倉の郵便受けまで提出して下さい (いつから秋学期の成績が keio.jp で出力可能か把握していないので、もし 3 月 9 日に間に合わないようであれば春学期の成績表だけで構いません。B 日程の場合は必ず両方記載したものを提出して下さい)。もし秋学期の成績表が 3 月 9 日までに提出できない場合は、面接時に持参してください。

**注意:** keio.jp で出力した成績表には学籍番号、名前が記載されていないので自分で忘れず記入すること (例年、忘れていた人が一人か二人はいます)。

### 重要な注意事項

- (1) エントリーシートには学籍番号と電話番号は**書かない**こと (学籍番号は下記の説明にある私へのメールには忘れずに記入するようにしてください)。
- (2) A 日程応募者は 2 月 28 日までに (B 日程応募者は 3 月 20 日までに) 長倉 (nagakura@z7.keio.jp) までメールを送り、応募する旨を私までメールで伝えて下さい。**その際、名前、学籍番号を明記するのを忘れないこと。**応募人数が確定後、おおむね試験 1 週間前に、筆記試験の時間と場所を応募者に連絡します (その際、上記のメールの差出人に送るので、私までメールを送るのを忘れないようにしてください。忘れた場合は筆記試験の時間の連絡がいきません)。

以上