

長倉ゼミ入ゼミ C 日程について

募集人数: 特に決めていませんが、例年 2-3 人

日程: C 日程希望者は **4 月 2 日の午後 1 時まで**に**エントリーシート**と**成績表**(春学期と秋学期の成績が記載されたもの)を三田の研究室棟の長倉の郵便受けまで提出して下さい。また、下記の課題レポートを長倉のメールアドレス(nagakura@z7.keio.jp)へ**4 月 4 日の午後 5 時まで**に送って下さい。最初に書類選考を行い、合格者には**4 月 6 日**に予定している試験の時間と場所を 4 月 5 日の午前中までにメールで連絡します。

注意:

- (1) 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 1 人か 2 人はいます)。
- (2) エントリーシートには**学籍番号**と連絡先の**メールアドレス**を明記して下さい。メールアドレスが読めない場合は連絡をすることができないので、必ず誰が読んでもわかるようにはっきりと書いておいて下さい。
- (3) エントリーシートに電話番号は**書かないようにして下さい**。

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)へ**4 月 4 日の午後 5 時まで**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も、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)。

以上