

長倉ゼミについて2020

● **ゼミの概要** (現在やり方をいろいろ考えている過渡期なので以下の説明は変わる可能性があります)

計量経済学の理論、応用について学びます
(最近少し機械学習にも興味を持ち学んでいます)。

- ①ゼミではまず計量経済学の様々な手法の**理論的な面**を学びます。
- ②学んだ手法を**Python**というソフトウェアで実際のデータに応用する演習をします。
- ③三田祭論文、卒論では**自由に**テーマを選び、学んだ手法を用いて分析をして論文を書きます。

長倉ゼミについて

● 補足1

計量経済学の理論とは「経済、ファイナンスデータの**統計的分析手法の理論**」です。

経済やファイナンスの理論そのものをゼミの中で勉強するという事はありません。

● 補足2

三田論や卒論では、自分たちで分析テーマを見つけて論文を書いてもらいます(計量経済学の**理論**、**実証**、どちらでもOKです。また実証のテーマも**データを使って分析する**のであれば何でも構いません)。

長倉ゼミについて

- 補足3

私自身の研究は**計量経済学**、特に**時系列分析**、の理論的な研究に軸足を置いています。また応用面としては**ファイナンスデータ**への応用が主体です(実は最近は少しずつ企業金融的な研究もしています)。ただし、このゼミは**計量経済学のゼミ**なので、応用としてファイナンスに限らず自由に選んでください。逆にファイナンス関係のことが学べると思っていると**がっかりする**と思います。

長倉ゼミについて

ゼミの内容詳細

講義形式で以下のこと**など**を学んでいくか、輪読形式でテキストを学生に発表してもらうか、または以下の手法はゼミ必修の時系列の講義等で学んで、ゼミでは早速論文執筆のための先行研究の発表をしてもらうか、どうすすめるか現在考えています。

- 最小二乗法の復習
(特に行列を使った表現について)
- 操作変数法について
- ロジット、プロビットモデルについて
- パネルデータ分析について
- ボラティリティ変動モデルについて
- 状態変化を伴うモデルについて
- 非線形最小二乗法について
- 単位根、共和分検定について
- レジームスイッチングモデルについて
- カウントデータモデルについて

長倉ゼミについて

活動予定

3年生時の日程予定(あくまで予定)

4月～6月初旬から中旬：

ゼミは4限と5限に続けて行います。私が講義形式で教えるか、学生の発表にするか、または早速論文執筆のためのテーマ探しもかねて興味のあるテーマについて、論文を探してきてゼミ生の発表とするか、現在考えています。通常5限はPythonの演習を行います。

6月中旬以降～7月

グループごとに三田祭論文のテーマを見つけるために論文読み、および**発表**。グループごとに適宜面談。三田祭論文執筆、途中経過の発表。

長倉ゼミについて

活動予定(続き)

9月末までに三田論の初稿を書く

10月、4年生にチェックしてもらいながら、三田論をブラッシュアップ。10月末までに提出。

11月後半 三田祭
論文の発表。

三田祭後
12月、4年生の卒論をチェックしながら自らも、卒業論文執筆に向けて始動開始。

長倉ゼミについて

活動予定(続き)

4年生時の日程予定(あくまで予定)

春学期は卒論についての発表。

秋学期も引き続き卒論についての発表および途中経過の報告

11月末までに卒論の初稿を完成させる。

12月、3年生のチェックなども受けながら卒論をブラッシュアップ。12月末までに卒論提出

1月: 卒論発表会

長倉ゼミについて

補足

- ゼミは基本的に4年生と一緒にいる。
- 三田論は一応参加予定ですが、場合によっては参加しないかもしれません。

長倉ゼミについて

長倉ゼミ歴代の学生の三田祭論文
(これらの論文はゼミのホームページで見れます)

1期生

**「M&Aの買収企業の株価に与える影響
～EGARCHモデルによるボラティリティ分
析からのアプローチ～」**

「地震保険加入率の実証分析」

「子供の数が生活満足度に与える影響について」

長倉ゼミについて

長倉ゼミ歴代の学生の三田祭論文

2期生

「為替の不確実性が輸出量に与える影響について」

「デフォルト確率の推定について」

「大学の学費の決定要因について」

長倉ゼミについて

長倉ゼミ歴代の学生の三田祭論文

3期生

「企業の投資行動の分析」

「量的緩和政策の分析」

「中小企業の海外進出要因についての分析」

「小学生、中学生の学力の決定要因について」

長倉ゼミについて

長倉ゼミ歴代の学生の三田祭論文
4期生

「CNSアスリートとの雇用に伴うリスクの研究、CNSからNPBへのトランザクションと次年度パフォーマンス推定」

「仕事満足決定要因 一世代間比較」

「Realized Volatility を用いたボラティリティ変動モデルの予測力の比較検証」

「国際格付決定要因の推定と分析」

長倉ゼミについて

長倉ゼミ歴代の学生の三田祭論文
5期生

**「パネルデータ分析による日本プロ野球選手の
次年度年俸予測」**

**「順序ロジット分析による一般家庭における
理想子ども数の決定要因の特定」**

**「乗用車販売台数から見るエコカー補助金銭
的伊作の有効性」**

**「東京三菱銀行とUFJ銀行の合併が取引先企
業に及ぼした影響」**

長倉ゼミについて

長倉ゼミ歴代の学生の三田祭論文
6期生

「高校野球での無死1塁における作戦の有効性」

「コンビニPOSデータを用いたビール類需要の時系列分析」

「なでしこ銘柄選定基準に基づいた今年度選定企業の予測」

長倉ゼミについて

長倉ゼミ歴代の学生の三田祭論文
7期生

「**広告費用と景気動向からみる映画館動員数の変化**」

「**マルコフスイッチングモデルを利用した金融危機時におけるベア期間分析**」

「**地域金融のあり方を考える～地域金うう期間の経営と企業向け貸し出しの関係の分析～**」

「**財務諸表を用いた上場企業の業種別倒産要因分析**」

「**プロ野球における2番打者の作戦選択**」

「**日本のIR開設による経済効果**」

長倉ゼミについて

長倉ゼミ歴代の学生の三田祭論文
8期生

「奨学金遅延率における大学別に見た要因の
分析」

「JREITのボラティリティ予測モデル」

「因子分析を用いた競争馬データの分析」

「都道府県別国民健康保険医療費及び医療費
の3要素の増加率に関するパネルデータ分
析」

「機械学習の盲点」

長倉ゼミについて

長倉ゼミ歴代の学生の三田祭論文
9期生

「歌詞の潜在的意味分析に基づく Billboard ランキング予測」

「韓国の国際資本移動の統計的分析」

「ベイジアンネットワークを用いた株価予測」

「ファンダメンタル分析とテクニカル分析を用いた競馬の理論的必勝法」

長倉ゼミについて

- どのような学生を歓迎するか？

わからないことは自分で積極的に調べて解決するという**自主性**がある学生を歓迎します。

「わからないのは先生が教えてくれないから」という**受け身の姿勢**の学生は歓迎しません(私のゼミに来て欲しくありません)

長倉ゼミは目的意識を持ち、自分で頑張る学生を**応援**します。

長倉ゼミについて

- 最後に

無理せず楽しくやりましょう

ゼミではいわゆる勉強だけでなく、他のゼミ生との交流を通じていろいろなことを学んで下さい。