2009年度

ゼミナール募集要綱

林　ゼミ

定員　若干　名

Ⅰ．修士論文作成とゼミナール運営に関する方針

＊研究テーマの領域・形態等
＊修士論文作成の基本的な手順
＊標準的運営スケジュール（1・2学期，夏休み，合宿）
＊ゼミ運営に関するその他の方針・特徴
＊ゼミ志望者に対する担当教員からの要望等

研究テーマの領域：
（1）定量的証券投資に興味のある方（超長期から超短期＝デイトレードまで）、

または、

（2）定量的アプローチによって現実の問題を解析し、解決を目指す方、
（例、不動産価格や賃料の分析、新商品の性能と価格付け、
シックスシグマなどの品質管理、・・・）

を募集します。

ゼミの形態：　標準的な形態＝各自の修論テーマに沿った研究＋（必要に応じた）輪読。
ちなみに、2008年度は、1学期にCopeland・Antikarov著『リアル・オプション―戦略フレキシビリティと経営意思決定』(原著題名『Real Options: A Practitioners Guide』)の輪読を行いました。

修士論文のテーマ：　各自の興味と問題意識、スキル、バックグラウンドに応じて決めて頂きます。

志望者に対する要望：
＊現実の諸問題を定量的アプローチで解決したい人
＊確率・統計に興味のある人
＊主体的に問題に取り組む人・探究心のある人

スケジュール：
1学期は修士論文のテーマの絞込みを行い、2学期は選んだテーマに沿って研究を進め、論文作成する事を目指します。

その他：
＊ゼミ合宿の予定はありません。
＊当ゼミに関する生の声は、M30期生浜口一郎君、東光貴君、Razvan Dranca君にお尋ね下さい。

その他、何でもメールにてご質問下さい。　takaki@kbs.keio.ac.jp

<ここに入力して下さい>

Ⅱ．担当教員に関する情報

1．研究活動の特徴　（主な研究テーマ・アプローチなど）

研究分野：　統計学、応用確率論、金融工学、金融時系列解析。

現在自身で取り組んでいるテーマ、関心のあるテーマ
・高頻度金融証券データのモデル、分析
・金融証券の市場リスクの計測・管理手法
・超長期のポートフォリオ成長戦略
など。

2．2009年4月～2010年3月の長期出張予定　未定

Ⅲ．オープンドア日時

2/9～2/20（基礎科目授業時間内、2/13(金)16:30以降、2/14(土)は博士課程入試設営および設営の為行わない）

日付	（曜日）	時間帯			日付	（曜日）	時間帯		
面談ご希望の方はメールでご連絡下さい。					2／17	（火）	10:30	～	15:30
予定時間帯は以下の通りです。					2／20	（金）	13:30	～	18:00
2／8	（月）	13:30	～	17:30	／	（　）	:	～	:
2／9	（火）	13:30	～	17:30	／	（　）	:	～	:
2／13	（金）	15:00	～	16:30	／	（　）	:	～	:
／	（　）	:	～	:	／	（　）	:	～	:
／	（　）	:	～	:	上記以外の日時でも対応致します。				