

【 Excel 演習 パソコン貸与、サンプル・ファイルは持ち帰って使えます 】

Excel で学ぶファイナンスデータの 統計分析入門

～データ分析の基礎を3時間で習得～

講師 こばやし たけし **小林 武** 氏 名古屋商科大学経済学部・同大学院マネジメント研究科 教授

日時 平成30年5月25日(金) 午前9時20分～12時20分

企業の意思決定にとって統計分析は不可欠のツールとなっています。統計分析の理解は、多くの演習によって培われ、Excelはこの目的のための利用可能な力強いツールです。

本セミナーでは、内外の金融機関で20年以上にわたるリサーチ業務に携わってきた講師が、実際の金融市場データを通じて、統計分析の基礎を体系的に解説します。具体的な事例を豊富に取り上げ、市場リスク・信用リスクのファイナンスモデルを取り上げますので、実際の実務で利用できます。本セミナーを受講することにより、金融市場分析に必要な基礎的な統計解析のスキルを身に付けることができます。データ分析の基礎を身に付けたい方、ファイナンスの理解を深めたい方などのお役に立てるようわかりやすく説明いたします。

1. データの入手方法

2. 1変量データの取り扱い

- 平均・分散・標準偏差
- 歪度・尖度
- ヒストグラム
- 正規分布
- VaR (Value at Risk-バリュー・アット・リスク)

3. 2変量のデータの取り扱い

- 散布図
- 共分散
- 相関係数
- 株式ポートフォリオ評価

4. 線形回帰分析

- 単回帰分析
- 重回帰分析
- 資産価格評価モデル

5. 統計的検定手法

- t検定
- カイ二乗検定
- 信用リスクの評価

6. 最尤法

- 最尤法とは
- ロジットモデル(信用リスク評価モデル)の推定

～質疑応答～

【講師紹介】慶應義塾大学商学部卒。フランスグランゼコール HEC 経営大学院国際金融専攻修士課程修了。筑波大学大学院ビジネス科学研究科にて博士(経営学)号取得。

20年以上にわたり、東京銀行、格付投資情報センター、バークレイズ・グローバル・インベスターズ、三菱UFJモルガンスタンレー証券、NSフィナンシャルマネジメントコンサルティング(新日鉄住金ソリューションズ子会社)にて企業評価、資産運用、リサーチ業務等に従事。2014年より名古屋商科大学および同大学院にて金融論、金融政策論、証券投資論、コーポレートファイナンス、マクロ経済学等の講義を担当。

※ 開催一週間前に受講者が定数に達していない場合は中止となる場合があります。お申込みはお早めどうぞ。

※ 録音・ビデオ撮影はご遠慮下さい。

■主催 **金融財務研究会** Facebook: <http://www.facebook.com/keichoken>
<http://www.kinyu.co.jp> Twitter: <https://twitter.com/#!/keichoken>
Blog: <http://keichoken.blogspot.com/>

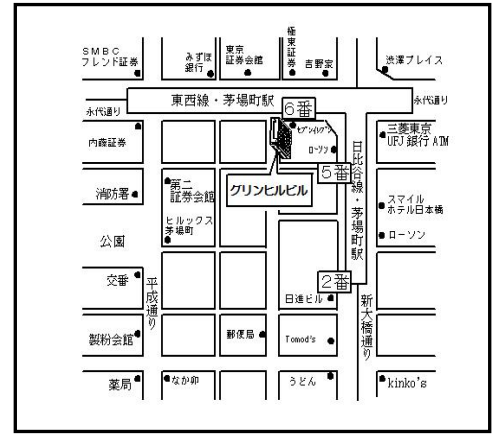


開催日

平成30年5月25日(金)
9:20~12:20

会場

茅場町・グリーンヒルビル
金融財務研究会本社 セミナールーム
東京都中央区日本橋茅場町 1-10-8
TEL 03-5651-2030
地下鉄東西線・日比谷線 茅場町駅
6番出口より徒歩1分



参加費

1名につき34,800円
(消費税、参考資料を含む)
1社2名以上同時に参加お申込みいただいた場合、お2人目から1名につき29,000円。追加申込みの場合はその旨ご記入下さい。

申込先

金融財務研究会 ホームページ <http://www.kinyu.co.jp/>
〒103-0025 東京都中央区日本橋茅場町 1-10-8 グリーンヒルビル
TEL 03-5651-2030 FAX 03-5695-8005

申込方法

ファックス又は郵便にて参加申込書をお送り下さい。上記ホームページの申込欄からもお申しいただけます。折り返し、受講証と請求書を郵送致します。参加費は下記の普通預金口座に開催日前日までにお振込み下さい。(但し経理の都合等で間に合わない場合は、ご連絡いただければお待ちいたします。)参加費の払戻しは致しませんので申し込まれた方がご都合の悪い時は代理の方がご出席下さい。又当日ご参加になれなかった場合、当社および経営調査研究会主催の他のセミナーに無料でご出席いただけます。(但し新しいセミナーの参加費との差額が2,000円以上の時は差額をお支払いいただきます。また、振替は1年以内にお願いたします。)ご記入いただきました個人情報は、当社および関係会社の受講者名簿の整備や今後開催されるセミナーのご案内等に使用します。

振込口座

普通預金 口座名 (株)金融財務研究会

三菱 UFJ 銀行 本店	1642356	三井住友銀行 本店営業部	7397637
三菱UFJ信託銀行 本店	2818151	みずほ銀行 東京営業部	1427715
三井住友信託銀行 本店営業部	2993982	りそな銀行 東京営業部	1693669

切らずにこのままお送り下さい

【Excel演習】Excelで学ぶ
ファイナンスデータの統計分析入門

5 / 25

参加申込書

FAX 03-5695-8005

平成30年 月 日

ご連絡・講師へのご質問等ご記入下さい	会社名	TEL FAX	
	所在地	E-Mail 〒	
	参加者ご氏名	部課名	
	〃	〃	
	〃	〃	
	〃	〃	
書類送付先 *セミナーコート 0961 (Fin-300961)	ご担当者 (同上の場合記入不要) TEL	部課名 FAX	

お申込の翌日には「受講証・請求書」を発送しておりますが、お手元に届かない場合は、弊社までご連絡下さい。