

【 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 で学ぶ株式計量分析の基礎 (1) (ポートフォリオ理論編)

～実際の株式市場データを使った演習により、
株式ポートフォリオ運用の基礎を3時間で習得～

◇午前午後の両講座の同時お申し込みで午後の講座が29000円に割引となります◇

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8月3日(金) 午前9時30分～12時30分

証券市場の自由化・取引のグローバル化の影響で、機関投資家の投資機会は大きく拡大しています。また、NISAや確定拠出年金といった個人投資家の資産運用を促進する制度が整備され、証券投資論の重要性は益々高まっています。なかでも、現在ポートフォリオ理論は、証券投資論の中核ですが、ファイナンスや統計学の基本的な知識が必要であり、独学での学習は容易ではありません。

本セミナーでは、内外の金融機関で20年以上にわたる資産運用や企業価値評価に携わってきた講師が、個別株式銘柄のリターンとリスクからポートフォリオのリスク、最適ポートフォリオ決定に至る現代ポートフォリオ理論を演習形式で体系的に解説します。Excelの演習により理論を実践する力を養いながら、現代ポートフォリオ理論の深い理解を目指します。

本セミナーを受講することにより、アセットマネジメントの実務に役立つ株式の最適資産配分方法を身に付けることができます。また、現代ポートフォリオ理論は、事業ポートフォリオの組み方など、金融機関以外においても、さまざまなビジネスの意思決定が可能です。株式投資に関心のある方、資産運用業務に携わる方の実務にお役に立てるようにわかりやすく説明いたします。数学・統計学の知識のない方でも、直感的なイメージに主眼をおき理論の本質を理解できるように解説いたします。

1. 個別株式銘柄のリターンとリスク (平均、分散、標準偏差、ヒストグラム)
2. 投資家の選好 (リスク回避的投資家、効用無差別曲線)
3. 株式ポートフォリオのリターンとリスク (共分散、相関係数)
4. 最適ポートフォリオの決定
(現代ポートフォリオ理論、有効フロンティア、シャープレシオ、接点ポートフォリオ)
5. トービンの分離定理と資産運用実務へのインプリケーション

～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、パークレイズ・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ことがあります。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>
Twitter : <https://twitter.com/#!/keichoken>
<http://www.kinyu.co.jp> Blog : <http://keichoken.blogspot.com/>



開催日

平成30年8月3日(金)
9:30~12:30

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
(開場は開演の30分前です。)

参加費

1名につき34,600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込いただけます。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 で学ぶ株式計量分析の基礎(1) (ポートフォリオ理論編)

8 / 3

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	
	〃	〃	
	〃	〃	
	〃	〃	
*セミナーコード 1451 (Fin-301451)	書類送付先 (同上の場合記入不要)	ご担当者 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。