

ゼロからまなぶ分散投資法

もりやひろゆき
講師 **森谷博之氏**

Quasars22 Private Limited(Singapore)
Director,MBA,MBA,MSc,
中央大学商学研究科兼任講師
中央大学企業研究所客員研究員

日時 平成30年12月4日(火) 午前9時00分~午後1時00分

ポートフォリオの選択理論は複数の資産に投資する際にはなくてはならない手法です。より単純な方法が必要とされる場合もありますし、何か特別な制約を課したい場合もあります。ポートフォリオ理論は株式、為替、債券という金融資産だけではなく、事業の投資にも示唆を与えてくれる考え方です。本セミナーではエクセルを活用しながらポートフォリオ選択理論を分かりやすく解説していきます。特にエクセル関数、エクセルアドイン、ソルバーなどの分析ツールを用いて、ポートフォリオの構築の方法と効果を学びます。

1. ポートフォリオ理論の基礎
2. ポートフォリオの最適化戦略とその特徴
3. リスクパリティ戦略とその特徴
4. エクセルを使った各戦略のシミュレーション

分散投資の効果の検証

■本セミナーに参加して修得できること

分散投資の基本をさまざまなシミュレーションを通して理解できます。どの場面でどの手法が使われるかを理解できます。エクセルを用いた演習を取り入れ、理解の向上に努めます。

■受講対象者

分散投資法に関して「初心者」の方を対象としています。年金運用担当で分散投資に興味のある方、また、分散投資法の乱数を用いたシミュレーション、過去データを用いたシミュレーションに興味のある方にも有益です。プログラミングの知識は必要ありません。ボタンを押してプログラムを走らせるだけです。日程に関してはご相談に応じますので、ご連絡ください。

■使用ソフト : Excelのバージョンを事前にお知らせください。

■PCは持ち込みが原則です。ソフトは事前にPCにインストールされている必要があります。

参考文献 :

EXCELで学ぶファイナンス5 ポートフォリオ理論の実践 (きんざい)

【講師紹介】

Quasars22 Private Limited(Singapore), Director, MBA, MBA, MSc, 中央大学商学研究科兼任講師、中央大学企業研究所客員研究員。主な論文に「金融市場の安定、多重性の増加、取引戦略の役割」企業研究第30号(2016年3月)、「シンガポールの金融ビジネスの可能性とそれを支えるシステム」企業研究第29号(2015年8月)がある。主な訳書に「シュワッガーのテクニカル分析」(1999、パンローリング)、「物理学者ウォール街を往く」(2005、東洋経済新報社)。

※録音・ビデオ撮影はご遠慮下さい。

■主催 **金融財務研究会**
https://www.kinyu.co.jp

Facebook : <https://www.facebook.com/keichoken>

Twitter : <https://twitter.com/#!/keichoken>

Blog : <https://kinyu.co.jp/blog/>

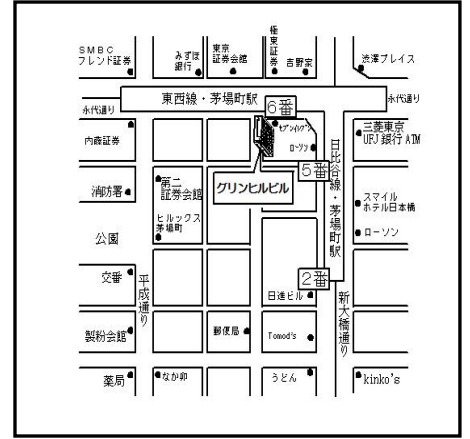


開催日

平成30年12月4日(火)
9:00~13:00

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34,800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 <https://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。)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年以内をお願いいたします。)
ご記入いただきました個人情報、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

ゼロからまなぶ分散投資法

12/4

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 〒		
お使いになるOSをお知らせください。	参加者ご氏名	部課名		
	〃	〃		
	〃	〃		
	〃	〃		
*セミナーコード 2280 (Inv-302280)	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。