

事業ポートフォリオの リスク分析入門 (Excel 編)

講師 もりやひろゆき
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 2019年6月20日(木) 午前9時30分~12時30分

企業は複数の事業を組み合わせることで経営資源の効率的な配分を実現しています。これを事業ポートフォリオの最適化と呼び、ビジネスポリシー、プロダクトミックスの観点から構築されます。本セミナーでは、資産運用の現場で活用されているポートフォリオ最適化の手法を用いて、経済・金融・ビジネス環境の変化(シナリオ)に対するリスク分析を学びます。エクセルを用いて架空のシナリオを作成し、分析します。

1. ビジネス環境とリスク
2. データ分析の背後にある考え方
(ア) 静的(1 期間)分析と動的(多期間)分析
3. シナリオの構築(エクセルを用いた演習)
(ア) 天災・人災によるシナリオ構築
(イ) 記述統計: 最大値、最小値、最頻値、中央値、平均
(ウ) 企業収益の期待値と分散
4. 3つのポートフォリオ最適化アプローチ(エクセルを用いた演習)
(ア) 平均分散アプローチ(効用重視)
(イ) リスク均等分散アプローチ(リスク重視)
(ウ) 均等配分アプローチ(シナリオ不必要)

■本セミナーに参加して修得できること

経済・金融・ビジネス環境のシナリオの立て方が分かるようになり、事業ポートフォリオの収益の期待値と分散を算出できるようになります。事業ポートフォリオのシナリオ分析を、エクセルを用いて学ぶことができます。リスク分析の考え方が身に付きます。

■受講対象者

事業ポートフォリオについて「初心者」の方を対象としています。事業ポートフォリオのリスクとリターンの分析に興味のある方であればどなたでも参加可能です。

■使用ソフト: Excel

■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。

【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/>

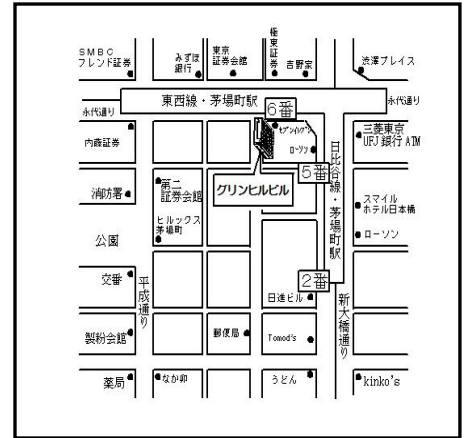


開催日

2019年6月20日(木)
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34,800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年以内にお願いたします。)
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

事業ポートフォリオのリスク分析入門
(Excel編)

参加申込書

FAX 03-5695-8005

6/20

2019年 月 日

ご連絡・講師へのご質問等ご記入下さい お使いになるOSをお知らせください。 *セミナーコード 1111(Inv-k191111)	会社名	TEL FAX		
	所在地	E-Mail 〒		
	参加者ご氏名	部課名		
	〃	〃		
	〃	〃		
	〃	〃		
	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。