

冬学期開講授業

2011 年度冬学期に、商学研究科の高見澤秀幸先生による「投資管理論」の授業が開講されています。経済学研究科の学生は履修することはできませんが、聴講は可能です。高見澤先生に事前に申し出て、是非、聴講してください。

- ・ 授業科目 投資管理論（区分：会計・金融）
- ・ 開講日時 冬学期 金曜日 第 2 時限（10：35～12：05）
- ・ 開講場所 西キャンパス第 2 講義棟 2 1 5

* シラバス詳細は、この pdf の P2 を参照。

10/13/2011

シラバス 詳細

科目名 Course Name	投資管理論 LMS			教員名 Instructor	高見沢 秀幸(商学)		
学期 Semester	冬 (Winter)	曜日・時限 Day・Period	金 (Fri) 2	単位 Credit	2	科目区分 Course Category	商学研究科(研究者養成)

[授業概要 (Course Overview)] 最終更新日:2011-06-07
 資産価格決定モデルについて、理論的な導出方法と実データによる推定方法の両方を講義する。特に焦点を当てるモデルとしては、線形ファクターモデル、消費CAPM、金利期間構造モデル。

[学部・学年の指定 (Who Should Attend)]
 ※履修ルール上の指定内容については必ずルールブックおよびガイドブックの該当箇所を確認して下さい。

[授業の目的・到達目標と方法 (Goals & Methodology)] 最終更新日:2011-06-07
 モデルの導出過程を理解するとともに、統計ソフトを用いて実際にモデルの推定を行えるようになること。

[授業の内容・計画 (Topics / Schedule)] 最終更新日:2011-06-07
 講義の概要は以下の通り。
 (1) プライシングカーネルと無裁定
 (2) 線形ファクターモデル
 (3) 消費CAPM
 (4) プライシングカーネルとファクターモデル
 (5) 金利期間構造モデル
 (6) 信用リスク

[テキスト・参考文献 (Textbooks / References)] 最終更新日:2011-06-07
 主に以下のテキストの第8～14章を講義する予定。

Singleton, K. J., Empirical Dynamic Asset Pricing Models, Princeton University Press, 2006

[他の授業科目との関連・教育課程の中での位置付け (Relation with other Courses)]

[成績評価の方法 (Requirements & Grading Allocation)] 最終更新日:2011-06-07
 試験(70%)、課題(30%)の総合評価。

[成績評価基準の内容 (Grading Criteria)] 最終更新日:2011-06-07
 理論を理解して基本的な計算ができること(→試験で評価)、及び統計ソフトを用いて簡単な分析ができること(→課題で評価)を到達目標とする。

[受講生に対するメッセージ (Message to Students)]

[その他 (Additional Information)]