

“新”通信テキスト(2次レベル)販売案内

1.販売価格

2次レベル		受講者	検定会員
1冊販売		1,100円	1,300円
全冊定期販売	証券分析とポートフォリオ・マネジメント 全冊(11冊)	10,000円	12,500円
	コーポレート・ファイナンスと企業分析 全冊(7冊)	6,300円	8,000円
	市場と経済の分析 全冊(6冊)	5,400円	7,000円

2. 通信テキストタイトル・執筆者

(1)証券分析とポートフォリオ・マネジメント

テキストタイトル	執筆者(敬称略)	発行
①計量分析と統計学(2)	小林孝雄(青山学院大学)、本多俊毅(一橋大学)	8月
②株式ポートフォリオ戦略	大野 三郎(アムレディ・ジャパン)	8月
③債券ポートフォリオ戦略	新井 富雄(東京大学)、太田 智之(野村證券)	8月
④デリバティブと投資戦略	大橋 和彦(一橋大学)	10月
⑤投資政策	小林 弘明(三井住友アセットマネジメント)	10月
⑥アセット・アロケーション	浅野 幸弘(横浜国立大学)	10月
⑦オルタナティブ投資	宮井 博(日興フィナンシャルインテリジェンス)、加藤えり子(住信基礎研究所)、大橋 和彦(一橋大学)、高橋 文郎(青山学院大学)、四塚 利樹(早稲田大学)	12月
⑧国際証券投資	諏訪部 貴嗣(ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント)	12月
⑨投資パフォーマンスの測定と評価	栗原 洋(新日本有限責任監査法人)、藤林 宏(住友信託銀行)、後藤 浩(アライアンス・パートナーズ)	12月
⑩信用リスクモデル	森平 爽一郎(早稲田大学)	2月
⑪行動ファイナンス	小幡 績(慶應義塾大学)	2月

(2)コーポレート・ファイナンスと企業分析

テキストタイトル	執筆者(敬称略)	発行
コーポレート・ファイナンス(1)	高橋 文郎(青山学院大学)、新井 富雄(東京大学)	8月
コーポレート・ファイナンス(2)	高橋 文郎(青山学院大学)	8月
コーポレート・ファイナンス(3)	鈴木 一功(中央大学)、高橋 文郎(青山学院大学)、芹田 敏夫(青山学院大学)、谷川 寧彦(早稲田大学)	10月
④財務会計をめぐる諸問題	秋葉 賢一(早稲田大学)	12月
⑤IFRSの財務諸表	辻山 栄子(早稲田大学)、山下 奨(跡見学園女子大学)	12月
⑥企業分析に係る諸問題	鈴木 一功(中央大学)、白田 佳子(筑波大学)、八重倉 孝(法政大学)	2月
⑦企業分析(ケース)		2月

(3)市場と経済の分析

テキストタイトル	執筆者(敬称略)	発行
①ファイナンスのためのミクロ経済学(2)	柳川 範之(東京大学)	8月
②国際マクロ経済学	小川 英治(一橋大学)	8月
③日本の証券・金融市場	梅田 雅信(首都大学東京)、宇野 淳(早稲田大学)	10月
④経済動向予測と金利予測	小峰 隆夫(法政大学)	12月
⑤日本経済・金融の諸問題	齋藤 潤(内閣府)	2月
⑥国際経済・金融の諸問題	大野 英昭(日本銀行)、高橋 亘(同左)	2月

第2次 通信テキスト目次

証券分析とポートフォリオ・マネジメント

第1回	計量分析と統計学(2)
第1章	パラメーターの推定
第2章	仮説検定
第3章	重回帰分析
第4章	主成分分析と因子分析
	数学補論(線形代数)
第2回	株式ポートフォリオ戦略
第1章	株式ポートフォリオ・マネジメントの基本
第2章	ファクター・モデル
第3章	パッシブ運用
第4章	アクティブ運用—銘柄選択
第5章	アクティブ運用—ポートフォリオ戦略
第6章	売買執行のリスクとコスト
第3回	債券ポートフォリオ戦略
第1章	利回りと価格変動
第2章	金利の期間構造
第3章	オプション内蔵型債券・証券化証券等の分析
第3章	債券ポートフォリオ投資戦略
第4回	デリバティブと投資戦略
第1章	金利および通貨の先渡・先物契約
第2章	スワップ取引
第3章	金利および通貨のオプション系デリバティブ
第4章	株価指数先物の投資戦略への応用
第5章	株価指数オプションの投資戦略への応用
第6章	金利・通貨デリバティブの投資戦略への応用
第7章	デリバティブに関する発展した話題
第5回	投資政策—プロセスと実行
第1章	総論
第2章	企業年金の投資政策
第3章	年金ALMとリスク・バジェットティング
第4章	個人投資家の投資政策
第6回	アセット・アロケーション
第1章	アセット・アロケーションの概要
第2章	ポリシー・アセット・アロケーション
第3章	タクティカル・アセット・アロケーション
第4章	ダイナミック・アセット・アロケーション
第5章	長期投資とアセット・アロケーション
第7回	オルタナティブ投資
第1章	オルタナティブ投資の概念とポートフォリオにおける活用
第2章	不動産投資
第3章	プライベート・エクイティ
第4章	ヘッジファンド
第5章	商品投資
第8回	国際証券投資
第1章	国際証券市場の概観
第2章	国際証券投資と為替
第3章	国際証券投資の理論と現実の乖離
第4章	国際証券投資と投資政策
第9回	投資パフォーマンスの測定と評価

- 序章 パフォーマンス評価の意義と目的
- 第1章 投資パフォーマンスの測定
- 第2章 投資パフォーマンスの分析
- 第3章 パフォーマンス評価の目的と留意点
- 第4章 パフォーマンス評価の実際
- 第5章 マネジャー評価
- 第6章 投資パフォーマンス基準

第10回 信用リスクモデル

- 第1章 信用リスクとは
- 第2章 デフォルトリスクのある資産の評価
- 第3章 デフォルト確率PD(1)の推定
- 第4章 回収率(PR)とデフォルト時損失(LGD)
- 第5章 同時デフォルト確率(JPD)とデフォルト相関(R)
- 第6章 ポートフォリオの信用リスク
- 第7章 信用リスク・デリバティブ

第11回 行動ファイナンス

- 第1章 行動ファイナンスとは何か
- 第2章 現代ファイナンス対行動ファイナンス
- 第3章 裁定取引の限界(Limited Arbitrage)
- 第4章 投資家のバイアスの諸形態
- 第5章 投資家機運(Investor Sentiment)
- 第6章 市場価格の歪み: システマティックなファンダメンタルズからの乖離
- 第7章 右下がりの需要曲線
- 第8章 行動企業金融(Behavioral Corporate Finance)

コーポレート・ファイナンスと企業分析

第1回 コーポレート・ファイナンス(1)

- 序章 コーポレート・ファイナンスの学習目的
- 第1章 企業の目的とファイナンシャル・マネジャーの役割
- 第2章 投資決定
- 第3章 資本コスト
- 第4章 企業の資金調達

第2回 コーポレート・ファイナンス(2)

- 第1章 資本構成と企業価値
- 第2章 配当政策と自社株買い
- 第3章 企業価値・株式価値の評価

第3回 コーポレート・ファイナンス(3)

- 第1章 企業の合併・買収(M&A)
- 第2章 財務のリストラクチャリング
- 第3章 企業のリスク・マネジメント
- 第4章 オプションとコーポレート・ファイナンス

第4回 財務会計をめぐる諸問題

- 第1章 退職給付の会計・開示
- 第2章 税効果会計
- 第3章 企業再編の会計
- 第4章 連結の会計
- 第5章 デリバティブとヘッジ会計
- 第6章 外貨換算会計
- 第7章 1株当たり当期純利益

第5回 IFRSの財務諸表

- 第1章 IFRSの沿革
- 第2章 IFRSを取り巻く国際的な動向
- 第3章 IFRSにおける財務諸表
- 第4章 IFRSにおける会計諸基準

第6回 企業分析に係る諸問題

- 第1章 企業価値評価モデル利用と業績予測の実際
- 第2章 信用リスク分析における財務諸表利用の注意点
- 第3章 会計情報と資本市場(実証分析)

第7回 企業分析(ケース)

市場と経済の分析

第1回 ファイナンスのためのミクロ経済学(2)

- 第1章 はじめに
- 第2章 ゲーム理論－戦略的行動の理論
- 第3章 情報の経済学

第2回 国際マクロ経済学

- 第1章 はじめに
- 第2章 マンデル＝フレミング・モデル
- 第3章 2国モデル
- 第4章 2期間モデル

第3回 日本の証券・金融市場

- 第1章 はじめに
- 第2章 日本の金融資本市場
- 第3章 日本の金融政策
- 第4章 証券市場政策と価格形成

第4回 経済動向予測と金利予測

- 第1章 経済動向予測の種類と景気の基本な姿
- 第2章 経済動向予測のポイント
- 第3章 経済動向予測の手法
- 第4章 金利予測

第5回 日本経済・金融の諸問題

- 第1章 世界的な金融・経済危機
- 第2章 2008年初以降の景気動向
- 第3章 金融政策の効果と金融システムの課題
- 第4章 長期的な経済成長の展望と課題
- 第5章 持続可能な財政への課題

第6回 国際経済・金融の諸問題

- 第1章 国際金融フォーラムと世界経済の見通し
- 第2章 国際的な金融危機の発生と世界経済
- 第3章 重要性を増す中国経済の歩み
- 第4章 アジアへの資金フローの変化と債券市場育成