

バリューファクターとの正しい向き合い方

Rob Arnott／Campbell Harvey／
Vitali Kalesnik／Juhani Linnainmaa (著)
田村 徳崇 CMA／安藤 航平 CMA (訳)

目 次

- | | |
|------------------------|----------------------|
| 1. はじめに | 4. ファクター間の相関 |
| 2. 期待通りにならないファクタープレミアム | 5. ファクター投資は過去のもののなのか |
| 3. ファクターリターンの非正規性 | 6. 最後に |



Rob Arnott

Research Affiliates, LLCパートナー／会長。1977年カリフォルニア大学サンタバーバラ校卒業。2002年にResearch Affiliatesを設立し、2018年までチェアマン／CEOを歴任。これまで130以上の論文を執筆、2002年から2006年までFinancial Analysts Journal編集長。Graham and Dodd賞を7度受賞、Bernstein Fabozzi／Jacobs Levy賞を4度受賞。



Campbell Harvey

Research Affiliates, LLCパートナー／シニアアドバイザー、デューク大学フュークアビジネススクール ファイナンス教授。



Vitali Kalesnik

Research Affiliates Global Advisors Limited. パートナー／リサーチディレクター（欧州）。



Juhani Linnainmaa

Research Affiliates, LLCパートナー／アドバイザー、ダートマス大学タックビジネススクール ファイナンス教授。



田村 徳崇（たむら のりたか）

野村アセットマネジメント(株) 運用部インデックス&ソリューションズグループ シニア・ポートフォリオマネジャー。



安藤 航平（あんどう こうへい）

野村アセットマネジメント(株) 運用部インデックス&ソリューションズグループ ポートフォリオマネジャー。