

目次

|                  |   |                       |    |
|------------------|---|-----------------------|----|
| 特 集              | クオンツ — 現状と展望  |                       |    |
|                  | システマティック ポートフォリオ運用<br>——変革、現状、将来の方向——                           | James L. Farrell, Jr. | 1  |
|                  | クオンツ・モデルの評価について<br>——モデル設計者、コンサルタント、および<br>顧客のための評価方法のフレームワーク—— | Anne Cabot            | 11 |
|                  | 和製クオンツの現状と将来<br>——米国からの教訓——                                     | 坂口 雄作                 | 27 |
|                  | 証券分析用語解説 (2)  |                       | 37 |
| 随 想              | 30年ぶりの海外での正月<br>——バブル崩壊と会計基準——                                  | 白鳥 栄一                 | 40 |
| 証券アナリスト<br>読 書 室 | 三國陽夫著「市場に聞く！ 日本経済・金融の変革」  | 井手 正介                 | 43 |
|                  | モートン S. バラツ著／伊藤忠商事(株)為替証券部訳<br>「商品ファンドの基礎と投資戦略」                 | 中島 努                  | 45 |
| 新 刊 紹 介          |   |                       | 47 |
| 編 集 後 記          |   |                       | 54 |
| 企 業              |   | 別冊付録                  |    |