

第2回 ベストミックス・ストラテジー・ミーティング

(同ミーティングは基本的な学習をする場であり、また各種ストラテジーをご紹介するミーティングです)

7月11日(水):会場:JPアクチュアリーコンサルティング会議室

東京都千代田区有楽町 1-10-1 有楽町ビル 6F

13:10	開場
13:30	開演ご挨拶:古川千春 (弊社代表取締役社長 CEO&CMO)
13:40	講座名:ロング・ショート戦略の基礎知識 <ul style="list-style-type: none">◆ ロング・ショート戦略の基本的な仕組みを解説します。◆ 運用担当者が、他者に説明できるよう基本的知識を身につけることを目指します。 講師:吉越昌治 (弊社取締役会長) <p><プロフィール></p> <p>1970年センチュリ・リサーチ・センター(株)(現、伊藤忠テクノソリューションズ)入社。1984年日興証券に転職し、投資工学研究所システム工学研究部長、投資工学研究所所長、投資信託部長、投資信託本部副本部長などを歴任後、日興アセットマネジメント専務取締役、グローバルラップ・コンサルティング・グループ(現日興グローバルラップ)代表取締役会長等の要職に従事後、2008年引退。2009年グッドバンカー(株)顧問。2011年10月ベストミックス・インベストメント(株)設立発起人となり現在に至る。日本証券アナリスト協会検定会員</p>
14:40	休憩
15:00	講座名:スイス市場に上場している『GAM社』について <ul style="list-style-type: none">◆ 1983年に設立されたGAM(Global Asset Management)について説明します。◆ 世界10カ国に千名を抱え運用資産10兆円強、約60戦略を提供し、特有のパフォーマンス追及型の運用文化を持つGAM社とは。 講師:古川千春 (弊社代表取締役社長 CEO & CMO) <p><プロフィール></p> <p>日興証券にて国内営業、法人営業、海外営業、厚生省担当、営業企画部に従事。9年間滞在した日興ヨーロッパPLCでは英国年金や運用会社への営業を担当。99年にプライス・ウォーターハウスクーパーズ・コンサルティングに転職し年金福利厚生部門本部長。2000年にモルガン・スタンレーに招聘される。モルガン・スタンレー・アセット・マネジメント(株)取締役チーフ・マーケティング・オフィサー兼投資顧問部長を最後に、2011年8月モルガン・スタンレーを引退。2011年秋、ベストミックス・インベストメントを創業。米国労働省調査レポートを「401k その手数料と費用」と題し、東洋経済新報社から共訳出版(98年)。我が国に米国報酬体系を日本語で紹介した。</p>
15:40	講座名:GAM社の『エマージング債券・通貨のロング・ショート戦略』について <ul style="list-style-type: none">◆ 同社のマクロ・ビューによれば、『今後10年間は債務問題がグローバル経済を支配し、エマージング市場はその問題を回避する正しい選択』としている。◆ また同社のエコノミストの分析によれば、『欧州の銀行はレバレッジの解消が必要』とし、『つまり、エマージング市場は売りだ』としている。◆ 残高2000億円以上の同戦略とは、どのような投資戦略なのかを解説します。 講師:佐藤紀昭 (弊社取締役 チーフ・インベストメント・オフィサー) <p><プロフィール></p> <p>日本ユニシスから日興証券に転職。日興国際投資顧問(現日興アセットマネジメント)やウェルズファーゴ日興投資顧問(後のBGI)でクオンツ系ファンド・マネージャー。日興証券にて年金資産用アセット・ミックスを分析するSATOモデル開発。また、代替資産商品部部長や投資運用部長として、主にヘッジ・ファンドで数千億円の自己ポジションの運用を担い、海外のヘッジ・ファンド会社多数にパイプを持つ。アセットマネジメント本部にて海外ファンドの調査やデューデリを担当。2011年9月末同社退職。中小企業診断士。日本証券アナリスト協会検定会員。 (*GAM社からゲスト・スピーカーを招聘する予定です)</p>
16:40	終了