

講義の予定(4回目以降)

【キーワードで確認】

- (1) 効率的市場仮説
- (2) 期待効用仮説
 - ⇒ 期待値と分散(標準偏差)
- (3) 分散投資によるリスク低減
 - ⇒ 相関係数
- (4) 分離定理…MPT
- (5) 等質期待仮定と市場均衡…CAPM