

先着
40名

Trends Everywhere

目
要

This talk discusses the latest research on trend-following investing. Professor Pedersen will introduce a systematic trend-following strategy called time-series momentum. This strategy has performed well over the past century and helps explain the returns to managed futures funds. His latest research on this topic provides new out-of-sample evidence on trend-following investing by studying its performance for 82 securities not previously examined and 16 long-short equity factors. The research also examines the co-movement of trends across asset classes and factors, the performance during different market environments, and discusses the implications for investors.

講
演
者

Lasse Heje Pedersen, Ph.D. (ラッセ・ペデルセン)
Principal, AQR Capital Management
Professor, Copenhagen Business School
Professor, Stern School of Business, New York University

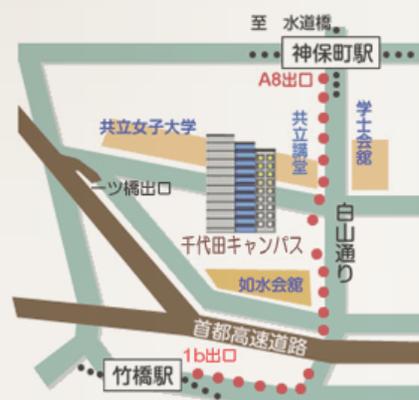


報告者近著

ラッセ・ペデルセン (Lasse Pedersen) は AQR Capital Management のプリンシパルとしてグローバル運用戦略のリーサーを主導している。コペンハーゲン・ビジネススクールとニューヨーク大学スターン・スクール・オブ・ビジネスのファイナンス教授でもある。米国ファイナンス学会のディレクター、NASDAQ OMX および FTSE の経済顧問委員会の委員、ニューヨーク連邦準備銀行の政策パネルのメンバーも務めた。40 歳以下で最も優れた欧州のエコノミストに与えられる Bernácer Prize、金融政策・ファイナンスにおける the Banque de France-TSE Prize、45 歳以下の優秀な研究者に与えられる Elite Research Prize の受賞者である。ラッセの研究は主要論文誌に掲載され、世界の中央銀行リーダーによって引用されている。Journal of Finance など複数の論文誌の編集委員のほか、National Bureau of Economic Research (全米経済研究所) と Center for Economic Policy Research (アメリカ経済政策研究センター) のリーサー・アソシエイトも務めた。著書に "Efficiently Inefficient: How Smart Money Invests and Market Prices are Determined" (邦題: ヘッジファンドのアクティブ運用戦略—効率的に非効率な市場) がある。コペンハーゲン大学で数学と経済の学士号と修士号、スタンフォード大学で経済学博士号を取得。

日
時
場
所

2019 年
4 月 18 日 (木)
11:20-13:00
一橋講堂 1 階 大講義室



〈Program〉

- 11:20 伊藤彰敏教授 挨拶
一橋大学経営管理研究科金融戦略・経営財務プログラムディレクター
- 11:25 ラッセ・ペデルセン教授 講演
- 12:55 閉会の辞
- 13:00 閉室

【電車でのアクセス】

- 東京メトロ 半蔵門線 / 都営地下鉄 三田線
都営地下鉄 新宿線
神保町駅 A8 出口 徒歩 3 分
- 東京メトロ 東西線
竹橋駅 1b 出口 徒歩 4 分

【住所】

一橋講堂
東京都千代田区一ツ橋 2-1-2
<http://www.hit-u.ac.jp/hall/accessjp.html>

申
し
込
み

〈申し込み〉
下記、フォームよりお申込みください。
定員になり次第締め切らせていただきます。
<https://goo.gl/forms/godc9dR1851xIYZY2>

または、一橋大学HPより

一橋大学 金融

検索