

《金曜セミナー》 リスクマネジメント入門Ⅱ ーVaR とストレステスト、シナリオ分析ー

日 時

2012年6月15日(金)・22日(金)
18:30~20:40 (受付開始18:00)

会 場

法政大学 新一口坂校舎 501 会議室
(東京都千代田区九段北3-3-9)
市ヶ谷駅 (JR、有楽町線、南北線、都営新宿線) 徒歩 10 分
飯田橋駅 (JR、東西線、有楽町線、南北線、都営大江戸線) 徒歩 10 分
九段下駅 (東西線、半蔵門線、都営新宿線) 徒歩 15 分

概 要

本研修会は金曜セミナー「リスクマネジメント入門」の第2回目です。連続して受講する(全5回10日間)ことをお勧めしますが、単独での受講も可能です。

第2回目は、各種VaR計測手法を紹介し、それぞれの前提・制約の理解を促すとともに、VaRの限界を踏まえたストレステスト、シナリオ分析の実施方法、リスク計量化手法の監査のポイントなどリスクマネジメントや監査に求められる重要事項を分かりやすく解説します。

4月11日開催のリスク計量化入門の午後の講義と基本的に同じ内容です。比較的少人数による講義とし、質疑応答の時間も多くとって完全理解を目指します。

参加対象

リスク管理部門、監査部門に配属されて経験の浅い方、MIS など関連するシステム開発に携わる方など、初心者の方を対象とします。

参加費用

会員/賛助登録して頂いた方は、初めて受講する研修セミナーの参加費用を無料とします。

会員 年会費/年賛助金 10,000 円 参加費用 初回無料、2 回目以降 5,000 円
非会員 参加費用 毎回 10,000 円
※金曜セミナーは、2 日間の受講で、参加費用は 1 回分となります。

プログラム

講師 FFR+代表 碓井茂樹 (日本銀行金融高度化センター)

(6月15日)

I. VaRの計測と検証

- ・VaR の計測手法 (分散共分散法、MS法、ヒストリカル法)
- ・各手法を適用するうえでの留意点

II. VaRの検証

- ・バックテストによる検証

(6月22日)

III. ストレステスト、シナリオ分析

- ・VaR の限界
- ・フォワードルッキングなストレステスト、シナリオ分析

IV. 内部監査のポイント

- ・リスク計測手法と監査ポイント

受講証明

CIA、CFSA、CCSA、CFE 等に係る CPE 申請のための受講証明を発行します (5CPE)
※金曜セミナーは、2 日間受講した方のみ、CPE の対象となります。

申し込み

協会ホームページよりお申し込みください。
https://ifra.jp/seminar_info/index.html