

《イブニングセミナー》リスク計量化入門Ⅱ ーVaRとストレステスト、シナリオ分析ー

日時 2013年7月16日(火)・17日(水)
18:30～20:40 (受付開始18:00)

会場 麗澤大学 東京研究センター
東京都新宿区西新宿6-5-1 新宿アイランドタワー4階
西新宿駅(丸の内線直結)、都庁前駅(大江戸線、徒歩5分)
新宿駅(JR、徒歩10分)

概要

イブニングセミナー「リスク計量化入門Ⅰ」では、統計・確率の基礎を中心にVaRに関する理解を深めるための基礎知識について講義します。5月1日開催の「リスク計量化入門」の午前中の講義と基本的に同じ内容です。

イブニングセミナー「リスク計量化入門Ⅱ」では、VaRの計測手法と、VaRを補完するストレステストの実践、内部監査のポイントなどを講義します。5月1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。

「リスク計量化入門Ⅰ、Ⅱ」で完結する内容です。双方の受講を推奨します。イブニングセミナーでは、比較的少人数による講義として、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
※イブニングセミナーは2日間で完結します。2日間の受講で参加費用は1回分です。

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)

(7月16日)

I. VaRの計測

- ・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

(7月17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Ⅲ.

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)
※イブニングセミナーは、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