

リスク計量化入門

—VaR とストレステスト、シナリオ分析—

日 時

2014年 6月26日 (木)
9:30~17:00 (受付開始9:00)

会 場

法政大学 新一口坂校舎 501 教室 (東京都千代田区九段北3-3-9)
<http://www.im.i.hosei.ac.jp/contact/access/>
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

概 要

本研修会では、確率・統計からはじめ、VaR などリスク計量化技法に関する基礎知識を整理するとともに、VaR の限界を補完するため、どのようなストレステスト、シナリオ分析を実施すべきかなどリスクマネジメント実務上の留意点を分かりやすく解説します。そして、高度なリスク計量化技法を活用したリスクマネジメントの有効性を監査する際のポイントについて考えることを目的としています。

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役員、管理者、実務担当者の方、とくに、統計・確率、リスク計量化技法に初めて接する方、理論的な背景を身につけてリスク管理や監査実務に役立てたいと考えている方、MIS など関連するシステム開発に携わる方を対象としています。

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

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)

- I. イントロダクション
 - ・リスクの計量化・VaR(Value at Risk)の概念・活用事例
- II. 統計・確率の基礎知識
 - ・基本統計量 (平均・分散・標準偏差・パーセント点・共分散・相関係数)
 - ・確率変数と確率分布
 - ・推定と検定
- III. VaR の計測と検証
 - ・VaR 計測手法 (分散共分散法、MS 法、ヒストリカル法)
 - ・バックテストによる検証方法
- IV. ストレステスト、シナリオ分析の実施
 - ・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
- V. 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 (7CPE)

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