

## 理論と実践 市場リスクマネジメント

## 日時

2014年 7月17日(木)  
9:30~17:00 (受付開始9:00)

## 会場

法政大学 新一口坂校舎(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  
九段下駅(東西線、半蔵門線、都営新宿線) 徒歩15分

## 概要

本研修会では、市場リスクの把握と管理(VaRとストレステスト)、市場・流動性リスク管理態勢の整備に係る理論と実践を学ぶとともに内部監査のポイントを考えることを目的とします。

## 参加対象

経営マネジメント層やリスク管理部門、内部監査部門、システム管理部門の方など、幅広い層の参加を想定しています。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

## プログラム

- 09:30~12:00 市場リスクの把握と管理  
— 現在価値、BPV、GPS、VaR、ストレステスト  
FFR+代表 碓井 茂樹氏  
(日本銀行金融高度化センター)
- 13:00~14:20 【事例紹介】市場リスク管理の高度化  
— ストレステストの実践を中心に  
三井住友信託銀行 リスク統括部  
マーケットリスク統括グループ長  
多良 康彦氏
- 14:30~15:50 市場リスク管理態勢の整備
- 16:00~17:00 流動性リスク管理態勢の整備  
— 組織体制、経営陣・各部門の役割  
FFR+代表 碓井 茂樹氏  
(日本銀行金融高度化センター)

## 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](https://ifra.jp/seminar_info/index.html)