

リスクマネジメント入門 I

—VaR とストレステスト、シナリオ分析—

日 時

2016年 8月 4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

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

新任の実務担当者から役員まで、社外取締役・社外監査役の方にも強くお勧めします。
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たいと考えている方に最適です。

参加費用

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
金融機関の社外役員(個人会員)には すべてのセミナーを無料で提供します。

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)
- 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