

リスクマネジメント入門2

— VaR とストレステスト、シナリオ分析 —

日 時

2018年 5月 2日 (水)
14:00~17:00 (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、リスク計量化技法に関する基礎知識を学びます。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。

リスクマネジメント入門1で学ぶ統計・確率の基礎知識があることが本研修会を受講する前提になります。統計・確率の基礎知識に自信のない方は、必ずリスクマネジメント入門1を受講してください。

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/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. 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

II. 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

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 (3CPE)

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