

《土曜セミナー》
初心者のための
リスク計量化入門 I

一 統計・確率の基礎からVaRを学ぶ

2011年
10月8日(土)
午前12時30分
～午後17時00分
TGIFS (JAビル8階)
大手町駅 C2b出口 直結

概要	<p>本研修会は、土曜セミナー「初心者のためのリスク計量化入門」(全2回)のうちの第1回目です。2回を連続して受講することをお勧めしますが、単独での受講も可能です。</p> <p>第1回目は、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知識を整理します。</p> <p>第2回目は、各種VaR計測手法を紹介し、それぞれの前提・制約の理解を促すとともに、VaRの限界を踏まえたストレステスト、シナリオ分析の実施方法、リスク計量化手法の監査のポイントなど、リスクマネジメントや監査に求められる重要事項を分かりやすく解説します。</p> <p>比較的少人数による講義とし、質疑応答の時間も多くとって、完全理解を目指します。</p>
日時	2011年10月8日(土) 12:30~17:00 (受付開始 12:00)
会場	TGI フィナンシャルソリューションズ セミナールーム 東京都千代田区大手町一丁目3-1 JAビル8階 大手町駅 C2b出口直結(千代田線、丸の内線、半蔵門線、東西線、三田線)
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
参加費用	会員 5,000円 非会員 10,000円 ※ <u>会員登録(年会費10,000円)して頂いた方は初めて受講する研修セミナーの受講費用を無料とします。2回目以降は会員価格(5,000円/1日)で受講可能です。</u>
講師	FFR+代表(日本銀行金融高度化センター) 碓井 茂樹 CIA, CCSA, CFSA
プログラム	<p>12:30~13:40 リスクの計量化とは ・VaR(Value at Risk)の概念、活用事例 (質疑応答)</p> <p>13:50~16:20 統計・確率の基礎知識 ・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 (質疑応答)</p> <p>16:30~17:00 VaRの計測と検証 一次回講義の紹介 ・VaRの公式(分散・共分散法) ・バックテスト (質疑応答)</p>
申込み	お申込みの受付開始は、7月下旬を予定しています。
備考	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(5 CPE)。