

《土曜セミナー》  
初心者のための  
リスク計量化入門Ⅱ

ーVaRとストレステスト、シナリオ分析

2011年  
10月15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>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2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15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	<p>会員 5,000円 非会員 10,000円</p> <p>※<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></p>
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>12:30～14:40 VaRの計測と検証</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・VaR の計測手法(分散共分散法、MS法、ヒストリカル法)</li> <li>・各手法を適用するうえでの留意点</li> <li>・バックテストによるVaR検証方法</li> </ul> <p>(質疑応答)</p> <p>14:50～15:50 VaRの限界とストレステスト、シナリオ分析</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・VaR の限界</li> <li>・フォワードルッキングなストレステスト、シナリオ分析</li> </ul> <p>(質疑応答)</p> <p>16:00～17:00 内部監査のポイント</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・リスク管理機能と監査機能の役割</li> <li>・監査実施のポイント</li> </ul> <p>(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)。