

## 《イブニングセミナー》リスク計量化入門Ⅰ ー確率・統計の基礎から VaR を学ぶー

日 時

2013年7月2日(火)・3日(水)  
18:30~20:40 (受付開始18:00)

会 場

麗澤大学 東京研究センター  
東京都新宿区西新宿 6-5-1 新宿アイランドタワー4階  
西新宿駅(丸の内線直結)、都庁前駅(大江戸線、徒歩5分)  
新宿駅(JR、徒歩10分)

概 要

イブニングセミナー「リスク計量化入門Ⅰ」では、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基礎知識について講義します。5月1日開催の「リスク計量化入門」の午前中の講義と基本的に同じ内容です。

イブニングセミナー「リスク計量化入門Ⅱ」では、VaRの計測手法と、VaRを補完するストレステストの実践、内部監査のポイントなどを講義します。5月1日開催の「リスク計量化入門」の午後の講義と基本的に同じ内容です。

「リスク計量化入門Ⅰ、Ⅱ」で完結する内容です。双方の受講を推奨します。イブニングセミナーでは、比較的少人数による講義として、質疑応答の時間も多くとって、完全理解を目指します。

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方、MIS など関連する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

※イブニングセミナーは2日間で完結します。2日間の受講で参加費用は1回分です。

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)

(7月2日)

- I. リスクの計量化とは
  - ・ VaR(Value at Risk)の概念
  - ・ 簡単な設例
- II. VaRの活用事例

(7月3日)

- III. 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
- IV. VaRの計測と検証 一次回講義の紹介

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(5CPE)  
※イブニングセミナーは、2日間受講した方のみ、CPEの対象となります。

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)