

ストレステストの理論と実践

日時

2018年10月2日(火)

13:00~16:30 (受付開始12:30)

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

九段下駅(東西線、半蔵門線、都営新宿線) 徒歩15分

概要

本研修会では、大手金融機関に求められるストレステストに係る内外の状況を確認すると同時に、先進金融機関における足許のストレステスト高度化の方向性に関し、シナリオの作成部分と、テスト手法部分に分けた上で解説します。

参加対象

金融機関の取締役、執行役員、監査役、経営企画部門、リスク管理部門、内部監査部門の管理者・担当者を対象とします。

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

プログラム

第一部 金融機関に求められるストレステストに係る最近の動向

1. 最近の欧米における監督上のストレステストの特徴点
2. 金融機関におけるストレステスト高度化の状況と課題
3. 本邦における動き

第二部 フォワードルッキングなシナリオの具体的な作成方法

1. サイクリカルな経済事象に係るシナリオの作成
2. 構造的な経済・地政学事象に係るシナリオの作成
3. コンダクトリスク等非財務リスクに係るシナリオの作成

第三部 ストレステスト高度化への課題

1. モデリング手法の高度化
2. モデルリスクの管理
3. 経営とリスク管理の一体化の道具としてのストレステスト

講師 有限責任監査法人トーマツ/リスク管理戦略センター
パートナー・センター長 大山 剛氏

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