

リスクマネジメント入門1

— 統計確率の基礎知識 —

日時

2018年 5月 2日 (水)
9:30~13:00 (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、リスクマネジメントの基礎知識を整理します。
金融機関では、VaRなどリスク計量化技法が活用されるため、その理解には、統計・確率の知識が必要不可欠です。
初心者にも分かりやすく解説します。

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. イントロダクション

- ・リスクとは、リスクマネジメントとは
- ・リスクの計量化とは
- ・VaR (Value at Risk) の概念
- ・活用事例

II. 統計・確率の基礎知識

- ・基本統計量 (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

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 (7CPE)

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