

## 市場・流動性リスク管理の基礎

## — 国債・流動性危機への備えを点検する

日時

2013年9月13日(金)

10:00~16:30 (受付開始9:30)

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

国際的な金融緩和は相場変動を増幅し、市場・流動性リスクを高めました。本研修会では、市場・流動性リスクの把握と管理の基本事項を整理し、ストレステストと危機対応に焦点を当てて講義します。

参加対象

経営マネジメント層やリスク管理部門、内部監査部門、システム管理部門の方など、幅広い層の参加を想定しています。STEM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

プログラム

## I. 市場リスクの把握と管理

— 現在価値、BPV、GPS、VaRの計測方法

— 銀行勘定の金利VaR、アウトライヤー基準値

— ストレステストの活用: どのレベルの金利変動を想定するか

## II. 市場リスク管理態勢の整備

— 織体制、経営陣、リスク管理部門、フロント部門、バック部門、  
内部監査部門の役割

## III. 流動性リスク管理態勢の整備

— リスクプロファイルの把握、ストレステスト、危機管理態勢

講師 FFR+代表 碓井茂樹 氏(日本銀行金融高度化センター)

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(6CPE)

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)