

リスク管理のための 統計・確率入門

日 時

2018年 5月29日 (水)
12:30~17:00 (受付開始12:00)

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
九段下駅 (東西線、半蔵門線、都営新宿線) 徒歩15分

概 要

金融機関では、VaRなどリスク計量化技法が活用されています。その理解のためには、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5,000円 非会員15,000円
※会員/賛助登録(年会費15,000円/年賛助金1口10,000円、4口以上)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。
金融機関の社外役員(個人会員)にはすべてのセミナーを無料で提供します。

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)

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(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