

【 Excel 演習 パソコン貸与、サンプル・ファイルは持ち帰って使えます 】

# Excel で学ぶ信用リスク評価モデルと 内部格付けへの応用

～実務で最も活用されている統計モデルとその活用方法を3時間で習得～  
◇午前午後の両講座の同時お申し込みで午後の講座が29000円に割引となります◇

こばやし たけし

講師 **小林 武氏** 名古屋商科大学経済学部・同大学院マネジメント研究科 教授

日時 平成30年6月22日(金) 午後2時00分～午後5時00分

融資、リスク管理、監査、リスク管理系のシステム構築などに携わる方にとって、個別債務者の信用リスク評価は必須の知識となっています。しかしながら、信用リスク評価モデルは、一般に数理的に難易度の高い内容が多いため、消化不良に陥る傾向があります。

本セミナーでは、内外の金融機関で20年以上にわたる信用リスクの定量分析に携わってきた講師が、具体的事例を通じて信用リスク評価モデルのうちリスク管理の実務で最も活用されている統計モデルとその検証方法、および内部格付けへの活用方法を体系的に解説します。また、Excelの演習では、実際の企業の財務データを用いて、統計モデルの推定やモデルの検証などの実践的な演習を取り上げます。直感的なイメージに主眼をおき、理論の本質を理解できるように解説いたしますので、信用リスクに関する統計モデルを深く理解し、それをリスク管理の実務へどのように活用していくかを3時間で学ぶことができます。

金融機関でリスク管理業務、監査業務、リスク管理系のシステム構築に携わる方、金融リスク管理、リスク分析関係の知識を身につけたい方のお役に立てるようにわかりやすく説明いたします。

1. 信用リスク評価モデルの概要
  2. デフォルト判別分析
  3. デフォルト率推計モデル  
(2項ロジットモデル・順序ロジットモデル)
  4. デフォルト率推計モデルの検証
  5. 内部格付けへの活用方法
    - 推計デフォルト確率と行内格付とのマッピング
    - 外部格付けのマッピング
    - 定性要因の考慮
    - 実態財務諸表を使った信用リスク評価
    - 市場情報を使った格付補正など
- ～質疑応答～

【講師紹介】慶應義塾大学商学部卒。フランスグランゼコール HEC 経営大学院国際金融専攻修士課程修了。筑波大学大学院ビジネス科学研究科にて博士(経営学)号取得。20年以上にわたり、東京銀行、格付投資情報センター、パークレイズ・グローバル・インベスターズ、三菱UFJモルガンスタンレー証券、NSフィナンシャルマネジメントコンサルティング(新日鉄住金ソリューションズ子会社)にて企業評価、資産運用、リサーチ業務等に従事。2014年より名古屋商科大学および同大学院にて金融論、金融政策論、証券投資論、コーポレートファイナンス、マクロ経済学等の講義を担当。

※ 開催一週間前に受講者が定数に達していない場合は中止となる場合があります。お申込みはお早めどうぞ。

※ 録音・ビデオ撮影はご遠慮下さい。



開催日

平成30年6月22日(金)  
14:00~17:00

会場

茅場町・グリーンヒルビル  
金融財務研究会本社 セミナールーム

東京都中央区日本橋茅場町 1-10-8

TEL 03-5651-2030

地下鉄東西線・日比谷線 茅場町駅

6番出口より徒歩1分

(開場は開演の30分前です。)

参加費

1名につき34,200円

(消費税、参考資料を含む)

1社2名以上同時に参加お申込みいた

だいた場合、お2人目から1名につき29,000円。追加申込みの場合は

その旨ご記入下さい。

申込先

金融財務研究会 ホームページ <http://www.kinyu.co.jp/>

〒103-0025 東京都中央区日本橋茅場町 1-10-8 グリーンヒルビル

TEL 03-5651-2030 FAX 03-5695-8005

申込方法

ファックス又は郵便にて参加申込書をお送り下さい。上記ホームページの申込欄からもお申込いただけます。折り返し、受講証と請求書を郵送致します。参加費は下記の普通預金口座に開催日前日までにお振込み下さい。(但し経理の都合等で間に合わない場合は、ご連絡いただければお待ちいたします。)参加費の払戻しは致しませんので申し込まれた方がご都合の悪い時は代理の方がご出席下さい。又当日ご参加になれなかった場合、当社および経営調査研究会主催の他のセミナーに無料でご出席いただけます。(但し新しいセミナーの参加費との差額が2,000円以上の時は差額をお支払いいただきます。また、振替は1年以内にお願いたします。)ご記入いただきました個人情報は、当社および関係会社の受講者名簿の整備や今後開催されるセミナーのご案内等に使用します。

振込口座

普通預金 口座名 (株)金融財務研究会

三菱 UFJ 銀行 本店	1642356	三井住友銀行 本店営業部	7397637
三菱UFJ信託銀行 本店	2818151	みずほ銀行 東京営業部	1427715
三井住友信託銀行 本店営業部	2993982	りそな銀行 東京営業部	1693669

切らずにこのままお送り下さい

【Excel演習】Excelで学ぶ信用リスク評価  
モデルと内部格付けへの応用

6 / 2 2

参加申込書

FAX 03-5695-8005

平成30年 月 日

ご連絡・講師へのご質問等ご記入下さい	会社名	TEL FAX		
	所在地	E-Mail 〒		
	参加者ご氏名	部課名		
	〃	〃		
	〃	〃		
	〃	〃		
	書類送付先 *セミナーコート 1167 (Fin-301167)	ご担当者 (同上の場合記入不要) TEL	部課名 FAX	

お申込の翌日には「受講証・請求書」を発送しておりますが、お手元に届かない場合は、弊社までご連絡下さい。