

信用リスクのモデリング入門 (Python 編)

もりやひろゆき

講師

森谷博之氏

オックスフォードファイナンシャルエデュケーション
Director, MBA, MBA, MSc,

日時 2023年10月25日 (水) 午前9時30分~12時30分

■このセミナーは Zoom でご受講いただけます。お申し込み後に詳細をメールでお送りします。

信用リスクは市場リスクと流動性リスクとならぶ金融機関が直面する最重要なリスク指標のひとつです。さらに事業会社や商社も取引先や関係会社にさまざまな形の与信や信用保証を与えています。多様化が急速に進む世界では、予期せぬ出来事は以前よりも頻繁に発生しています。急速なデジタル化がもたらした最近の米国における中小金融機関の破綻はその最たるものです。多様な信用リスクを考慮しておく必要に迫られています。しかし、信用リスクを理解するためには、市場リスクを考えるととは異なる数理的な知識が必要とされます。

本セミナーではこのような多様な信用リスクを考慮するうえで必要となる基礎知識を養います。確率・統計学の基礎知識から始め、機械学習のひとつであるサポートベクターマシンに触れます。このように段階を踏んで必要な考え方を身につけて行くことで、実務で必要となる柔軟な考え方を養います。

第一部：確率・統計学の基礎

1. 確率・統計学入門：確率変数、確率関数、累積分布関数、ハザード関数など
2. オッズ比とロジスティック回帰モデル
3. ポアソン回帰モデルとポアソン過程

第二部：信用リスクとモデリング

4. 信用リスク入門：信用格付け、ハザードレート、デフォルト確率、強度、相関
5. ロジスティック回帰を用いたデフォルト確率の推定
6. サポートベクターマシンを用いた格付けの判別

■目標

多様な信用リスクのモデリングに必要な最低限の確率統計学の知識を身につけます。
多様化する世界において、柔軟に信用リスクに対処できる力を養います。

■受講対象者

信用リスクについて基礎知識を見につけたい、知見を広げたい、変化する環境に対処できる考え方を身につけたいなど信用リスクに興味をお持ちの方であればどなたでも参加可能です。

■PCには事前に Jupyter notebook がインストールされている必要があります。

参考文献：

統計学実践ワークブック (学術図書出版社)

フィナンシャルエンジニアリング by ジョンハル (きんざい)

Python3 ではじめるシステムトレード：判別分析

<https://qiita.com/innovation1005/items/816273b5706797116fb0>

【講師紹介】外資系金融機関にて債券運用、デリバティブのマーケットメイクを経験後独立。為替オーバーレイ、ファンドオフヘッジファンズを運用、総合商社と信託銀行に提供。早稲田大学で3年間、中央大学で10年間非常勤講師を務める。主な論文に”How does the entropy function explain the distribution of high frequency data” in Digital Designs for Money, Markets and Social Dilemmas (2022, Springer)。主な訳書「物理学者ウォール街を往く」(東洋経済新報社)。主な著書「Python3 ではじめるシステムトレード第2版」(パンローリング)。

※録音・録画はご遠慮下さい。

主催 金融財務研究会

<https://www.kinyu.co.jp>

Facebook : <https://www.facebook.com/keichoken>

Twitter : <https://twitter.com/keichoken05>

Blog : <https://www.kinyu.co.jp/blog/>



開催日

2023年10月25日(水)
9:30~12:30

本セミナーは Zoom で開催いたします。
インターネットに繋がるパソコンがあれば、どこでも受講できます。
原則として、参加費をお振込いただいた後に、メールで詳細をお送りいたします。

参加費

1名につき35,500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30,000円になります。追加申込みの場合はその旨をご記入
下さい。

申込先

金融財務研究会 ホームページ <https://www.kinyu.co.jp/>
〒103-0025 東京都中央区日本橋茅場町1-10-8 グリンヒルビル
TEL 03-5651-2030 FAX 03-5695-8005

申込方法

上記ホームページの申込欄からお申し込み下さい。参加申込書を FAX 又は郵送
いただいております。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。) クレジットカー
ドご利用の場合は、質問欄にその旨をご連絡下さい。参加費の払戻しは致しません
ので、当日ご参加になれない場合は、代理の方のご出席あるいは当社および金融財
務研究会主催の他のセミナーへのお振替をお願いします。(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(株)金融財務研究会の開催のために使用させていただきますが、漏洩などがない
よう最善の予防、是正に努めます。詳しくは弊社ホームページをご覧ください。

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

◇クレジットカードは Visa、Mastercard、American Express、JCB、Diners Club、
Discover がご利用いただけます。

----- 切らずにこのままお送り下さい -----

信用リスクのモデリング入門

参加申込書

FAX 03-5695-8005

【Zoom】 10 / 25

2023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		
		E-Mail		
弊社からのお知らせ、メルマガの送信を <input type="checkbox"/> 受信する <input type="checkbox"/> 受信しない クレジットカードをご利用の場合は下記に✓を入れて下さい。 <input type="checkbox"/> クレジットカード利用 セミナーコード 2003 (Fin-k232003)	所在地	〒		
	参加者ご氏名		部課名	
	〃		〃	
	〃		〃	
	〃		〃	
	書類送付先 (同上の場合記入不要)	ご担当者 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。