



(関係部門へご回覧ください)

金融機関行職員のための 統合リスク管理の実務入門

～個別リスクの計測手法、ストレステストを踏まえて～

統合リスク管理は、銀行、保険、証券等の業態や規模によらず、今や必須の経営管理手法となりました。

本セミナーでは、各個別のリスク計測手法にも触れつつ、統合リスク管理に求められる重要事項を、具体的事例を含めることにより実践的内容で分かりやすく解説します。

統合リスク管理フレームワークにおいて、リスク計測モデルの限界・弱点を補う観点から、またリーマンショック、欧州危機等により、その重要性が高まっているストレステストについても、十分な時間をとり基礎から解説を行います。

リスク管理部門(ALM管理部門も含む)、企画部門の役員、管理者、実務担当者の方を主な対象としますが、内部監査部門、システム部門など、関連部門の管理者、実務担当者の方や関連するシステム開発ベンダーの方も参加可能です。

開催日：2012年3月2日(金) 1日間

会場：ニッキンホール(東京・市ヶ谷)

監修、講師：

(敬称略)

あらた監査法人

リスク・コントロール・ソリューション部

代表社員・パートナー

石岡 秀之

シニアマネージャー

西原 立

シニアアソシエイト

養田 麻里子

CMC

Computer Based Management College

<http://www.nikkinn.co.jp/CMC/>

上記サイトからWebでの申し込みが出来ます

後援 一般社団法人 全国地方銀行協会

社団法人 第二地方銀行協会

社団法人 全国信用金庫協会

社団法人 全国信用組合中央協会

コースのねらい

金融機関の破綻事例等から、なぜ統合リスク管理が必要なのか、現在の金融機関を取り巻く環境を鑑みて、なぜ統合リスク管理が必要なのかといった統合リスク管理の必要性から始め、個別リスクの計測手法についても復習を行い、本セミナーの主題である統合リスク管理全般に展開していきます。

また、統合リスク管理と密接に関連する自己資本管理についても同時に解説するとともに、2008年のリーマンショック、現在進行中の欧州金融危機等により、その重要性が高まっているストレステストの現状と今後の方向性について確認し、さらに近年着目されているマクロ経済ストレステストの導入方法についても詳しく解説を行います。本コースを受講することにより、現在のリスク管理における主要なテーマである統合リスク管理及び自己資本管理の実務を行う上で必要となる基礎的知識の習得することを目標とします。

開催要綱

開催日：2012年 3月2日（金）1日間
時間：10:00～16:00（9:30 受付開始）
定員：40人（最少実施人員10人）
講師名：あらた監査法人

代表社員・パートナー 石岡 秀之 氏

シニアマネージャー 西原 立 氏

シニアアソシエイト 養田 麻里子 氏

会場：ニッキンホール（東京・市ヶ谷）

受講料：

- ・CMC会員価格 37,800円（本体価格 36,000円、消費税 1,800円）
 - ・後援協会会員機関 40,950円（本体価格 39,000円、消費税 1,950円）
 - ・CMC非会員価格 44,100円（本体価格 42,000円、消費税 2,100円）
- （昼食はこちらで用意いたします）

講師ご紹介欄です

石岡 秀之

株式会社第一勧業銀行入行、本店市場部門、米国現地法人にて金利デリバティブのトレーディング、研究開発及び商品開発業務に従事した後、1999年からPwC（プライスウォーターハウスクーパース）にて大手金融機関に対する金融リスク管理に関するアドバイザリー業務に従事する。現在、PwCのメンバーファームであるあらた監査法人リスク・コントロール・ソリューション部にて、金融リスク管理に関するアドバイザリー業務を統括する。東北大学理学部卒業、東北大学大学院理学研究科数学専攻修了

西原 立

プライスウォーターハウスクーパースコンサルタント株式会社入社、プライスウォーターハウスクーパース・フィナンシャル・アドバイザリー・サービス株式会社、中央青山監査法人金融部を経て、あらた監査法人入所。現在、リスク・コントロール・ソリューション部にて、金融リスク管理に関するアドバイザリー業務に従事する。京都大学理学部卒業、京都大学大学院人間環境学研究科修了

養田 麻里子

株式会社日本総合研究所、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社を経て、あらた監査法人入所。現在、リスク・コントロール・ソリューション部にて、金融機関に対する金融リスク管理に関するアドバイザリー業務に従事する。慶應義塾大学大学院理工学研究科数理学専攻修了、一橋大学大学院国際企業戦略研究科金融戦略コース専攻修了、公益社団法人日本証券アナリスト協会検定会員

統合リスク管理の実務入門 カリキュラム

午前 10:00~12:00 (9:30 受付開始)	午後 13:00~16:00
<p>1. 金融機関を取り巻く環境</p> <p>1.1 金融機関の破綻事例研究 (過去)</p> <p>1.2 金融機関を取り巻く環境 (現在)</p> <p>1.3 統合リスク管理に関する規制環境</p> <p>2. 統合リスク管理概論</p> <p>2.1 統合リスク管理とは ～ 全体的フレームワークの紹介</p> <p>2.2 統合リスク管理の必要性 ～ 1.を踏まえ統合リスク管理の金融機関経営における必要性、重要性の再確認</p> <p>2.3 統合リスク管理の高度化 (質疑応答)</p> <p>3 個別リスク計測手法概論 ～ 個別リスクの計測手法に関する再確認</p> <p>3.1 市場リスク</p> <p>3.2 信用リスク</p> <p>3.3 オペレーショナルリスク</p> <p>3.4 ALM リスク</p> <p>3.5 ビジネスリスク</p> <p>3.6 (保険リスク) (質疑応答)</p>	<p>4. 統合リスク管理詳説</p> <p>4.1 基本コンセプトの確認 (期待損失と非期待損失、リスク尺度、リスク保有期間、信頼水準、資本の種類、etc)</p> <p>4.2 リスク選好度</p> <p>4.3 リスク評価</p> <p>4.4 リスクの合算方法</p> <p>4.5 資本配賦</p> <p>4.6 リスクを勘案した収益性指標</p> <p>4.7 資本管理</p> <p>4.8 その他個別の論点 (質疑応答)</p> <p>5. ストレステスト詳説</p> <p>5.1 ストレステストの現状と今後の方向性</p> <p>5.2 マクロ経済ストレステスト</p> <p>5.3 フレームワークと実施手順</p> <p>5.4 定性的シナリオ</p> <p>5.5 定量的シナリオ</p> <p>5.6 インパクト分析</p> <p>5.7 分析結果の活用 (質疑応答)</p>

《 CMC におけるリスク関連セミナー 》 カッコ内は開催予定月です。

< 内部管理コース >

- ・ リスク計量化のための確率・統計の基礎 (7月、1月)
- ・ リスクマネジメント入門 (5月、10月)
- ・ オペレーショナルリスク管理とは (8月、2月)

< 銀行業務研修中級 >

- ・ 収益管理・リスク管理入門コース ~ ALMの基礎知識と課題、方向性 ~ (4月、10月)
- ・ 収益管理・リスク管理入門コース ~ 信用リスク編 ~ (6月、12月)
- ・ 収益管理・リスク管理入門コース ~ 市場リスク、オペレーショナルリスク、ALM統合リスク管理編 ~ (7月、1月)
- ・ 収益管理・リスク管理入門コース ~ 収益管理編 (11月)

102

第69回 リスクマネジメントセミナー

統合リスク管理の実務入門

～個別リスクの計測手法、ストレステストを踏まえて～

ホームページ用受講申込書（3月2日開講）

貴社名

所在地 〒

TEL

FAX

Eメール

	参加者氏名	所属（部・課・グループ）	役職

お申し込みいただきました方には、受講証・請求書・会場地図を郵送またはFAXいたします。

受講料 A：37,800円（本体価格 36,000円）

（CMC金融機関機械化研究会会員機関）

（CMC金融ニュービジネス&テクノロジー研究会会員機関）

B：40,950円（本体価格 39,000円）

（後援協会会員機関）

C：44,100円（本体価格 42,000円）

（非会員機関）

（昼食はご用意します）

お申し込み・お問い合わせは、

株式会社 CMC

TEL 03 - 3261 - 4550 FAX 03 - 3261 - 4570 まで。

注：振込先銀行

みずほ銀行 市ヶ谷支店 普通預金 1797042

（名義） 株式会社 CMC

振込予定日（できるだけご記入ください） 月 日

受講についてお願い

受講料は、できるだけセミナー開催日までにお振込み下さい。

銀行振込の場合は領収書を発行いたしません。

銀行振込に際しては、貴社名の前に請求書番号の下3桁（枝番数字）を付記してください。

振込手数料は貴社でご負担をお願い申し上げます。

開催日一週間以内の受講キャンセルの場合、受講料の払い戻しはいたしません。

講演中の録音・撮影ならびに携帯電話・パソコンの利用はご遠慮ください。

ホームページに提携ホテル一覧がございます。特別割引もございますので是非ご利用下さい。

諸般の事情により開催を中止させていただく場合がございます。

CMCのホームページからWebでの申し込みができます。