

(関係部門へご回覧ください)

オペレーショナルリスクにおける最新の規制と内部管理

オペレーショナルリスク管理は、あらゆる業務展開や業務運営の中で、今や不可欠の要素となっている。金融機関においては、金融検査マニュアルをはじめ、監督指針でもオペレーショナルリスクが明確に定義され、これを認識、評価し、適切なモニタリング、コントロールを図ることが求められる。また、オペレーショナルリスク相当額の計測にあたっては、パーゼル銀行監督委員会によってその手法の見直しが行われている（標準的手法の見直し）。

オペレーショナルリスクは、3つの防衛線によるリスク管理態勢の構築やコンダクトリスクの管理、リスク・アパタイト・フレームワーク（RAF）の構築ならびに実効的なリスク関連データの収集と報告（RDA：Risk Data Aggregation）といった、新たな要請とも関連が深く、オペレーショナルリスク管理担当者にはこうした知識も求められる。

本セミナーでは、オペレーショナルリスク管理のフレームワークや規制の動向に加え、3つの防衛線、コンダクトリスク、RAF、RDAなどの最新の情報についても紹介する。

開催日：2018年2月19日（月）0.5日間

会場：ニッキンホール（東京・市ヶ谷）

講師：（敬称略）

有限責任監査法人 トーマツ 金融インテグリティグループ
マネジャー 加瀬 鶴佳

主催：C M C

Computer Based Management College

<http://www.nikkin.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

一般社団法人 第二地方銀行協会

一般社団法人 全国信用金庫協会

一般社団法人 全国信用組合中央協会

オペレーショナルリスクにおける最新の規制と内部管理

カリキュラム 13:30~16:00 (13:00 受付開始)

I. オペレーショナルリスク管理の概要

1. オペレーショナルリスクの重要性
2. オペレーショナルリスク管理のフレームワークとツール

II. BIS 規制でのオペレーショナルリスク管理

1. バーゼルⅡにおけるオペレーショナルリスクの計測手法
2. オペレーショナルリスクに係る標準的手法の見直し

III. オペレーショナルリスク管理高度化への取り組み

1. トップダウンのリスク・コントロール・セルフ・アセスメント (RCSA)
2. トップリスクの抽出とモニタリング

IV. オペレーショナルリスク管理を取り巻く内部管理態勢

1. 3つの防衛線によるリスク管理態勢構築の要請と背景
2. オペレーショナルリスク管理における各線の役割
3. リスク・アペタイト・フレームワーク (RAF) の定義 (事例をもとに)
4. リスク・アペタイト・フレームワーク (RAF) と主要リスク指標 (KRI : Key Risk Indicator)
5. 実効的なリスク関連データの収集と報告 (RDA : Risk Data Aggregation) におけるオペレーショナルリスクの位置づけ

V. オペレーショナルリスク管理領域の拡大

1. コンプライアンスリスクとの住み分け
2. コンダクトリスクの定義と管理フレームワーク
3. コンダクトリスク管理導入における論点
4. サイバーセキュリティリスクとオペレーショナルリスク

加瀬 鶴佳 氏 プロフィール

早稲田大学 (法学部) 卒業。大手金融機関にて法人および個人営業に従事。その後、07 年に有限責任監査法人トーマツ入社。銀行、保険、証券等の金融機関に対して、市場リスク管理・オペレーショナルリスク管理態勢高度化支援業務、内部管理態勢・コンプライアンス態勢の構築・高度化支援業務、内部監査関連業務を実施している。

FAX 03-3261-4570 CMC事務局まで

86

第87回 金融機関 リスクマネジメントセミナー

「オペレーショナルリスクにおける

最新の規制と内部管理」

ホームページ用受講申込書（2月19日開講）

貴社名

所在地 〒

TEL

FAX

Eメール

受付番号	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・会場地図を郵送いたします。

☆一週間経過しても届かない場合はご連絡ください。

受講料 A：CMC会員価格 29,160円（本体価格27,000円）

B：後援団体会員価格 31,320円（本体価格29,000円）

C：一般価格 33,480円（本体価格31,000円）

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

①受講料は、セミナー開催日までにお振込みください。

②銀行振込の場合は領収書を発行いたしません。

③銀行振込に際しては、可能であれば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。

振込手数料は貴機関でご負担をお願い申し上げます。

④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。

⑤講演中の録音・撮影ならびにパソコン・携帯電話の利用はご遠慮ください。

⑥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ください。

⑦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。