

|  |  |  |
|--|--|--|
|  |  |  |
|  |  |  |

(関係部門へご回覧下さい)

## 「市場リスク・オペレーショナルリスク・ALM・ 統合リスク管理（基礎～中級編）」

本セミナーでは、市場リスク、ALM、オペレーショナルリスク、及び統合リスクを可能な限り数学を使わず平易な言葉で解説し、リスク管理上の必須知識を短期間で効率的に習得することを目的としています。

最近のトピックとして、市場リスク管理のフレームワークを大きく変える、バーゼル委「マーケット・リスクの最低所要自己資本」(FRTB) (2016年1月公開)の概要も説明します。金融庁は2017年6月30日に「銀行勘定の金利リスク」を2019年3月から国内基準行へも適用する旨公表し、ALM等への影響が予想され、同規制の概要を説明します。2017年12月にバーゼル委「バーゼルIII:危機後改革の最終化」が公表され、その中で示された「オペレーショナルリスクの計測手法の見直し」の最終案概要も説明します。

最近では下記が主要な課題となっていますが、対応は十分ですか？

- ★ 市場環境の激変を想定したストレステストを実施していますか？
- ★ FRTB(期待シートフォール等)への対応を始めていますか。
- ★ 「銀行勘定の金利リスク」への対応に遅れはないですか？

開催日：2018年6月21日(木)・6月22日(金)

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

リスクアドバイザーグループ

シニアマネージャー

東 浦 明 朗

**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

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

## ☆研修の対象

金融機関に勤務しており、収益管理・リスク管理部門に配属されたばかりの方、市場部門、事務システム部門、ALM 部門のご担当の方、統合リスク管理ご担当の方、収益管理・リスク管理システムの企画・開発・運用担当になった方、収益管理・リスク管理の概要を理解しておきたい経営者・管理者の方、および金融機関を営業対象とする企業の担当社員・SEの方、「銀行業務研修・基礎コース」を修了された方々。

## ☆研修のねらい

銀行において近年大きな課題となっている**収益管理、リスク管理を可能な限り数学を使わず平易な言葉で解説**。特に本コースでは**市場リスク、オペレーショナルリスク、ALM、統合リスク管理を学習**します。必要な用語、実務知識を身につけ、今後の業務運営、企画・開発・運用業務、及び効果的なシステム導入の提案・営業活動に役立てていただくことをねらいとします。

## ☆本研修の位置付け

金融にかかわるすべての方を対象とした **CMC**の「銀行業務研修・基礎コース」「銀行業務研修中級・勘定系システムコース」に続く銀行業務研修シリーズ第三弾。「基礎コース」を受講した方を対象に、より深い金融知識を学習していただくために開講。

## ☆開催要綱

**日 程：** 2018年6月21日（木）～6月22日（金） 2日間

**時 間：** 1日目 10：30～16：30（10：00受付開始）

2日目 9：30～16：00（9：00受付開始）

**講 師：** 東浦 明朗 氏

**会 場：** ニッキンホール（東京・市ヶ谷）

**受講料：**・CMC会員価格 62,640円（本体価格58,000円、消費税4,640円）

（CMC金融機関機械化研究会会員、金融ニュービジネス&テクノロジー研究会会員）

・後援協会会員価格 66,960円（本体価格62,000円、消費税4,960円）

・一般価格 71,280円（本体価格66,000円、消費税5,280円）

（2日間とも昼食はこちらで用意いたします）

**定 員：** 40名（最少開催人員10名）

## ※講師のご紹介

### 東浦 明朗 氏

（有限責任監査法人トーマツ リスクアドバイザーグループ シニアマネージャー）

早稲田大学政治経済学部卒業。米国カーネギーメロン経営大学院修士。大手銀行で信用リスクモデル等開発・導入、国内外の企業やシンジケートローンの審査などの業務に12年間従事。1998年からは、大手コンサルティング会社にて、金融機関、総合商社等に対するリスク管理、与信業務改革、内部統制整備、予算・実績管理、情報系システム開発のプロジェクト管理、ベンダー選定支援等の多数のコンサルティング実績を有している。現在は金融機関等に対するITリスク、統合リスク管理、市場リスク等のコンサルティング、リスク管理やリスクデータベース開発等のプロジェクト管理支援等を担当。

## 第84回 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（基礎～中級編）」

#### カリキュラム

1日目 6月21日（木） 10：30～16：30 （10：00受付開始）

2日目 6月22日（金） 9：30～16：00 （9：00受付開始）

|  |  |
|--|--|
| <p><b>1. 市場リスク</b></p> <p>1-1 市場リスクとは</p> <p>1-2 市場リスク管理とは</p> <p>1-3 ケーススタディ ～ 市場VaR</p> <p>1-4 ストレステスト</p> <p>1-5 期待ショートフォール</p> <p>1-6 市場リスク管理体制</p> <p>1-7 市場リスク管理システム</p> <p>1-8 金融検査マニュアル解説<br/>－ 市場リスク管理</p> <p><b>2. 基礎概念</b></p> <p>2-1 デリバティブの基礎</p> <p>2-2 イールドカーブ（利回り曲線）の基礎</p> <p><b>3. ALM</b></p> <p>3-1 ALM (Asset Liability Management)</p> <p>3-2 ケーススタディ ～ ALM</p> <p>3-3 ALMの実務</p> <p>3-4 ALM体制</p> <p>3-5 ALMシステム</p> <p>3-6 金融検査マニュアル解説 － ALM</p> | <p><b>4. オペレーショナルリスク</b></p> <p>4-1 オペレーショナルリスクとは</p> <p>4-2 オペレーショナルリスク管理とは</p> <p>4-3 オペリスク管理体制</p> <p>4-4 オペリスク管理システム</p> <p>4-5 金融検査マニュアル解説<br/>－ オペレーショナルリスク</p> <p><b>5. 統合リスク管理</b></p> <p>5-1 統合リスク管理とは</p> <p>5-2 統合リスク管理体制</p> <p>5-3 統合リスク管理システム</p> <p>5-4 金融検査マニュアル解説<br/>－ 統合的リスク管理・自己資本管理</p> <p><b>6. 最近のトピック</b></p> <p>6-1 バーゼル委「マーケット・リスクの最低所要自己資本」の概要</p> <p>6-2 バーゼル委「銀行勘定の金利リスク」の概要</p> <p>6-3 バーゼル委「オペレーショナルリスクの計測手法の見直し」</p> <p>※2日間とも昼食はこちらで用意いたします</p> |
|--|--|

FAX 03-3261-4570 CMC事務局まで

21

第84回 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（基礎～中級編）」

ホームページ用受講申込書

2018年6月21日(木)～6月22日(金)開講

貴社名

所在地 (〒 - )

連絡責任者

TEL

部署・役職

FAX

|  | 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: 62,640円(本体価格 58,000円) <CMC会員価格>

B: 66,960円(本体価格 62,000円) <後援協会会員価格>

C: 71,280円(本体価格 66,000円) <一般価格>

<2日間とも昼食はこちらで用意いたします>

お問い合わせは、

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

受講についてのお願い

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。

振込手数料は貴社でご負担をお願い申し上げます。

④開催日一週間以内のキャンセルはできません。

⑤講演中は、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。

⑥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。