

(関係部門へご回覧ください)

リスク性資産への投資におけるリスク管理の実務

マイナス金利の継続により、リスク性資産への投資意欲がさらに高まり、様々な商品への投資が検討され、保有が進められています。伝統的な融資に比較してその態勢は十分とは言えず、特にリスク管理態勢の強化を行う必要があります。

人員拡充等により態勢が強化されている運用部門に対し、ミドル部門であるリスク管理部門はその態勢整備が追い付いておらず、また、管理に関する知識も十分ではなく、購入・保有する商品をどのようにチェック・モニタリングすればよいのかという点に頭を痛める金融機関も多くみられます。

当セミナーでは、特に有価証券を中心としたリスク性資産への投資に対するリスク管理に焦点を当て、トレーディングは実施していないものの、銀行勘定の中で様々な有価証券投資を行っていく金融機関において、どのようにリスク管理を行っていくべきか、その態勢を中心に関係する規制の動向についても解説します。また、リスク性資産の各商品別に、どのようなリスクを持ち、どのような観点でモニタリングを行っていくべきかについて解説します。

開催日：2018年10月29日（月）1.0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

金融インダストリーグループ ディレクター

小 西 仁

リスクアドバイザー事業本部 マネジャー

加 瀬 鶴 佳

主催：C M C

Computer Based Management College

<https://www.nikken.co.jp/cmc.html>

※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

リスク性資産への投資におけるリスク管理の実務

カリキュラム 10:30~16:30 (10:00 受付開始)

I. 金融機関におけるリスク性資産投資の現状

1. 各業態における有価証券投資の状況
2. リスク管理における当局の反応

II. 有価証券投資における組織体制

1. フロント・ミドル・バックの体制
2. 一般的なリスク管理態勢

III. 有価証券投資に対するリスク管理手法

1. リミットによる市場リスク・市場性信用リスク管理
2. 各商品に対するミドルによるモニタリング
3. 投資方針に対するミドル部門の関与
4. 有価証券投資に対するリスク管理の論点

IV. ALMの概要

1. ALMの重要性
2. ALM管理の組織体制
3. 金利リスクの集中的な管理

V. 規制変更による有価証券投資への影響

1. リスクアセット計測
2. アウトライヤー比率規制

VI. 商品ごとのリスク管理・内部監査の要点

1. 国債
2. 地方債・政府保証債
3. 社債
4. 外国債券
5. 仕組債
6. デリバティブ
7. 株式（上場株、未公開株、純投資、政策投資）
8. ファンド

※昼食はこちらで用意いたします

小西 仁 氏 プロフィール

慶應義塾大学（経済学部）卒業。大手証券会社、情報システムベンダーに勤務の後、大手監査法人系コンサルティング会社を経て、07年に有限責任監査法人トーマツ入社。日本証券アナリスト協会検定会員。銀行、保険、証券等の金融機関に対して、バーゼルやソルベンシー等の規制関連業務、オペレーショナルリスク管理態勢高度化支援業務、内部監査支援業務等を実施している。

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

62

第90回 金融機関 リスクマネジメントセミナー

「リスク性資産への投資におけるリスク管理の実務」

ホームページ用受講申込書（10月29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・会場地図を郵送いたします。

受講料 A：CMC会員価格 41,040円（本体価格38,000円）

B：後援団体会員価格 44,280円（本体価格41,000円）

C：一般価格 47,520円（本体価格44,000円）

お問い合わせは、（昼食はこちらで用意いたします）

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。