

(関係部門へご回覧下さい)

オペレーショナルリスク管理とは

～その手法、実効性ある管理への課題～

基本的な用語や、おのおのの概念、リスク計量化モデルや管理手法の概要について網羅的に俯瞰します。さらに、それがどのように金融検査マニュアルに投影され、業務遂行に関わっているかをわかりやすく解説し、現状の課題・今後の方向性に触れていきます。また、バーゼル銀行監督委員会が検討するオペレーショナルリスクに関する自己資本比率の計算の変更に関しても解説します。

- ★ オペレーショナルリスクの概念、課題を整理しておきたい経営者、管理者の方
- ★ 金融機関の内部監査部門に新たに配属された方、システム開発部門の方
- ★ 金融機関関連会社やシステム開発ベンダーでオペリスクについて学習したい方

開催日：2018年11月29日（木）・30日（金） 1.5日間

会場：第2ニッキンホール（東京・市ヶ谷）

監修、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
マネジャー	加瀬 鶴佳

CMC

Computer Based Management College

<https://www.nikkinn.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

☆研修の対象

金融機関の内部監査部門、経営管理部門、リスク統括部門に新たに配属された方、収益・リスク管理系の関連システム開発部門の方、改めてオペレーショナルリスクについての概念、課題を整理しておきたい経営者・管理者の方、金融機関関連会社やシステム開発ベンダーの方。オペレーショナルリスクについての基本的なところから、B I S規制、コンダクトリスク等とのかかわり、金融検査マニュアル及び検査方針におけるチェックポイントを改めて整理・理解しておきたい方々。

☆コースのねらい

オペレーショナルリスクの認識は、あらゆる業務展開や業務運営の中で、今や不可欠の検討要素となっている。金融機関においては、金融検査マニュアルをはじめ、監督指針でも明確に定義され、それを認識、管理し、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ている。一方で「その他」リスクと言われるように、その範囲は広く、全ての業務において、自然災害から人的要因、法令違反など様々なリスクを想定し対処していく態勢も求められる。業務遂行上どのようなリスクが考えられるのか、またどのように要因をとらえ、おのおのにどう対処をしていくのかといった基本的な認識から、B I S規制で重視されるシステムリスク、事務リスクを中心にその計量化を含めた管理手法をわかりやすく解説し、理解を深める。また、実効性あるオペレーショナルリスク管理とは、事務品質向上策や業務プロセス改革、効率化などの取り組みとはどういう関連があるのかなどの課題を整理する。

☆開催要綱

日 時：2018年11月29日（木）、30日（金） 1. 5日間

時 間：1日目 13:30～17:00

2日目 10:00～16:00

講師名：有限責任監査法人トーマツ

ディレクター 小西 仁 氏

マネジャー 加瀬 鶴佳 氏

会 場：第2ニッキンホール（東京・市ヶ谷）

受講料：

- ・CMC会員価格 52,920円（本体価格49,000円、消費税3,920円）
- ・後援協会会員価格 56,160円（本体価格52,000円、消費税4,160円）
- ・一般価格 59,400円（本体価格55,000円、消費税4,400円）

定 員：30人（開催最少人員10人）

（2日目の昼食はこちらで用意いたします）

<講師の紹介>

小西 仁 氏（有限責任監査法人トーマツ ディレクター）

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の勤務の後、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、パ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。主な著書（共著）は『パーゼルⅡ対応のすべて』（金融財政事情研究会、08年3月）、これからのストレステスト（金融財政事情研究会、12年6月）、Q&A 業種別会計実務・14証券（中央経済社、14年3月）

加瀬 鶴佳 氏（有限責任監査法人トーマツ マネジャー）

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、内部管理態勢、コンプライアンス態勢の構築・高度化支援、内部監査・J-SOX関連業務、およびオペレーショナルリスク管理態勢高度化支援業務を実施している。

オペレーショナルリスク管理とは

カリキュラム

1日目 11月29日(木) 13:30~17:00 <13:00受付開始>

2日目 11月30日(金) 10:00~16:00 <9:30受付開始>

1. オペレーショナルリスクの認識

- 1.1 「その他リスク」とバーゼル規制
- 1.2 金融検査マニュアルとバーゼル規制
- 1.3 いまさら聞けない「オペレーショナルリスクの種類と意味、用語と定義、解釈」

2. BIS規制での

オペレーショナルリスク管理

- 2.1 オペレーショナルリスクに関する規制動向
- 2.2 オペレーショナルリスクに関する定性的管理ツール
 - ・内部損失データ収集
 - ・RCSA
 - ・シナリオ分析等
- 2.3 オペリスクに係る標準的手法の見直し
 - ・新しい標準的手法(新SA)の概要
 - ・新SAの計算手法
 - ・本邦金融機関への影響
- 2.4 オペレーショナルリスクに関する定量的管理ツール(VaRとそのインプットデータ)
 - ・計量化の要素
 - ・バーゼル委員会で提唱された計測手法
 - ・損失分布手法とは
 - ・損失分布手法へのアプローチ
 - ・損失データの収集

3. オペレーショナルリスク管理を取り巻く内部管理態勢

- 3.1 コンプライアンス対策
 - ・コンプライアンス態勢
 - ・顧客保護等管理態勢
- 3.2 事務過誤防止、品質維持向上策
 - ・金融機関絡みの事件、類型
 - ・金融検査マニュアルの要請
- 3.3 業務監査との関係

4. 新たな課題と今後の方向性

- 4.1 事務改善への活用
- 4.2 オペレーショナルリスク管理高度化への取り組み
- 4.3 新たな論点
 - ・3つの防衛線
 - ・コンダクトリスクの管理
 - ・リスク・アペタイトフレームワーク
 - ・実効的なリスク関連データの取集と報告(RDA: Risk Data Aggregation)
 - ・サイバーセキュリティ

※2日目の昼食はこちらで用意いたします。

FAX 03-3261-4570 CMC事務局まで

67

オペレーショナルリスク管理とは
～その手法、実効性ある管理への課題～
ホームページ用受講申込書（11月29日～30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。

☆お申し込み後、一週間経過しても、受講証・請求書・会場案内図が届かない場合はご連絡ください。

受講料

A：52,920円（本体価格 49,000円） <CMC会員価格>

B：56,160円（本体価格 52,000円） <後援協会会員価格>

C：59,400円（本体価格 55,000円） <一般価格>

（2日目の昼食はこちらで用意します）

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

受講についてのお願い

①受講料は、できるだけ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・撮影ならびに携帯電話・パソコン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。

※CMCのホームページからWebでの申し込みができます