


(関係部門へご回覧下さい)

## 金融機関行職員のための リスクマネジメント入門

- ★ 本コースは、リスクマネジメントの入門セミナーです。確率・統計の基礎から始め、VaRに関する理解を深めるとともに、VaRの限界を補完するためには、どのようなストレステスト、シナリオ分析を実施すべきかなど、リスクマネジメントに求められる重要事項を分かりやすく解説します。質疑応答の時間を多くとって、完全理解を目指します。
- ★ リスクマネジメントに関して経験の浅い社内・社外役員、リスク管理部門に配属されて間もない管理者、実務担当者の方を主な対象としますが、ある程度、経験を積んでいても、リスク管理のあり方について、リスクカテゴリー別、体系的に習得し直したいと考えている方にも役立つ内容です。リスク管理部門のほか、企画部門、内部監査部門、システム部門など、関連部門の管理者、実務担当者の方も参加可能です。

開催日：2019年6月17日（月）・18日（火） 2日間

会場：ニッキンホール（東京・市ヶ谷）

監修、講師：（敬称略）

FFR+代表 碓井 茂樹（日本銀行金融高度化センター）

（注）FFR+は「金融工学とリスクマネジメント高度化」研究会  
（Forum of Financial technology and Risk management）  
の略称。

**CMC**

*Computer Based Management College*

<https://www.nikkin.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

## ☆コースのねらい

リスクが多様化、複雑化するなかで、リスクマネジメントの実務は高度化しています。本コースでは、確率・統計の基礎から始め、VaRに関する理解を深めるとともに、その限界を補完するために、どのようなストレステスト、シナリオ分析を実施すべきかなど、リスクマネジメントに求められる重要事項を分かりやすく解説します。質疑応答の時間を多くとって、完全理解を目指します。

## ☆研修の対象

リスクマネジメントに関して経験の浅い社内・社外役員、リスク管理部門に配属されて間もない管理者、実務担当者の方。

リスク管理のあり方について、リスクカテゴリー別、体系的に習得し直し、実務に役立てたいと考えている役員、企画部門、内部監査部門など関連部門の管理者、実務担当者の方。

関連するシステム開発に携わる金融機関、金融機関関連会社やシステム開発ベンダーの方。

## ☆開催要綱

日時：2019年6月17日（月）、18日（火）2.0日間

時間：1日目 9:30～17:00

2日目 9:30～16:00

講師名：FFR+代表 碓井 茂樹（日本銀行金融高度化センター）

（注）FFR+は「金融工学とリスクマネジメント高度化」研究会（Forum of Financial technology and Risk management）の略称。

会場：ニッキンホール（東京都・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）
  - ・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日とも昼食はこちらで用意いたします）

※ご紹介欄です

FFR+ 「金融工学とリスクマネジメント高度化」研究会  
(Forum of Financial technology and Risk management)

FFR+は「金融工学とリスクマネジメント高度化」をテーマに、各種リスクマネジメント、内部監査の専門家、実務家が集まり研究活動を行っています。また、リスクマネジメントや内部監査の発展に貢献するため、その研究成果をセミナーや出版などの形で広く情報発信しています。

FFR+の研究・情報発信活動は”share for progress”の精神にもとづき、メンバー個人の意思と責任において行われています。情報発信された意見やコメントは、メンバーが所属する組織・団体の公式見解を示すものではありません。また、同組織・団体がこれを保証・賛成・推奨等するものでもありません。

ホームページ <http://www.ffr-plus.jp>

FFR+は、日本金融監査協会の事務局を務めています。

ホームページ <http://www.ifra.jp>

※本セミナー受講者には、FFR+編著「リスク計量化入門－VaRの理解と検証」（金融財政事情研究会）を2割引（定価2,100円⇒1,680円）にて販売いたします。

# リスクマネジメント入門 カリキュラム

(1日目) 6月17日 (月) 9:30~17:00<9:00受付開始>	(2日目) 6月18日 (火) 9:30~16:00<9:00受付開始>
<p><b>1. リスクマネジメント (概論)</b></p> <p>1.1 リスクの定義、リスクマネジメント</p> <p>1.2 リスク計量化とは</p> <p>1.3 計量化の意義と限界</p> <p>1.4 VaR の活用事例、統合リスク管理</p> <p><b>2. 統計・確率の復習</b></p> <p>2.1 基本統計量 (1 変量)</p> <p>2.2 基本統計量 (2 変量)</p> <p>2.3 確率変数と確率分布</p> <p>2.4 推定と検定</p> <p>(質疑応答)</p> <p><b>3. VaR の計測と検証</b></p> <p>3.1 VaR の定義</p> <p>3.2 VaR の計測手法 ～市場 VaR、信用 VaR、オペ VaR</p> <p>3.3 VaR の検証：バックテスト</p> <p>(質疑応答)</p> <p><b>4. ストレステスト、シナリオ分析</b></p> <p>4.1 VaR の限界</p> <p>4.2 ストレステストとシナリオ分析</p> <p>4.3 リスクアペタイト・フレームワーク</p> <p>(質疑応答)</p> <p><b>5. 内部監査のポイント</b></p> <p>(質疑応答)</p>	<p><b>6. 市場リスク管理と内部監査のポイント</b></p> <p>6.1 リスクの許容と管理の枠組み</p> <p>6.2 経営者、フロント・ミドル・バックの役割</p> <p>6.3 内部監査のポイント</p> <p>補足 1 現在価値アプローチと期間損益アプローチ</p> <p>補足 2 仕組み商品投資のリスク管理</p> <p>(質疑応答)</p> <p><b>7. 信用リスク管理と内部監査のポイント</b></p> <p>7.1 内部格付と信用リスク計量化 ～企業格付 ～リスク計量化モデル</p> <p>7.2 経営マネジメントへの活用 ～経営の安定確保 ～経営資源の配分 ～信用ポートフォリオのマネジメント ～審査管理の高度化</p> <p>7.3 内部監査のポイント</p> <p>(質疑応答)</p> <p><b>8. オペレーショナルリスク管理と内部監査のポイント</b></p> <p>8.1 組織体制の構築 ～全社的なリスク把握・管理体制</p> <p>8.2 基本フレームワークの整備 ～内部損失データの把握 ～シナリオの作成と RCSA 評価 ～モニタリング要員確保の重要性 ～削減/コントロールの難しさ</p> <p>8.3 内部監査のポイント</p> <p>8.4 データ・コンソーシアムの活用可能性</p> <p>(質疑応答)</p>

FAX 03-3261-4570 CMC事務局まで

20

第86回 金融機関 内部管理コース

「リスクマネジメント入門」

ホームページ用受講申込書

2019年6月17日(木)~18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。

**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>

お問い合わせは、 (2日間とも昼食はこちらで用意いたします)

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開催日前、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。
- ⑦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。