

## 《特別企画》

リスクアペタイト・フレームワークの構築と  
最新ストレステストの実践

日 時

2014年 6月16日 (月)  
10:00~17:00 (受付開始9:00)

会 場

NTT データ・セミナールーム  
東京都江東区豊洲 3-3-3 豊洲センタービル 10F  
豊洲駅 1b 出口徒歩 3 分 (有楽町線)、北口徒歩 5 分 (ゆりかもめ)  
<http://www.nttdata.com/jp/ja/corporate/profile/guide/map.html>

概 要

金融危機以降の国際的な議論・提言を踏まえ、先進的な金融機関では、リスクアペタイト・フレームワーク(RAF)を構築し、その中核の手法としてストレステストの実践に取り組んでいます。本研修セミナーでは、RAFの概要や構築上の課題、RAFにおいても重要な役割を果たすストレステスト手法の最新動向を学ぶとともに、その実践的な活用を考えます。

参加対象

経営マネジメント層、リスク管理部門、内部監査部門の管理者、担当者など、幅広い層の方を対象にしています。

参加費用

会員/賛助登録して頂いた方は初めて受講する研修の参加費用を無料とします。  
会員 年会費/年賛助金 10,000 円 参加費用 初回無料、2 回目以降 5,000 円  
非会員 参加費用 毎回 10,000 円

プログラム

- 10:00~11:30 リスクアペタイト・フレームワーク (RAF) の構築  
—RAF の概要と構築上の課題、リスク文化との関係整理  
有限責任監査法人トーマツ/リスク管理戦略センター  
パートナー・センター長 大山 剛 氏
- 11:40~12:40 RAF の核心: ストレステストを活用した事業戦略リスクの評価  
同シニアマネージャー 中山 貴司氏
- 13:40~14:40 ストレステストを用いた市場・流動性リスク評価の最前線  
同シニアマネージャー 大島 一朗男氏
- 14:50~15:50 ストレステストを用いた信用リスク評価の最前線  
同マネージャー 佐藤 隆行氏
- 16:00~17:00 ストレステストを用いたオペリスク評価の最前線  
同マネージャー 佐藤 里帆氏

受講証明

CIA、CFE、CISA 等に係る CPE 申請のための受講証明を発行します(6CPE)

申し込み

協会ホームページよりお申し込みください。 [https://ifra.jp/seminar\\_info/index.html](https://ifra.jp/seminar_info/index.html)