

# 市場リスクマネジメント — 理論と実践 —

2011年  
**9月16日(金)**  
午前9時30分～  
午後17時20分  
D&BTSR(JAビル11階)  
大手町駅 C2b出口 直結

## 概要

金融危機以降、多様化、複雑化した市場リスクをどのように評価、管理すべきか、今一度、見直しを図る必要性が高まっています。とくに、金融機関のALMを考えるとき、コア預金や住宅ローンなどリスクの把握、評価は実務的に様々な困難を伴います。

本研修セミナーでは、市場リスクマネジメントの基礎的事項をレビューするとともに、コア預金、住宅ローンなどの内部モデルの構築、活用など最新のトピックについて解説します。

また、IFRSのコンバージェンスの一環として市場リスク量の開示が始まりました。市場リスクの評価・管理技法が高度化するなかでの監査の重点ポイントやIFRS対応などについて、改めて考える内容です。

## 日時

2011年9月16日(金) 9:30～17:20 (受付開始9:00)

## 会場

ダン アンド ブラッドストリート TSRセミナールーム  
東京都千代田区大手町一丁目3-1 JAビル11階  
大手町駅 C2b出口直結(千代田線、丸の内線、半蔵門線、東西線、三田線)

## 参加対象

経営マネジメント層やリスク管理部門、内部監査部門、システム管理部門の方など、幅広い層の参加を想定しています。

## 参加費用

会員5,000円 非会員10,000円  
※会員登録(年会費10,000円)して頂いた方は初めて受講する研修セミナーの受講費用を無料とします。2回目以降は会員価格(5,000円/1日)で受講可能です。

## プログラム

09:30～12:20 **市場リスクマネジメントの基礎—イントロダクション**

FFR+代表、日本銀行金融高度化センター  
碓井 茂樹 氏 (CIA,CFSA,CCSA)

13:20～14:40 **コア預金モデルの活用と検証**

データ・フォアビジョン(株)  
常務執行役員 数理分析本部長 野口 雅之 氏

14:50～16:10 **住宅ローンの収益性の評価**

(株)三菱総合研究所 金融ソリューション本部  
本部長 坪 雅明 氏 (CIA)

16:20～17:20 **市場リスクマネジメントの高度化と内部監査のポイント**

あずさ監査法人 FMG事業部  
アソシエートパートナー 丹羽 徹 氏

## 申込み

お申込みの受付開始は、7月下旬を予定しています。

## 備考

CIA、CFSA、CCSA、CFE等に係るCPE申請のための受講証明を発行します(7CPE)。