

信用リスクマネジメント — 理論と実践 —

2011年
10月5日(水)
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

財務データ等に基づき、取引先企業を格付して倒産確率を求め、倒産時の貸倒損失を推定することにより、信用リスクを計量化することができます。多くの金融機関が格付・スコアリングモデルを導入し、信用リスクを計量化して経営マネジメントに活用しています。しかし、その一方で、モデルの限界や実務上、留意すべき事項も少なくありません。また、企業格付やリスク計量化モデルの経営への活用状況など、内部監査における検証も難しいテーマです。

本研修セミナーでは、格付制度の構築や信用リスクの計量化による信用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、信用リスクマネジメントの高度化の意義と限界、実務上の留意点を踏まえ、内部監査の検証ポイントなどを整理します。

日時

2011年10月5日(水) 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

09:30～10:50 信用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)

11:00～12:30 格付モデルの導入・検証・再構築

FFR+メンバー、(株)金融工学研究所
取締役 森内 一朗 氏 (CIA)

13:30～15:00 信用リスクマネジメントの意義と限界、今後の方向性

みずほ第一フィナンシャル・テクノロジー(株)
代表取締役社長 池森 俊文 氏

15:10～16:10 信用リスクマネジメントの実践事例

静岡銀行 理事リスク統括部長 大越 裕 氏

16:20～17:20 信用リスクマネジメントの高度化と内部監査のポイント

FFR+メンバー、あずさ監査法人 FMG事業部
福永 謙介 氏 (CIA)

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)。