

金融システム講座 「経営管理系システムと統合リスク管理(2日コース)」のご案内

シグマベイスキャピタル株式会社
リックイマーケットソリューション株式会社

拝啓

時下、貴社益々ご清祥の事とお慶び申し上げます。

昨年からの金融危機は、リスク管理に新たな課題を投げかけております。市場の急激な変動の下で、迅速かつ適切な経営判断をするためには、経営管理系システムが極めて重要な役割を果たすことになりそうです。そこで、

リスク管理、経営管理に精通された花島様を講師に、下記の通り、研修講座を開催することに致しました。講座はエクセル演習を含む実践的なものですので、金融機関、金融システム/コンサルティングの方の実務に直結する内容になっているかと思います。皆様のご参加をお待ちしております。

敬具

記

- 講座名 経営管理系システムと統合リスク管理(2日コース)
- 講師 エフ・アイ・コンサルティング 代表取締役 花島 登 氏
エフ・アイ・コンサルティング 三上 華美 氏
- 日時 2009年7月2日(木)、3日(金) 10時00分～17時00分
- 会場 シグマベイスキャピタル 〒102-0073 千代田区九段北4-1-28 九段ファーストプレイス7F
(JR、都営新宿線、東京外口有楽町線、南北線、各「市ヶ谷」駅より徒歩7分)
- 受講費用 94,500円(税込) お弁当付き ※2名様以降は 63,000円(税込)
- お申し込み 別紙をご参照の上、ファックスにてお申し込み下さい。
※受講申込者が、7名以下の場合は、中止とする場合がございますので、予めご了解下さい。

■講座概要

去年のサブプライムローンによる経済状況の悪化以降、当局の信用を中心としたリスク管理検査が強化されつつあります。また、日本においても金融機関の中小企業に対する貸出が伸び悩む中、有価証券運用に傾注した金融機関が多大な損失を出す事例も散見されます。このようなことを回避するために特定部門や商品のリスク管理も重要ですが、全行ベースで統合的にリスク管理をする必要が増加しています。今回の講座では定量可能なリスク全体を管理しながら整合性ある個別リスク管理を実施するためのシステム機能概要を説明し、更に具体的なイメージを会得するために**エクセルシートベースでのリスク量算定手法と期間収益推計するための金利感応度分析の具体的な演習を実施します。これは、システムでリスク・リターン**の紐付けの際必ず役立つので、実際に実務で使用されているものをご提供します。最後にローン債権を中心とした時価評価が経営管理系システムにどのように影響を与えるかを明確にします。

■カリキュラム

時間	題目	1日目	2日目
10:00 ～12:00	経営管理系 システムフレームワーク	経営管理システム全体像とその概要 (収益管理 ALM、信用リスク管理 その他)	経営管理フレームワークと データ構造
13:00 ～15:00	経営管理系実践例	分散共分散法によるVaR算定演習 (エクセルベースでの VaR算定が可能になります)	シナリオ分析金利感応度分析演習 (現状のALMシステムにも使用可能 になります)
15:30 ～17:00	先進機能例と評価価格が 経営管理システムに与える影響	将来 VaR と予算作成	ローン債権を中心とした時価評価 が経営管理システムへ与える影響

■講師略歴

エフアイコンサルティング株式会社 代表取締役社長

花島 登 氏

金融リスク管理分野における代表的なコンサルタント。中央信託銀行(現中央三井信託銀行)、新日本監査法人、みずぎファイナンシャル・アドバイザーズを経て、現在は独立系コンサルタントとして活躍する。同時に金財総研においても、全国の銀行に対して統合リスク管理のコンサルティングを提供する。共著に「統合リスク管理」(きんざい)。早稲田大学大学院修了、工学博士。

エフアイコンサルティング株式会社

三上 華美 氏

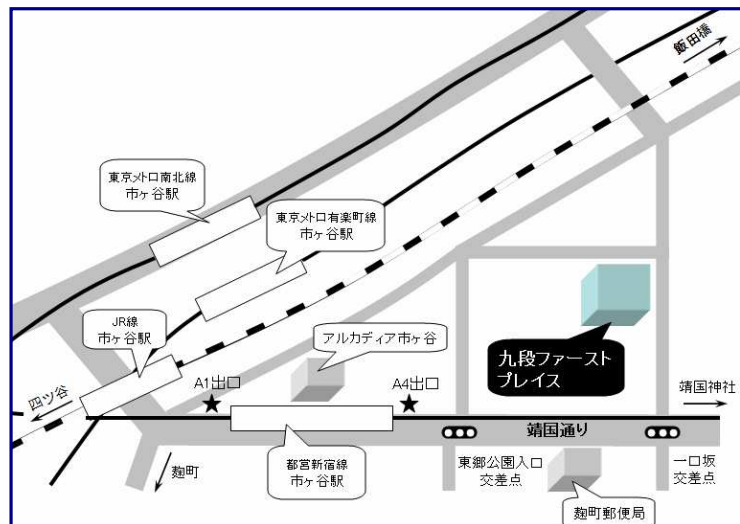
商社勤務を経てエフアイコンサルティング入社。現在金融機関への統合リスク管理コンサルティング全般のサポートとその中で必要な機能分析を担当。具体的にはリスク量分析、金利感応度分析及びプリペイメント分析等。茨城大学理学部卒業。

■会場のご案内

シグマベイスキャピタル教室
千代田区九段北4-1-28
九段ファーストプレイス7F

■交通

JR、都営新宿線、
東京外口有楽町線、南北線、
各「市ヶ谷」駅 より徒歩7分



■お問い合わせ

シグマベイスキャピタル株式会社
TEL:03-5212-8323
〒102-0073 東京都千代田区九段北 4-1-28
九段ファーストプレイス7F

リックイーマーケットソリューション株式会社
TEL:03-3282-7721 E-mail:info@rickie-ms.com
〒100-0005 東京都千代田区丸の内 2-2-1 岸本ビル 10F