

第72回 銀行業務研修・中級コース

第31回 収益管理・リスク管理入門コース  
～ALMの高度化、課題と方向性～

金融機関で収益管理、リスク管理部門に配属されたばかりの方  
資金証券部門、ALM部門、事務システム部門のご担当の方  
統合リスク管理のご担当の方  
収益管理、リスク管理システムを開発されているシステム部門の方  
収益管理、リスク管理の概要を理解しておきたい経営者、管理者の方  
メーカー・ベンダーの銀行担当営業、SEの方  
「銀行業務研修・基礎コース」を修了された方  
収益管理、リスク管理を基礎から学習したい方のための

短期集中講座です。

## 10月コース募集

開催日：2010年10月19日（火）  
会場：ニッキンホール（東京・市ヶ谷）  
講師：（敬称略）  
プライスウォーターハウスクーパース 株式会社  
金融サービス事業部  
シニア・マネージャー 小野 准示

主催：**CMC**

Computer Based Management College

<http://www.nikkinn.co.jp/CMC/>

後援：社団法人 全国地方銀行協会  
社団法人 第二地方銀行協会  
社団法人 全国信用金庫協会  
社団法人 全国信用組合中央協会

## 研修の対象

金融機関に勤務しており、収益管理・リスク管理部門に配属されたばかりの方、資金証券部門、事務システム部門、ALM 部門のご担当の方、統合リスク管理ご担当の方、収益管理・リスク管理システムの企画・開発・運用担当になった方、収益管理・リスク管理の概要を理解しておきたい経営者、管理者の方、および金融機関を営業対象とする企業の銀行担当営業社員・S Eの方、「銀行業務研修・基礎コース」「銀行業研修中級・収益、リスク管理コース～市場・ALM・オペリスク・統合リスク編～」を修了された方々。

## 研修のねらい

銀行において近年大きな課題となっている収益管理、リスク管理を、可能な限り平易な言葉で解説するコースの一環として、本コースでは特に金利リスク、ALM について取り上げます。ALMの基礎から現状の課題、今後の方向性までを学習します。必要な用語、実務知識を身につけ、今後の業務運営、企画・開発・運用業務、及び効果的なシステム導入の提案・営業活動に役立てていただくことをねらいとします。

## 本研修の位置付け

金融にかかわるすべての方を対象とした CMCの「銀行業務研修中級・収益管理・リスク管理コース」(「信用リスク編」と「市場リスク、オペレーショナルリスク、ALM、統合リスク管理編」の2コースあり)の中から、特に金利リスクのリスクカテゴリーに焦点を当て、より理解を深めていただくものです。「CMC ワークショップセミナー」「リスクマネジャー養成コース」の入門編でもあり、収益管理・リスク管理部門でお仕事をされる方にとって、概略を理解するための講座として設計しました。

詳しくは [http://www.nikkoin.co.jp/cbmc/2010cmc\\_course.html](http://www.nikkoin.co.jp/cbmc/2010cmc_course.html) をご覧ください。

## 開催要綱

日時： 2010年10月19日(火) 1日間

時間： 10:00～16:30

講師： 小野准示(おのじゅんじ)氏

(プライスウォーターハウスクーパース株式会社 金融サービス事業部 シニア・マネージャー)  
都市銀行でのデリバティブ・外為関連のフロント・ミドル・セールスを経て、ベリングポイント株式会社(旧 KPMG コンサルティング)に入社。銀行、保険会社、投資会社、総合商社などのクライアントへのリスクマネジメント、財務会計・管理会計、ポストマージャーインテグレーション、BPR、内部統制体制構築・評価を中心としたソリューションを提供

会場： ニッキンホール(東京・市ヶ谷)

受講料： ・ CMC会員価格 37,800円(本体価格36,000円、消費税1,800円)

・ 後援協会会員機関 40,950円(本体価格39,000円、消費税1,950円)

・ CMC非会員価格 44,100円(本体価格42,000円、消費税2,100円)

(昼食はこちらで用意いたします)

定員： 40人

## スケジュール

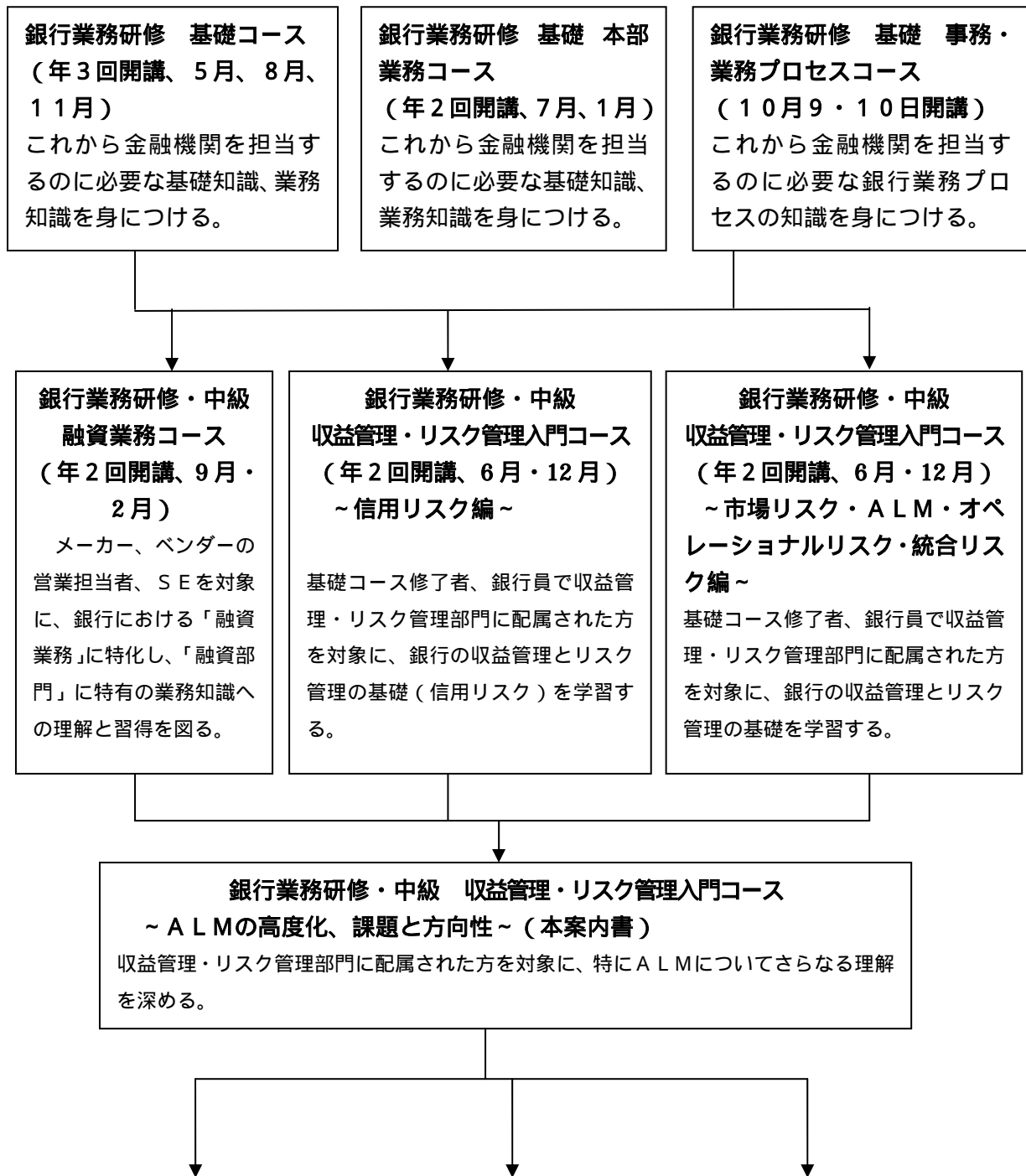
日 時	研修テーマ	講師（敬称略）
4 / 28 (水) (開場 9 時) 10 : 00   12 : 30 (昼食) 13 : 30   16 : 30	<b>1 . A L M 概要 （ 1 . 0 時間 ）</b> ・ A L M の目的、役割 ・ A L M のしくみ～ A L M の VaR とは ～用語、簡単な統計的意味、手法などの詳細の説明 ・ A L M の歴史 ・ 管理手法とその考え方～前提と限界 ・ A L M のシステム対応  <b>2 . パーゼル における A L M （ 1 . 5 時間 ）</b> 2 - 1 . A L M の現状とその問題点 2 - 2 . パーゼル 以降の市場リスク管理の強化 市場リスクと金利リスク 2 - 3 . バンキング勘定と金利リスクの扱い アウトライヤー規制  <b>3 . A L M の今後の課題 （ 1 . 5 時間 ）</b> 3 - 1 . A L M 運用体制 3 - 2 . A L M による収益予測 VaR と E a R 3 - 3 . A L M と部署別収益管理 トランスファープライシング  <b>4 . A L M の今後 （ 1 . 0 時間 ）</b> ～地域金融機関における A L M の意味とは ・ 統合リスク管理上の問題とリスク資本経営への意味 ・ 経営戦略へのインパクト ・ IFRS 導入による影響	プライスウォーターハ ウスクーパーズ コンサ ルタント株式会社 金融サービス事業部  小野 准示

### プライスウォーターハウス 株式会社 概要

プライスウォーターハウスクーパース株式会社は、ディールアドバイザーとコンサルティングサービスを提供する国内最大規模のコンサルティングファームです。M&A や事業再生・再編の専門家であるディールズ部門と経営戦略の策定から実行まで総合的に取り組むコンサルティング部門が連携し、顧客企業にとって最適なソリューションを提供しています。世界 151 カ国 163,000 人以上のスタッフを有するプライスウォーターハウスクーパース(PwC)のネットワークを生かし、約 1,600 名のプロフェッショナルが企業の経営課題の解決を支援しています。

(PwC アドバイザー株式会社とプライスウォーターハウスクーパース コンサルタント株式会社は、2010 年 1 月 1 日に経営統合し、社名を「プライスウォーターハウスクーパース株式会社」に変更しました。さらに同日、プライスウォーターハウスクーパース HRS 株式会社が参画しています。)

CMC 銀行業務研修とリスクマネジメントコースの体系



(リスク管理の技法をExcelを使い、確率統計・金融工学を駆使して実践的に学習する)

<p>CMCワークショップセミナー Excelを使ったバンキング勘定のALMと収益・リスク管理 (8月開講)</p>	<p>CMCワークショップセミナー Excelを使った市場リスクの計量化と管理手法 (10月開講)</p>	<p>CMCワークショップセミナー Excelを使ったリスク計量化のための確率・統計 (5月開講)</p>	<p>CMCワークショップセミナー Excelを使った金融工学の基礎 (年1回6月開講)</p>
--	---	---	--

46

## 第31回収益管理・リスク管理入門コース ～ALMの高度化、課題と方向性～ ホームページ用受講申込書（10月19日開講）

貴社名

所在地 〒

TEL

FAX

Eメール

受付番号	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FAX致します。

**受講料** A：37,800円（本体価格36,000円）  
（CMC金融機関機械化研究会）  
（CMC金融ニュービジネス&テクノロジー研究会）  
B：40,950円（本体価格39,000円）  
（後援協会会員機関）  
C：44,100円（本体価格42,000円）  
（非会員機関）

お申し込み・お問い合わせは、  
株式会社 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

受講料は、セミナー開催日までにお振込み下さい。

銀行振込の場合は領収書を発行いたしません。

銀行振込に際しては、貴機関名の前にセミナー番号（46）を付記してください。

振込手数料は貴機関でご負担をお願い申し上げます。

開催日一週間以内の受講キャンセルの場合、受講料の払い戻しはいたしません。

講演の録音、撮影等をご遠慮ください。

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下さい。

CMCのホームページからWebでの申し込みもできます