

第388回

ニューバンキングセミナー

金融機関の内部監査& リスク管理セミナー

期日 2009年11月24日(火)~25日(水) [2日間]

会場 金融財政事情研究会 本社ビル 2階会議室(東京・信濃町)



NEW
BANKING
SEMINAR

ご参加のおすすめ

毎年恒例の本セミナーですが、今年は、平成21年8月、「ベター・レギュレーション（金融規制の質的向上）を恒久的な運営指針として位置づけ、その実践強化・進化に向けた取組み（アクションプラン）の加速を標榜し、「重要なリスクに焦点をあてた検証」問題の本質的な改善につながる深度ある原因分析・解明」「問題点の指摘と適切な取組みの評価、静的・動的な実態の検証」「指摘や評価根拠の明示、改善を検討すべき事項の明確化」「検証結果に対する真の理解（納得感）」を基本的な取組姿勢に纏った「平成21検査事務年度検査基本方針及び検査基本計画」が公表されております。

「検査重点事項」としては、(1)「経営管理態勢の整備（戦略目標の合理性・持続可能性への十分な分析と検討、戦略目標と各種リスク管理方針との整合性、強固なガバナンスの構築・機能発揮、内部監査の有効性の品質確保）」(2)「リスク管理態勢の整備（統合的なリスク管理態勢・信用リスク管理態勢・金融グループ全体としてのリスク管理態勢・システムリスク管理態勢の整備・検証）」(3)「円滑な金融仲介機能の発揮（中小企業・個人（住宅ローン）等に対する円滑な金融仲介対応、中小企業にふさわしい金融手法の提供、中小企業等の債務者に対するきめ細かい実態把握と適切なリスク管理）」(4)「顧客保護・利用者利便の向上（適正かつ安全な金融取引の確保、相談・苦情等への適切な対応、顧客に対する適切な説明、利用者利便向上への取組み）」等が挙げられております。

金融機関経営においては、経営を取り巻く内外の経済・金融環境が大きく変化中、その環境変化を的確に把握しつつ、金融機関全体を貫く経営管理（ガバナンス）態勢の有効的機能発揮を目指し、本事務年度の監督・検査方針に対応した実効性のある内部監査・検査・コンプライアンス・リスク管理態勢

11月24日（火）1日目

9:30～ 開 場 9:55～ オリエンテーション

10:00
11:30 「金融機関における内部監査の現状と高度化への課題」

FIAP & FFR座長

日本銀行 金融機構局 金融高度化センター 企画役 公認内部監査人(CIA) 内部統制評価指導士(CCSA) 公認金融監査人(CFSA) 確井 茂樹 氏

FIAP (Financial Internal Audit Practice Working Group) は、社団法人日本内部監査協会・CIAフォーラム「金融内部監査実務」研究会の略称。

FFR Forum of Financial technology and Risk management は、社団法人日本内部監査協会・CIAフォーラム「金融工学とリスクマネジメント高度化」研究会の略称。

【確井 茂樹(うすい しげき)氏】

1983年京都大学経済学部卒業、日本銀行入行。94年7月検査局副調査役、96年5月福岡支店営業課長、99年1月検査局検査課調査役、2002年11月検査局金融課調査役、05年7月金融機構局金融データ管理担当企画役、06年10月金融機構局金融高度化センター企画役に就任、現在に至る。実地調査、オフサイト・モニタリングを担当した後、金融高度化センターでは、各種リスク管理、内部監査の高度化に係る実務の調査研究、支援・サポート活動に従事。

11:30～12:30 昼 食

12:30
14:15 「当局検査・監督の最新動向と内部監査態勢高度化の課題
—平成21検査事務年度検査基本方針・金融検査指摘事例集を踏まえた内部監査上の対応策—」

新日本有限責任監査法人 金融アドバイザーサービス部 シニアパートナー 公認会計士・公認不正検査士 牧野 明弘 氏

【牧野 明弘(まきの あきひろ)氏】

早稲田大学法学部卒業。1990年10月太田昭利監査法人(現新日本有限責任監査法人)入所。98年6月金融監督庁(現金融庁)発足時に初の民間登用の一人として入庁。同年8月より、「金融検査マニュアル検討会」にて委員を務め、「金融検査マニュアル」の作成に関与。その後、銀行、生命保険会社等の検査に数多く従事。2000年9月に現職に復帰後、コンプライアンス態勢・リスク管理態勢・内部監査態勢の構築支援等を数多く手掛けている。金融財政事情研究会、全国地方銀行協会等において、金融機関経営者向けトップマネジメントセミナー講師等を多数担当。主な著書に、『Q&A金融検査マニュアル改訂のポイント』、『金融機関の内部統制・改訂版』、『統合リスク管理』(いずれも共著、金融財政事情研究会刊)、通信教育講座『保険検査マニュアル実践講座 損害保険コース』(共同監修・共同執筆、損害保険事業総合研究所刊)等がある。

14:30
16:00 「グローバル金融危機後のリスク管理改革像の展望
—監督・検査体制の展開方向と金融機関の対応戦略—」

あらた監査法人 リスク・コントロール・ソリューション部 ディレクター 大山 剛 氏

【大山 剛(おおやま つよし)氏】

一橋大学経済学部卒業。米国ジョージ・ワシントン大学金融学修士。日本銀行入行。国際通貨基金エコノミスト(94～97年)その後日本銀行に戻り、調査統計局、金融機構局参事役を経て現職。日本銀行金融機構局では、不良債権問題の処理に関するプロジェクトを率いたほか、バーゼル委員会傘下の数多くのグループにおける日本銀行代表メンバーとして、グローバルな議論をリードする。この他、経済資本運営、バーゼルIIIのIRB(内部格付手法) AMA(先進的計測手法)の第一人者として、海外・国内で開催される数多くのリスク管理関連コンファレンスでスピーカーや議長役を務める。金融機関におけるリスク管理の議論を国際的にリードする非営利団体であるGARP(Global Association of Risk Professionals)の日本地区理事。著書に『グローバル金融危機後のリスク管理』(09年3月金融財政事情研究会刊、11月にはWiley社より英語版も出版される予定)がある。

の確立が、強く求められてきていると申せましょう。

そこで、本セミナーでは、最新の内部監査・検査・コンプライアンス・リスク管理のあり方と実際の対応策を捉えるべく、各界から講師をお招きいたします。金融機関における内部監査の現状と高度化に向けた課題、当局検査・監督動向と内部監査態勢の対応策に加え、各金融業態からは、信用リスク管理の高度化態勢構築策と相まっての内部監査上の留意点、高度化が求められつつある内部監査・検査態勢の実際(考え方と方法)につき報告いただきます。さらに今回、今後監査の観点からも重要となる「グローバル金融危機後の金融規制改革動向とそれに対応したリスク管理改革像の展望」また、本年6月から金融商品取引法・銀行法等の改正により金融機関の自主的整備が求められている「利益相反管理態勢を通じた顧客保護管理態勢の充実策と内部監査上の留意点」や「新型インフルエンザ対策とBCP策定の実際」につき、それぞれの分野に詳しい専門家から解説していただくなど、多角的なセミナー構成となっております。

また、一日目の夕刻に、ご参加者相互の交流・情報交換の場も設定いたしました。

ご聴講の皆様には、必ずや新しい経営環境に適応した監査・検査・コンプライアンス・リスク管理態勢構築に向けた指針を提供できるものと確信いたしております。ぜひ、本セミナーへのご参加のご検討をお願い申し上げます。

16:15

「信用リスク管理・CPM(クレジットポートフォリオマネジメント)高度化の実際

— 監査上の留意点を含めて —

17:45

三菱東京UFJ銀行 融資企画部 CPMグループ兼信用リスクグループ 上席調査役 / チーフオフィサー 青沼 君明 氏

【青沼 君明(あおぬま きみあき)氏】

東京大学大学院数理科学研究科博士課程修了(数理科学博士)1977年ソニー株式会社入社。90年三菱銀行(現、三菱東京UFJ銀行)入行、現在に至る。(兼務)東京大学大学院数理科学研究科客員教授、大阪大学大学院基礎工学研究科招聘教授、一橋大学大学院経済学研究科客員教授。著書に、『金融リスクの計量化(下)クレジット・リスク』(98年)、『クレジット・リスク・モデル』(01年)、『Excelで学ぶファイナンス 債券・金利・為替』(02年)、『Excel&VBAで学ぶファイナンスの数理』(03年)、『Excelで学ぶパーゼルと信用リスク評価手法』(08年)、『Excel&VBAで学ぶVaR』(09年)、『Excel&VBAで学ぶ金融統計の基礎』(09年)、『いずれも共著、金融財政事情研究会刊)』、『金利モデルの計量化』(00年共著、朝倉書店)ほか、学術論文多数。訳著に『デリバティブ入門』、『フィナンシャル・エンジニアリング 第5版』(いずれも共訳、金融財政事情研究会刊)ほか。

17:45 ~ 18:30

レセプション(情報交換会)

11月25日(水) 2日目

10:00

「監査における顧客保護等管理態勢構築上の留意点

— 利益相反管理態勢を中心に —

11:30

十六銀行 リスク統括部 コンプライアンス統括グループ 主任調査役 宇佐美 豊 氏

【宇佐美 豊(うさみ ゆたか)氏】

1986年東海銀行(現、三菱東京UFJ銀行)入行、国内営業勤務を経て、本部で不良債権の回収・管理業務に携わる。その後、資産監査・信託監査に関する企画や当局との対応、銀行全体の内部監査に係る企画や内部統制構築等の業務に従事。2006年4月より十六銀行リスク統括部コンプライアンス統括グループに在籍。現行業務の傍ら、金融財政事情研究会、全国地方銀行協会、全国労働金庫協会、全国各地の金融機関の研修講師や講演、執筆活動を行う。公認不正検査士(CFE) 日本公認不正検査士協会銀行研究部会幹事。日本内部統制研究会会員。主な著書・論文に『改訂金融検査マニュアル下の内部管理態勢Q&A』(07年共著)、『よくわかる金融内部監査 素朴な疑問への回答』(08年)、『よくわかる金融機関の不祥事件対策』(09年共著)、『いずれも金融財政事情研究会刊)』、『不正のトライアングル』がそろとう横領リスクは危険水準に達する』(『週刊金融財政事情』07.8.27号(共著))、『内部管理態勢の強化 不正リスクマネジメントのポイント』、『リジョナルバンキング』07.12月号(第二地方銀行協会))、『座談会 地域金融機関は弁護士に何を求めているか』、『旬刊金融法務事情』08.5.5・15合併号)、『パート等の不満にはびこる不祥事の根』、『週刊金融財政事情』08.9.22号)』

11:30 ~ 12:30

昼食

12:30

「静岡銀行の内部監査の考え方と方法」

静岡銀行 理事監査部長 杉本 操 氏

14:00

【杉本 操(すぎもと みさお)氏】

1981年静岡銀行入行。銀座支店、富士支店、人事部人事課、沼津支店を経て、98年6月検査部検査役、同年12月蒲原支店長、2000年6月経営企画部企画グループ調査役、03年6月経営企画部企画グループ長、05年6月新宿支店長、07年6月豊橋支店長、09年4月監査部担当部長、同年6月理事監査部長に就任、現在に至る。

14:30

「新型インフルエンザ対策とBCP(業務継続計画)策定の実際

— 危機管理と監査 —

16:00

損保ジャパン・リスクマネジメント BCM事業本部 主任コンサルタント 石井 和尋 氏

損保ジャパン・リスクマネジメント

リスクリデュクション手法の多様化・高度化に的確に対応し、リスク評価技術と事業継続計画(BCP)策定などのリスクコンサルティングに強みを有する総合リスクマネジメント事業会社として定評を得ている。

【石井 和尋(いしい かずひろ)氏】

2006年4月株式会社損保ジャパン・リスクマネジメント入社。以来、地域金融機関や大手製造業の事業継続計画(BCP)策定支援に従事。公認内部監査人(CIA)

セミナーの講演タイトル、講師は都合により変更となることがあります。予めご了承のほどお願い申し上げます。

参加要領

[期 日] **2009年11月24日(火)~25日(水)【2日間】**

[定 員] **70名**

お申込み多数の場合は、受付順に締め切らせていただく場合がありますことをご了承願います。

[聴 講 料] **58,800円**(テキスト代、2日間の昼食代、レセプション費用を含む)うち消費税2,800円)

申込方法

- 1 同封の申込書にご記入のうえ、FAXまたは郵便にて下記申込先宛お送り願います。
- 2 申込書到着後、請求書と聴講証をお送りいたします。開催3日前までに届かない場合にはご連絡願います。
なお、期日切迫してからのお申込みの場合には、聴講証は会場にてお渡しいたします。
聴講料のお振込みは請求書到着後開催日までをお願いいたします。
- 3 セミナー開催日3日前までにご連絡なく欠席された場合、聴講料の請求をさせていただきます。
聴講料の払戻しはいたしませんので予めご了承願います。
- 4 領収証ご入用の場合は、振込み受領書(コピー可)をお送り願います。

お願い

テキスト、資料等は当日会場でお渡しいたします。
レコーダーなどの記録機器の持込みはご遠慮ください。
聴講料の払戻しはいたしません。
参加される方がご都合の悪い場合は、代理の方のご出席をご考慮願います。

申込先

FAX送付の場合

事務局「ニューバンキングセミナー」係
FAX 03-3359-7947

郵送の場合

〒160-8519 東京都新宿区南元町19
(社)金融財政事情研究会 6階
事務局「ニューバンキングセミナー」係
TEL 03-3358-1161(直通)

企画内容・会場についてのお問合せ先:

(社)金融財政事情研究会 セミナー企画担当
TEL 03-3358-0018(直通)

会場ご案内

〒160-8520 東京都新宿区南元町19
金融財政事情研究会 本社ビル2階



JR総武線「信濃町」駅下車・徒歩2分
東京メトロ銀座線・半蔵門線、
都営大江戸線「青山一丁目」駅下車・徒歩10分