

平成 21 年 6 月 吉日

各位

日本保険・年金リスク学会
研修会担当理事
伊藤・河野・栗山・清水・福田

JARIP 平成 21 年度第 1 回研修会のご案内

拝啓 時下益々ご清栄のこととお喜び申し上げます。

日本保険・年金リスク学会（JARIP）の平成 21 年度第 1 回研修会を下記のとおり開催しますので、
各位の積極的なご参加をお願い申し上げます。

敬具

記

1. 研修会の概要（詳細は別紙）

テーマ：マクロストレスを考慮した金融リスク管理の高度化

講師：菅野 正泰（神奈川大学経営学部准教授）

日時：2009 年 7 月 30 日（木） 15：00～17：30

場所：三井住友海上 新川ビル会議室（中央区新川 2-27-2）

2. 参加申込（E-mail で申し込み願います）

- ・ **申込方法**：メール・タイトルは「7月30日JARIP研修会申込」として下さい。
参加者氏名、個人会員・法人会員・学生会員・非会員の区別、組織名、E-mailアドレス、
電話番号、及び領収書が必要な場合はその旨を明記
（事前に領収書必要の連絡がなかった方には、領収書を発行しません）。
- ・ **申込先**：TO: office@jarip.org（JARIP事務局）
CC: toshihiro_kawano@slapc.com（〃研修会担当 河野 年洋）
- ・ **申込〆切**：7月23日（木）

3. 参加費

会員；1,000 円、学生会員；無料、非会員；5,000 円

（法人会員は、3名までは1人当たり1,000円、それ以上は1人当たり5,000円となります）

参加費は、研修会当日、会場受付にてお支払い下さい。

以上

A. 講義概要「マクロストレスを考慮した金融リスク管理の高度化」

サブプライムローン問題に端を発する世界的な金融危機の中、先般金融安定化フォーラムより、銀行経営の健全性を高めるための報告書が出され、不況時には銀行に資本の取り崩しを認める一方で、好況時には、現在の最低所要自己資本よりも積み増すべきという景気循環増幅効果（プロシクリシティ）に関する提言がなされました。そこで、先進的な欧州の取り組み状況をいくつか紹介し、対応方法を考えてみたいと思います。

また、今金融危機の対応策として、ストレス・テストが注目されています。先の米銀行持株会社 19 社の健全性審査でもストレス・テストが実施されていますが、金融リスク管理におけるマクロストレスに対処するための有力な方策として、ストレス・テストの基本概念を整理し、活用について考えてみたいと思います。

その他トピックとして、統合リスク計測のためのリスク合算の手法について、金融機関の実施例を参考に、いくつかのアプローチの特徴を整理してみたいと思います。

B. 講師プロフィール

菅野 正泰

- ・ 京都大学大学院経済学研究科博士後期課程修了 博士（経済学）
- ・ 2009 年 4 月より、神奈川大学経営学部准教授（農林中央金庫勤務を経て、前職の新日本有限責任監査法人アーンストアンドヤングのグローバル金融リスクコンサルティング部門では、メガバンク、政府系金融機関、地方銀行、保険会社、金融庁などへのリスクアドバイザー業務を数多く担当）
- ・ 専門はファイナンス。学部・院のファイナンス関連科目を担当。研究テーマはリスク管理
- ・ 著書に、『信用リスク評価の実務』（中央経済社、2009 年 4 月刊行）

C. 研修会日時：2009 年7月30日(木) 15:00～17:30

D. 場所：三井住友海上 新川ビル会議室（添付の地図参照）

東京都中央区新川 2-27-2

最寄駅 JR 東京駅 八重洲南口 1 番バス乗り場より

都営バス（東 16 系統）10 分住友ツインビル前下車

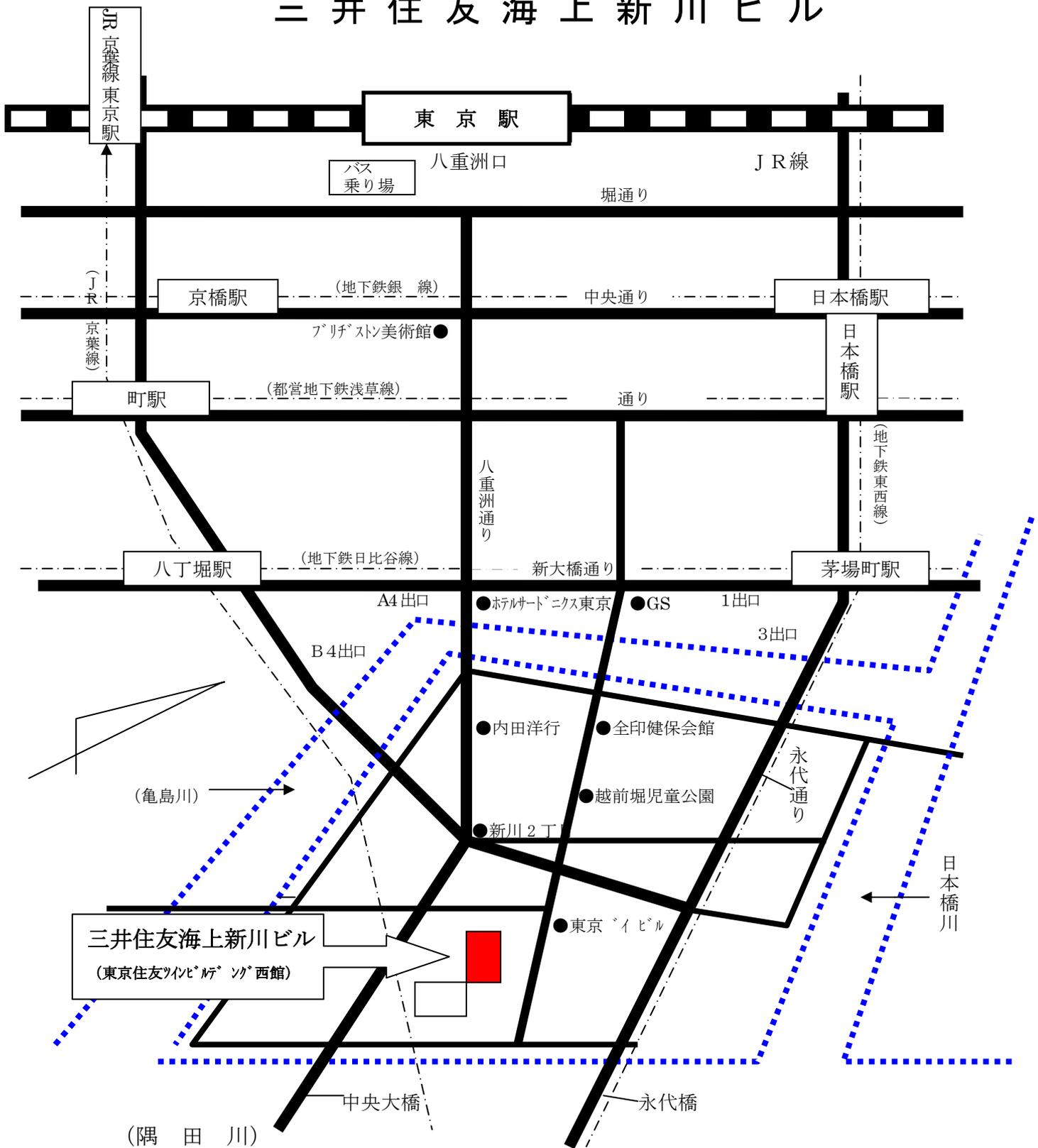
JR 京葉線 八丁堀駅 徒歩 8 分（B4 出口）

地下鉄日比谷線 八丁堀駅 徒歩 8 分（A4 出口）

地下鉄東西線 茅場町駅 徒歩 12 分（1 出口）

以上

三井住友海上新川ビル



東京都中央区新川二丁目27番2号

三井住友海上火災保険株式会社

電話 (03) 3297-1111

最寄駅 JR東京駅 八重洲南口1番バス乗り場より

都営バス (東16系統) 10分住友ツインビル前下車

JR京葉線 八丁堀駅 徒歩8分 (B4出口)

地下鉄日比谷線 八丁堀駅 徒歩8分 (A4出口)

地下鉄東西線 茅場町駅 徒歩12分 (1出口)