

# 『為替リスクマネジメント』の基礎知識

～ 経営管理部門、経理部門、監査部門など関連部門のスタッフに  
求められる為替リスクマネジメントの基礎知識を平易に解説 ～

《開催要領》 ※講師とご同業の方のご参加はお断りする場合がございます。※最少催行人数に満たない場合、開催中止とさせて頂く場合がございます。

日時▶ 2019年9月25日(水) 13:00～17:00

会場▶ 企業研究会セミナールーム(東京:麹町)

《開催にあたって》

過去、アジア通貨危機・リーマンショックに代表されるように、為替変動は企業経営に大きな影響を与えてきました。また、経済のグローバル化に伴い、企業経営上、為替リスクを適切に管理する重要性が益々大きくなってきています。本セミナーでは、経営企画部門、財務経理部門、内部統制部門等の経営管理を所管する部門や内部監査部門に従事する職員がおさえておくべき為替リスクマネジメントの基礎を、昨今の実務事例から体系的に整理して解説致します。特に、外国為替の実務から、為替変動リスクの特定・評価・管理に係るPDCAサイクルについて、具体的事例を基に分かり易く解説致します。

講師 東京国際コンサルティング株式会社 代表取締役 小黒 直樹 氏



講師紹介  
早稲田大学理工学部卒、早稲田大学大学院理工学研究科修了。大手邦銀に入行後、市場リスク・ALM、など先端的なリスク管理体制の構築、リスク管理実務に携わる。国際的監査法人グループ KPMG のコンサルティングファームを経て現職。大手事業法人や金融機関に対して、リスクマネジメント体制の構築、リスクアセスメントや計量化手法のアドバイス等のリスクマネジメントに関するコンサルティングを数多く手掛けている。(社)日本証券アナリスト協会検定会員。基本情報技術者。

《申込方法》 当会ホームページ (<https://www.bri.or.jp>) からお申し込み下さい。

企業研究会Q 検索

■受講料: 1名(税込・資料代含) ※申込書をFAXでご送信いただく際は、ご使用のFAX機の使用状況(0発信の有無など)をご確認の上、FAX番号をお間違えないようご注意ください。

正会員	34,560円 (本体価格 32,000円)	一般	37,800円 (本体価格 35,000円)
-----	------------------------	----	------------------------

191559-0101 『為替リスクマネジメント』の基礎知識

ふりがな 会社名			
住所			
TEL			FAX
ふりがな ご氏名			所 属 役 職
E-mail			

※申込書にご記入頂いた個人情報は、本研究会に関する確認・連絡および当会主催事業のご案内をお送りする際に利用させていただきます。

■申込・参加要領 : 当会ホームページからお申込みください。FAX、または下記担当者宛 E-mail からもお申込み頂けます。

後日(開催日1週間～10日前まで)に受講票・請求書をお送り致します。

※よくあるご質問 (FAQ) は当会 HP にてご確認いただけます。([TOP]→[公開セミナー]→[よくあるご質問])

※お申し込み後のキャンセルはお受け致しかねますので、ご都合が悪くなった場合、代理出席をお願いします。

■お申込・お問合わせ先: 企業研究会 公開セミナー事業グループ 担当/民秋・川守田 E-mail: [tamiaki@bri.or.jp](mailto:tamiaki@bri.or.jp)

TEL: 03-5215-3514 FAX: 03-5215-0951 〒102-0083 東京都千代田区麹町 5-7-2 MFPR 麹町ビル 2F

## ・プログラム・

### 1. 外国為替の実務

- (1) 外国為替取引の概要
- (2) 外国為替市場と相場
  - ・ 公示相場、オファーとビット、直物取引、先物取引、スワップ取引
- (3) 外国為替相場の決定要因
  - ・ 購買力平価、金利平価

### 2. 為替リスクマネジメントの基礎

- (1) 為替リスクとは?
- (2) 為替リスクが企業経営に与える影響
- (3) 為替リスクマネジメントのフレームワーク

### 3. 為替リスクの評価方法

- (1) リスクアセスメント
- (2) 為替ポジションと具体的計算方法
- (3) 感応度分析
- (4) 統計理論による数値化方法
- (5) Excel による過去データを用いたリスク評価事例

### 4. 為替リスクのマネジメントと実務

- (1) 為替リスクの限度額管理
- (2) 為替リスクの削減方法(ヘッジ)
  - ・ 為替マリー、リーズアンドラクス
  - ・ 為替デリバティブ取引(為替予約、通貨オプション、通貨スワップ)
- (3) 海外子会社からの投資資金の回収におけるリスク、リスクヘッジ手法
- (4) 輸出入に関するリスク、リスクヘッジ手法
- (5) 為替オペレーションの評価

### 5. 為替リスクマネジメントの具体的事例

- (1) 連結ベースの為替リスクの見える化と限度管理
- (2) 連結ベースの為替リスクマネジメント態勢
- (3) 為替リスクの制御方法(ヘッジとパフォーマンス評価)

※最少催行人数に満たない場合、開催中止となる場合がございます。

裏面もご覧下さい! 一枚のパンフレットで  
2種類のセミナーをご案内しております。