

# 銀行勘定の金利リスク管理規制 (IRRBB)を踏まえた対応と対策

講師 おぐろ なおき  
**小黒直樹氏**

東京国際コンサルティング株式会社  
代表取締役

講師 しおいり あつし  
**塩入 篤氏**

株式会社 AFG 取締役

日時 平成29年3月22日(水) 午後1時00分~午後4時00分

銀行勘定の金利リスク管理規制(IRRBB)について、最終版がバーゼル銀行監督委員会より昨年4月21日に公表されました。本セミナーでは、IRRBB規制の概要とその影響とポイントをまとめ、今後どのような対応が必要になるかを整理した上で、実務的なポイントと対処の方向性について解説致します。

## 1. IRRBB 規制の概要とポイント

- (1) IRRBB 規制で対応すべき金利リスク
- (2) 金利シナリオ
- (3) NMDs (non-maturity deposits) の取扱い
- (4) NMDs 以外の行動オプションの取扱い
- (5) 自動オプションの取扱い
- (6) EVE (economic value of equity) の計測
- (7) NII (net interest income) の計測

## 2. 具体的な対処方法

- (1) 必要データ
- (2) コア預金モデル
- (3) 固定貸出の繰上返済モデル
- (4) 定期預金の早期解約モデル
- (5) 各モデルの検証のあり方
- (6) データベースの整備
- (7) IRRBB 規制で求められる ALM

### 【小黒直樹氏】

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、リスクヘッジ手法を含むリスクマネジメント体制の構築、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。

### 【塩入 篤氏】

京都大学経済学部経済学科卒業。東京大学大学院経済学研究科理論経済学専攻修士課程修了。ソロモンブラザーズアジア証券入社後、ソロモンブラザーズインクニューヨーク本社投資銀行本部、富士銀行(現みずほ銀行)米州営業部勤務を経て、米系証券会社にてクレジット商品の開発・ストラクチャリング・マーケティングに従事。UBS証券債券本部において金融機関に対し規制や資本政策等を提案するソリューションビジネスを推進する金融商品営業部長を歴任。現在、株式会社 A F G 取締役。

※録音・ビデオ撮影はご遠慮下さい。



開催日

平成29年3月22日(水)  
13:00~16:00

会場

茅場町・グリーンヒルビル  
金融財務研究会本社 セミナールーム  
東京都中央区日本橋茅場町 1-10-8  
TEL 03-5651-2030  
地下鉄東西線・日比谷線 茅場町駅  
6番出口より徒歩1分  
(開場は開演の30分前です。)

参加費

1名につき34,700円

(消費税、参考資料を含む。)

1社2名以上同時に参加お申込みいただいた場合、お2人目から1名につき29,000円。追加申込みの場合は、その旨ご記入下さい。

申込先

金融財務研究会 ホームページ <http://www.kinyu.co.jp/>  
〒103-0025 東京都中央区日本橋茅場町 1-10-8 グリーンヒルビル  
TEL 03-5651-2030 FAX 03-5695-8005

申込方法

ファックス又は郵便にて参加申込書をお送り下さい。上記ホームページの申込欄からもお申込みいただけます。折り返し、受講証と請求書を郵送致します。参加費は下記の普通預金口座に開催日前日までにお振込み下さい。(但し経理の都合等で間に合わない場合は、ご連絡いただければお待ちいたします。)参加費の払戻しは致しませんので申し込まれた方がご都合の悪い時は代理の方がご出席下さい。又当日ご参加になれなかった場合、当社および経営調査研究会主催の他のセミナーに無料でご出席いただけます。(但し新しいセミナーの参加費との差額が2,000円以上の時は差額をお支払いいただきます。また、振替は1年以内にお願いたします。)ご記入いただきました個人情報、当社および関係会社の受講者名簿の整備や今後開催されるセミナーのご案内等に使用します。

振込口座

普通預金 口座名 (株)金融財務研究会

三菱東京UFJ銀行	本店	1642356	三井住友銀行	本店営業部	7397637
三菱UFJ信託銀行	本店	2818151	みずほ銀行	東京営業部	1427715
三井住友信託銀行	本店営業部	2993982	りそな銀行	東京営業部	1693669

----- 切らずにこのままお送り下さい -----

銀行勘定の金利リスク管理規制  
(IRRBB)を踏まえた対応と対策

3/22

参加申込書

FAX 03-5695-8005

平成29年 月 日

ご連絡・講師へのご質問等ご記入下さい	会社名	TEL FAX		
	所在地	E-Mail 〒		
	参加者ご氏名	部課名		
	〃	〃		
	〃	〃		
	〃	〃		
	*セミナーコード 0543 (Ris-290543)	書類送付先 (同上の場合記入不要)	ご担当者 TEL	部課名 FAX

お申込の翌日には「受講証・請求書」を発送しておりますが、お手元に届かない場合は、弊社までご連絡下さい。