

バーゼル新自己資本比率規制の内容と 影響についての考察

～標準的手法・内部格付手法の改定論点～

講師 かんざき ゆうご
神崎有吾氏

新日本有限責任監査法人
金融事業部 シニアマネージャー

講師 きむら しゅうご
木村秀吾氏

ソニー銀行株式会社
総合リスク管理部 シニアマネージャー

日時 平成30年1月25日(木)午後1時30分～午後4時30分

2017年12月7日夜、バーゼル新規制の内容が急きょ、合意に至り、多くの銀行関係者を驚かせています。2006年のバーゼルⅡ移行以来、バーゼル規制の内容は段階的に変化してきましたが、今回の合意は、これまではない大きな変更内容になっており、銀行のリスク管理・経営管理の枠組みだけではなく、銀行の投融资行動自体に大きな影響があると思われます。

今回のセミナーでは、バーゼル新規制の内容のみならず、その影響や導入上のポイントについて、実務的な観点から平易な言葉で、説明を行う予定です。

1. バーゼル規制全体の枠組み

- (ア) バーゼル規制の歴史・流れ
- (イ) 資本とのリスクの関係
- (ウ) 自己資本比率の最低水準(8%と4%)の意味
- (エ) リスク量と損失(EL、UL)、バーゼルⅢの資本改革、国際基準と国内基準

2. 標準的手法改定の論点

- (ア) リスクウェイト変更点
- (イ) 改定の影響と主な論点

3. 内部格付手法改定の論点

- (ア) リスクウェイト変更点
- (イ) 改定の影響と主な論点

4. ソブリンの取り扱いにかかる検討の方向性

5. 今回の改定が経営管理・リスク管理に与える影響

- (ア) 手法の選択(標準的手法 - 基礎的内部格付手法 - 先進的内部格付手法)
- (イ) バランスシート管理
- (ウ) リスクアペタイトフレームワーク
- (エ) ストレステスト

* 同業者(監査法人やコンサルティングファーム)からの申込みはお断りすることがございます。

【神崎有吾氏】格付投資情報センター・金融工学研究所を経て、大手監査法人に入所。統合的リスク管理(ERM)や信用リスクに対するコンサルティングや会計監査に従事。2009年～2011年、金融庁監督局総務課バーゼルⅡ推進室に出向し、バーゼルⅡ(信用リスク、市場リスク、オペリスク)の業務に従事。2015年に新日本有限責任監査法人入所後は、統合的リスク管理(ERM)の整備・高度化支援、各リスクの計量化・モデル構築支援、内部監査サポート、国内外の規制遵守に係るアドバイザリーを提供。

著書等:『これで納得!信用格付モデルの実際』(共著、金融財政事情連載)。

【木村秀吾氏】2013年～2014年金融庁総務企画局総務課国際室課長補佐、バーゼル銀行監督委員会傘下の部会メンバーとしてバーゼル規制の策定に従事。金融機関勤務後、金融庁、大手監査法人を経て現職。

著書等:「大口信用供与等規制はどう変わるか」(金融財政事情)。主なセミナー「バーゼル規制の改正動向を踏まえた信用リスク管理の実務」(セミナーインフォ)など。

※録音・ビデオ撮影はご遠慮下さい。



開催日

平成30年1月25日(木)
13:30~16:30

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34,900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は、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

バーゼル新自己資本比率規制の内容と影響についての考察

1 / 25

参加申込書

FAX 03-5695-8005

平成 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 0155 (Fin-300155)	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。