

バランスシート・モデルの高度化と 新しいリスク管理の枠組み

ながかわひでとし
講師 **中川秀敏氏** 一橋大学大学院 経営管理研究科 教授

日時 平成30年9月19日(水) 午後1時30分～午後4時30分

金融機関でも一般事業会社でも「バランスシート(B/S)」は、その企業の倒産リスクを評価する上で重要な情報源であることは言を俟たない。従来は、B/Sに基づくリスク計量モデルを考える際には、モデルをいたずらに複雑にすることは学術的に必要がほとんどなく、実務的にも必ずしも良い選択肢とは言えなかった。

しかし昨今の金融ビジネスの情報化の急激な進展とともにB/Sに関するデータは質と量の両面で飛躍的に向上していくことが期待される。このようなデータ環境の向上を見据えて、B/Sモデルに基づくリスク管理の枠組みをモデルの高度化という視点で改めて検討することは学術的だけでなく実務的にも有望な方向と考える。

本セミナーではB/Sと金融リスク管理のこれまでと、今後予想される展開について整理をするとともに、いくつかの萌芽的な応用事例について紹介する。

1. バランスシート・モデルの高度化と金融リスク管理

- ① バランスシートに基づくこれまでのリスク管理の概要
- ② 「バランスシート・モデル」の高度化に注目する理由
- ③ 「バランスシート・モデル」の高度化の必要条件

2. バランスシート・モデルのリスク管理への応用事例

- ① ストレステストへの波及
- ② Conic Finance (錐形ファイナンス) に基づく企業のデフォルトリスク評価への応用
- ③ カウンターパーティリスク(XVA)など、その他の事例

【講師略歴】

2000年3月：東京大学大学院数理科学研究科博士課程を修了。博士(数理科学)。
2000年4月～2003年1月：株式会社エムティービーインベストメントテクノロジーズ研究所(現・株式会社三菱UFJトラスト投資工学研究所) 研究員。
2003年2月～2008年3月：東京工業大学 理財工学研究センター助教授、大学院イノベーションマネジメント研究科助教授(2007年4月より准教授)。
2008年4月～2018年3月：一橋大学大学院国際企業戦略研究科准教授。
2018年4月より現職。
著書として、『クレジット・リスク・モデル』(共著、金融財政事情研究会、01年)、『オペレーショナル・リスクのすべて』(共著、東洋経済新報社)。
訳書として、『ファイナンスへの確率解析』(共訳、朝倉書店、00年)、『リスク・マネジメント』(共訳、共立出版、05年)、『定量的リスク管理』(共訳、共立出版、08年)、『クレジット・デリバティブ』(監訳、ピアソンエデュケーション、08年)。

※録音・ビデオ撮影はご遠慮下さい。

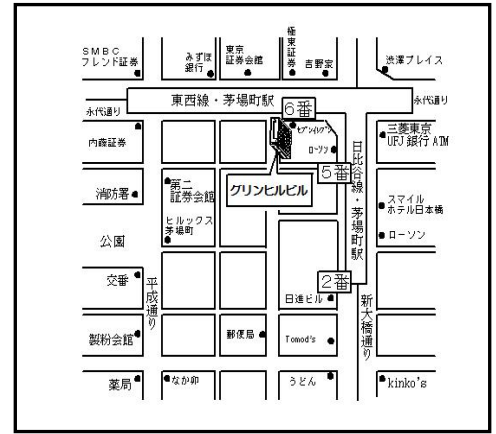


開催日

平成30年9月19日(水)
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34,600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 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

バランスシート・モデルの高度化と
新しいリスク管理の枠組み

9 / 19

参加申込書

FAX 03-5695-8005

平成30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 1775 (Fin-301775)	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。