

ノンリコースローン・アセットファイナンス 評価モデル構築の重要論点

～アプローチから、課題、検証手法まで～

かんざきゆうご
講師 **神崎有吾氏**

EY新日本有限責任監査法人
金融事業部 アソシエイトパートナー

日時 平成30年9月20日(木) 午後1時30分～午後4時30分

ノンリコースローンやアセットファイナンスについての評価モデルについては、各金融機関で大きなばらつきが生じています。通常のコーポレートであれば、デフォルト実績や外部格付等の教師データに基づき、統計的な手法でモデル化することが可能ですが、ノンリコースローンやアセットファイナンスについては、デフォルト実績データが僅少であり、統計的な手法を用いることは容易ではありません。

今回のセミナーでは、ノンリコースローンやアセットファイナンスをモデル化する方法を詳しく説明すると共に、なぜ(自己資本比率を算出する)リスクウェイトに信じがたい差異が生まれるのか等、どのように検証を行うべきか等の実務上の論点について、詳細を説明致します。

1. ノンリコースローン・アセットファイナンスに対する格付付与方法の分類と類型
2. バーゼル規制
 - ① 現行規制(標準的手法、内部格付手法)
 - ② 新手法(改定標準的手法、改定内部格付手法)
3. 各資産別の評価モデルに係る論点
 - ① 不動産ファイナンス
 - ② プロジェクトファイナンス
 - ③ 航空機ファイナンス / 船舶ファイナンス
4. モデル検証
5. その他の論点 (ハードルレートの設定やDCF法の割引率の設定、PDやLGDの設定、ストレステスト等)

※ご同業の方からのお申し込みはお断りさせて頂く場合がございますので、ご了承ください。

【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)。

※録音・ビデオ撮影はご遠慮下さい。

■主催 **金融財務研究会**
http://www.kinyu.co.jp

Facebook: <http://www.facebook.com/keichoken>
Twitter: <https://twitter.com/#!/keichoken>
Blog: <http://kinyu.co.jp/blog/>



開催日

平成30年9月20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34,700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お申し込みいただけます。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 -----

ノンリコースローン・アセットファイナンス
評価モデル構築の重要論点

9 / 20

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 1787 (Fin-301787)	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。