

# 金融機関のストレステストに係る最新実務

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12月19日（水）午後2時00分～午後5時00分

ストレステストの位置づけや役割は、約20年における歴史の中で、大きく変わっています。そこで、ストレステストの歴史的な経緯を踏まえ、ストレステストに係る現在の論点、将来的な論点について解説を行います。特に、近年話題になっているマクロストレステストに係る最新の实務について、詳細な解説を行います。

本セミナーでは、銀行や保険会社等の金融機関を対象に「シナリオの策定から、損失額決定までのプロセスについて、詳しい解説を行うこと」、さらに「機械的に処理すべき部分とエキスパート判断に依拠する部分を明確化すること」を目標としています。他社事例や外部コンサルにしたがって、制度設計していることがほとんどだと思いますが、見落としている重大な事実はないでしょうか？皆様がやっている実務を見直し、高度化するための材料を提供する予定です。

## 1. ストレステストの種類と分類

## 2. マクロストレステスト構築プロセス

- ①シナリオの策定
- ②マクロ指標の設定
- ③感応度計算
- ④損失額計算

## 3. マクロ指標の考え方・利用方法

## 4. 感応度計算に係る留意点

（感応度をコントロールする手法や技術）

## 5. リスクアペタイトフレームワーク・再生計画におけるストレステスト

## 6. 将来予想を踏まえた引当制度構築の実務とストレステストの関係

## 7. その他

（非財務リスクの把握やマイナス金利対応は予想できたのか？等の重要事項）

※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**  
https://www.kinyu.co.jp

Facebook : <https://www.facebook.com/keichoken>

Twitter : <https://twitter.com/#!/keichoken>

Blog : <https://kinyu.co.jp/blog/>



開催日

平成30年12月19日(水)  
14:00~17:00

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。)

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。

参加費

申込先

金融財務研究会 ホームページ <https://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年以内にお問い合わせいたします。)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 -----

FAX 03-5695-8005

金融機関のストレステストに係る最新実務

参加申込書

12/19

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	
		E-Mail	
	所在地	〒	
	参加者ご氏名	部課名	
	〃	〃	
	〃	〃	
	〃	〃	
書類送付先 (同上の場合記入不要)	ご担当者 TEL	部課名 FAX	

\*セミナーコード 2397 (Fin-302397)

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。