

# 「マイナス金利下の ALM/証拠金規制対応」

## マイナス金利を戦略的優位に変える/証拠金規制への効率的な対応

主催:有限責任監査法人 トーマツ

有限責任監査法人 トーマツでは、マイナス金利下の ALM、証拠金規制対応についてセミナーを開催させていただきます。

ご高承の通り、日銀によるマイナス金利の導入は、本邦金融機関の ALM を大きく変えようとしています。資金収益の低迷が今後長期化する可能性もあり、金融機関の ALM 引いてはバランスシートコントロールは、金融機関経営に直結する課題になりつつあります。今回のセミナーでは、いち早くマイナス金利を経験している、欧州系の金融機関の事例を踏まえて、本邦の金融機関様がとるべき方策の一端をご紹介します。

また、今年 9 月から導入される店頭デリバティブの各国の最終案並びに本邦での規制の内容も金融庁より、パブリックコメントに付される予定です。これらの最終案並びにデリバティブ業界の中心的な役割を果たしている ISDA の動向等を踏まえて、各金融機関の対応の最新状況をご説明すると共に、トーマツとして、より効率的且つ安定的に証拠金規制に対応する仕組みの提案をご紹介します。

ご多用の毎日とは存じますが、万障お繰り合わせのうえ、ぜひご参加くださいますようお願い申し上げます。

■開催日時 2016 年 4 月 26 日(火) 14:00-17:00

■内容

時 間	内 容	講 師
14:00-14:10	開会のご挨拶	パートナー 桑原 大祐
14:10-15:10	マイナス金利下のALM –欧州系金融機関の事例を踏まえて–	シニアマネジャー 大島 一朗
15:10-15:25	質疑・応答	同上
15:25-15:40	休憩	
15:40-16:40	これからの担保管理 –証拠金規制導入を踏まえて–	シニアマネジャー 森 剛敏
16:40-16:55	質疑・応答	同上
16:55-17:00	閉会のご挨拶	パートナー 桑原 大祐

\* テーマは変更になる場合がございますので、予めご了承下さい。

- 会場 有限責任監査法人 トーマツ 有楽町オフィス セミナールーム  
〒100-0006 東京都千代田区有楽町 1-7-1 有楽町電気ビル 北館 17 階
- 定員 80 名  
※ 同業者のお申込みや定員オーバーの場合には、お断りする場合がありますので、ご了承下さい。
- 対象 金融機関の ALM、デリバティブ担保管理のご担当者様
- 受講料 無料
- 申込方法 Web サイト( <http://www.deloitte.com/jp/semi3047> )よりお申込み下さい。  
※ 本セミナー申込に際しては、株式会社シャノンのサービスを利用しています。  
ご回答いただく内容は、SSL 暗号化通信により内容の保護を図っております。  
※ お申込みは 1 名様ずつのご登録が必要となります。  
※ 過去にデロイト トーマツ グループ各社のセミナーにお申し込みいただいた方、または現在当グループのメールマガジンをご購読いただいている方は、ご設定済みの ID・パスワードで簡単にお申し込みいただけます。

#### ■講師略歴

##### 有限責任監査法人 トーマツ アドバイザー事業本部ビジネスアナリティクス パートナー 桑原大祐

大手信託銀行、大手監査法人系コンサルティング会社を経て、監査法人 トーマツに入社。  
金融機関の IFRS 対応、リスク管理高度化に対するアドバイス及びバーゼル II 対応支援を幅広く実施しており、特に信用リスク管理、市場リスク管理、統合リスク管理に関して金融機関に対する高度化支援を実施している。  
共著にバーゼル II 対応のすべて(2008 年・共著、金融財政事情)、内部監査高度化のすべて(2010 年・共著、金融財政事情)、これからのストレステスト(2012 年・共著、金融財政事情)。その他「週刊金融財政事情」に執筆多数。金融庁、全国地方銀行協会、第二地方銀行協会、CMC、金融財務研究会、金融財政事情等の主催セミナー講師実績多数。

##### 有限責任監査法人 トーマツ シニアマネジャー 大島一朗

日本銀行にて企業調査、マクロ経済分析に従事。その後、日系メガバンクの海外支店にて、ストラクチャードファイナンス業務に従事。帰国後は、円貨 ALM セクションにて、金利リスク管理高度化、流動性管理高度化の高度化に従事した他、融資企画セクションにて、信用ストレステストの導入、クレジットポートフォリオ管理の高度化、CVA の導入を行う。その後、デリバティブポートフォリオの信用リスク分析、ヘッジ方法の高度化に従事。  
現在、日系、海外の大手金融機関に対する ALM/トレジャリーアドバイザーに従事。

##### 有限責任監査法人 トーマツ シニアマネジャー 森剛敏

大手銀行にて、統合リスク管理業務の立ち上げを行い、バーゼル II ではオペレーショナルリスクの創設並びに市場リスク高度化に関与し、その後、金融インフラ(日銀ネット・日本証券クリアリング機構(JSCC)、証券保管振替機構等)の改善関連プロジェクトに参画。全銀協の部会長、日証協の国債決済期間短縮化の副主査、OTC デリバティブ検討 WG 委員、JSCC の店頭デリバティブ(金利、CDS)の業務検討会委員、SWIFT の証券メッセージ日本代表、日銀ネットの有効活用に向けた協議会の委員を歴任。現在、ISDA メンバー、アジア開発銀行のアジア債券市場フォーラムの Expert や ISO20022 の SEG として、クロスボーダー取引の活性化・効率化を推進。加えて、FinTech 関連の担当も行い、ブロックチェーン技術の研究・開発、金融インフラ等への応用等も模索中。

## <東京 有楽町オフィス>



### Access

- ・ JR 山手線 有楽町駅 日比谷口から徒歩 1 分
- ・ 有楽町線 有楽町駅、千代田線・日比谷線・三田線 日比谷駅  
A3 出口から有楽町電気ビル地下 1F 直結

### 《問い合わせ先》

有限責任監査法人 トーマツ 金融インダストリーグループ セミナー事務局  
〒100-0005 東京都千代田区丸の内 3-3-1 新東京ビル  
Tel: 03-6213-1163 / Fax: 03-6213-1186  
E-Mail: [FIGseminar@tohatsu.co.jp](mailto:FIGseminar@tohatsu.co.jp)

※ Web よりお申込みができない方は、セミナー事務局までご連絡ください。

デロイト トーマツ グループは日本におけるデロイト トウシュ トーマツ リミテッド(英国の法令に基づく保証有限責任会社)のメンバーファームおよびそのグループ法人(有限責任監査法人 トーマツ、デロイト トーマツ コンサルティング合同会社、デロイト トーマツ ファイナンシャルアドバイザー合同会社、デロイト トーマツ 税理士法人および DT 弁護士法人を含む)の総称です。デロイト トーマツ グループは日本で最大級のビジネスプロフェッショナルグループのひとつであり、各法人がそれぞれの適用法令に従い、監査、税務、法務、コンサルティング、ファイナンシャルアドバイザー等を提供しています。また、国内約 40 都市に約 8,700 名の専門家(公認会計士、税理士、弁護士、コンサルタントなど)を擁し、多国籍企業や主要な日本企業をクライアントとしています。詳細はデロイト トーマツ グループ Web サイト([www.deloitte.com/jp](http://www.deloitte.com/jp))をご覧ください。

Deloitte (デロイト)とは、英国の法令に基づく保証有限責任会社であるデロイト トウシュ トーマツ リミテッド("DTTL")ならびにそのネットワーク組織を構成するメンバーファームおよびその関係会社のひとつまたは複数指します。DTTL および各メンバーファームはそれぞれ法的に独立した別個の組織体です。DTTL (または"Deloitte Global")はクライアントへのサービス提供を行いません。DTTL およびそのメンバーファームについての詳細は [www.deloitte.com/jp/about](http://www.deloitte.com/jp/about) をご覧ください。