

「(速報)バーゼル規制／銀行勘定の金利リスクに 関する市中協議案の概要」

セミナーのご案内

主催: 有限責任監査法人トーマツ

去る6月8日にバーゼル委員会より、市中協議案「銀行勘定の金利リスク」が公表されました。

「銀行勘定の金利リスク」、すなわち、トレーディング勘定以外の国債並びに貸出金および預金に関する金利リスクについては、銀行経営上の重要度は高いものの、画一的な取扱いが困難なため、自己資本比率規制(「第1の柱」)の枠外において、個別の銀行監督(「第2の柱」)を通じて捕捉する枠組み、アウトライヤー規制により捕捉されています。

今回の市中協議案においては、枠組みの大幅な変更を含めた提案がなされています。すなわち、①銀行勘定の金利リスクを自己資本比率規制の対象とする、②従来通り、「第2の柱」で捕捉することとするものの大幅な強化を図る、という2つのオプションが示されています。

本邦の金融機関にとって、銀行勘定の金利リスクは信用リスクと並ぶ中核的なリスクとなっており、自己資本比率規制の対象となった場合には、その影響は無視できない可能性があると考えられます。また、たとえ「第2の柱」として継続された場合であったとしても、枠組みが強化される中で、体制の整備に向けた取組みは必須であるものと考えられます。

斯かるなかで有限責任監査法人トーマツは、「(速報)バーゼル規制／銀行勘定の金利リスクに関する市中協議案の概要」と題したセミナーを開催いたします。金融機関の自己資本比率算定のご担当者様若しくは銀行勘定の金利リスク管理のご担当者様に有益なものとするべく、準備いたしております。

ご多忙中、また非常にタイトなスケジュールでのご案内となりますが、万障お繰り合わせのうえ、ぜひご参加くださいますよう、ご案内申し上げます。

■日時及び内容

時間	内容	講師
14:00 ~ 15:00	バーゼル規制／銀行勘定の金利リスクに 関する市中協議案の概要	シニアマネジャー 浅井 太郎 マネジャー 飯野 直也
15:00 ~ 15:15	質疑応答、アンケート	

* 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。

- 開催日時 2015年7月1日(水) 14:00~15:15
- 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 金融機関の自己資本比率算定および銀行勘定の金利リスク管理部署のご担当者様
- 受講料 無料
- 申込期限 2015年6月30日(火)
- 申込方法 Webサイト(<http://www.deloitte.com/jp/semi2480>)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。
※ 過去に当グループ各社のセミナーにお申込みいただいた方、または現在デロイト トーマツのメールマガジンをご購読いただいている方は、ご登録済みのID・パスワードで簡単にお申込みいただけます。

■講師の経歴

有限責任監査法人トーマツ : シニアマネジャー 浅井 太郎

都市銀行において、市場業務並びに事業法人および金融法人営業を担当の後、大手監査法人系コンサルティング会社を経て、2007年に当監査法人に入社。格付制度、リスク管理体制の構築支援等、金融機関向けコンサルティング業務に従事。

2009年4月より金融庁監督局バーゼルⅡ推進室(現健全性基準室)課長補佐。内部格付手法等の承認審査並びにバーゼル2.5およびバーゼルⅢの国内実施を担当。銀行勘定の信用リスクアセットの算出方法の整合性を調査するバーゼル委員会の小部会(SIG-BB)のメンバーを務める。

2013年3月に金融庁を退職。同年4月より当監査法人に復職。現在は、国際的な金融規制および内部格付手法等に関するアドバイザー業務に従事している。

有限責任監査法人トーマツ : マネジャー 飯野 直也

当監査法人入社後、金融監査部門にて大手銀行・証券会社の会計監査に従事。

その後、コンサルティング部門にて、リスク管理システムの検証・構築支援やデリバティブ商品の時価評価の検証業務を経験。現在は、リスク管理高度化に対するアドバイス、バーゼルⅢ対応支援、金融機関の国際規制対応などを幅広く実施している。

<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

※ 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、税理士法人トーマツおよび 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 7,900 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)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を含みます。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 をご覧ください。