

「IRRBB (Interest rate risk in the banking book) への対応に向けて」 2016年12月開催セミナーのご案内

主催: 有限責任監査法人トーマツ

2016年4月にバーゼル銀行監督委員会から公表され、2018年3月より各金融機関での対応が予定されている「銀行勘定の金利リスクの基準(原題: Standards - Interest rate risk in the banking book) 以下、テキスト」の対応に関するセミナーを開催させていただきます。

IRRBBは、銀行勘定に関する金利リスクの銀行監督上の取扱い(「金利リスクの管理と監督のための諸原則(2004年バーゼル銀行監督委員会)」)を見直すもので、2018年から各金融機関への適用が予定されており、より厳格な金利リスク管理が求められることとなります。

対応が迫られる各金融機関においては、金利リスク管理の高度化のために以下のような区分での自行推計モデルの構築を検討することが求められています。

- 期限前償還リスクのある固定金利ローン
- 固定金利ローンコミットメント
- 早期解約リスクのある定期預金
- 満期のない預金(NMDs)

本セミナーにおいては、テキストを踏まえ、金融機関として求められる事項に関し、トーマツの考察を説明させて頂く予定です。また、モデル構築の検討が求められる上記4項目のうち満期のない預金に焦点を当て、コア預金モデルのモデル構築検討を踏まえた論点・課題に関してご説明させていただく予定です。

金融機関のリスク管理やALM等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。

■ 開催日時 2016年12月15日(木) 14:00～15:30

■ 内容

時間	講義内容	講師
14:00～15:15	IRRBB 対応に関するセミナー ➢ 金融機関として求められるトーマツの考察 ➢ コア預金モデルを中心としたモデル構築に関する論点	シニアマネジャー 近藤篤 マネジャー 杉谷太一
15:15～15:30	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。

- 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、お断りする場合がございますので、ご了承下さい。
- 対象 金融機関のリスク管理のご担当者様
- 受講料 無料
- 申込期限 2016年12月7日(水) 17:00
- 申込方法 Web サイト(<http://www.deloitte.com/jp/semi3410>)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。
- 講師の経歴

有限責任監査法人トーマツ：シニアマネジャー 近藤 篤

都市銀行において、デリバティブの商品開発・ディーリング、大手証券系投信会社にてファンドマネージャー、銀行系システム会社にて市場リスク管理システムの開発等を担当した後、2007年2月より金融庁監督局パーゼル 推進室(現健全性基準室)課長補佐。市場リスク内部モデル、内部格付手法等の承認審査を担当。2009年3月に金融庁を退職、同年4月より大手監査法人等にて市場リスク、信用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。
2013年3月より金融庁に戻り監督局監督企画室課長補佐。大手証券会社に対する市場リスク、信用リスクモニタリング、メガバンクに対する市場リスクモニタリング、ストレステストの調査・実施・分析を担当。2015年2月に金融庁を退職。同年4月より大手監査法人を経て、2016年9月有限責任監査法人トーマツに入社。現在は、金融機関に対する市場リスク管理、信用リスク管理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 杉谷 太一

国内証券会社において、金融商品営業に従事した後、有限責任監査法人トーマツに入社。現在は、金融機関に対するリスク管理態勢のレビュー、リスク管理システムの検証・構築支援、デリバティブ等の時価評価、時価評価モデルの検証等を担当している。

<東京 有楽町オフィス>



■ アクセス

- 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、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)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。Deloitte のメンバーファームによるグローバルネットワークの詳細は www.deloitte.com/jp/about をご覧ください。