

# FRTB 対応の進め方に関する考察

## 欧米金融機関の事例を参考にした進め方の提案

主催：有限責任監査法人トーマツ

金融危機を契機に、バーゼル銀行監督委員会は各種規制の見直しの検討を続けてきており、市場リスクに関する規制については、2012年5月に第1次市中協議案「トレーディング勘定の抜本的見直し(Fundamental Review of the Trading Book:FRTB)」を公表し、その最終規則文書を2016年1月に公表しました。

ご高承のとおり、FRTBの発効は2019年1月であり、金融機関は同年12月末から当該枠組みの下での所要資本の計算が求められます(時限性の観点)。また、FRTB下では、現行基準下とは異なり、デスク単位での内部モデル方式の承認が求められ、この承認取得のために必要な各種要件の充足のためには、リスク管理部署とフロント部署の協議・協働が必要になる場合があります(フロント部署との協議・協働の観点)。そして、これらの観点を軸に、世界各国の金融機関は、プライシングファクター・リスクファクターの設定からシステム化までにわたって、FRTBへの対応を進めています。

本セミナーでは、FRTB下での標準的方式および内部モデル方式の概要を解説した後、所要資本低減の観点から重要になるデスク構成策定のアプローチについて、欧米金融機関の動向を解説し、FRTB対応の進め方を提案します。

ご多忙とは存じますが、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。

### (セミナー概要)

開催日時 2017年1月13日(金) 14:00~15:30

講義内容

時間	講義内容	講師
14:00~14:40	標準的方式および内部モデル方式の概要	ディレクター 久永 健生 シニアマネジャー 山内 洋幸
14:40~15:10	デスク構成策定のアプローチ	シニアマネジャー 山内 洋幸
15:10~15:30	質疑・応答	ディレクター 久永 健生 シニアマネジャー 山内 洋幸

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 17-02  
〒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 金融機関の市場業務、リスク管理業務、プロダクトコントロール、市場ITシステムのご担当者様

受講料 無料

申込期限 2017年1月10日(火) 17:00

申込方法 Web サイト( <http://www.deloitte.com/jp/semi3445> )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。

## 講師経歴

### 有限責任監査法人 トーマツ : ディレクター 久永 健生

大手銀行でのデリバティブ業務(フロント、モデル開発)及び海外デリバティブハウス等を経て、有限責任監査法人トーマツ入社。現在は時価評価モデル、市場リスク、信用リスク等に関するモデル検証、システム検証、リスク管理高度化アドバイザー業務等を担当している。

### 有限責任監査法人 トーマツ : シニアマネジャー 山内 洋幸

コンサルティング会社(対国内企業経営支援)、国立研究所・非常勤研究員等を経て、有限責任監査法人トーマツ入社。現在は、銀行、証券、保険等の金融機関に対して、リスク管理モデルや時価評価モデルの検証業務、そしてリスク管理高度化支援業務を担当している。

## <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@tohmatu.co.jp](mailto:FIGseminar@tohmatu.co.jp)



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。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](http://www.deloitte.com/jp/about) をご覧ください。