

好評につき内容を更新して再開催

【第一種金融商品取引業者向け】

(関係部門へご回覧ください)

自己資本規制比率の基礎

—自己資本規制比率に対する考え方と今後の方向性—

自己資本規制比率は、第一種金融商品取引業者に対して適用され、自己勘定により保有する商品や取引のリスクに対し、早期に流動化できる自己資本によってカバーすることを求めるものです。主に自己勘定でのディーリング業務で収益を上げる証券会社にとって大きな制約となりますが、証券会社でなくとも第一種金融商品取引業者であれば、自己資本規制比率の正確な算出や当局への定期的な報告が求められています。

自己資本規制比率の算出方法は、内閣府令や告示に定められていますが、適用すべき条文や計算ロジック、掛目の判断が難しいケースが見られます。こうしたケースでは、規制の背景や考え方を理解した上で判断を行うことが重要です。また、時期は未定ではあるものの、バーゼル規制の見直しに伴い、将来的に自己資本規制比率にも何らかの変更がなされるものと考えられます。

本セミナーでは、第一種金融商品取引業者に適用される規制の内容を中心に、最新のバーゼル規制が反映されている銀行の自己資本比率規制との相違や、規制の背景、考え方、および今後の方向性をわかりやすく解説します。

開催日：2018年6月29日（金）1日間

会場：第2ニッキンホール（東京・市ヶ谷）

講師：（敬称略）

有限責任監査法人 トーマツ 金融インテグレーショングループ
ディレクター 小西 仁
マネジャー 加瀬 鶴佳

主催：C M C

Computer Based Management College

<http://www.nikkin.co.jp/CMC/>

※上記サイトからWebでの申し込みが出来ます

後援：一般社団法人 全国地方銀行協会

一般社団法人 第二地方銀行協会

一般社団法人 全国信用金庫協会

一般社団法人 全国信用組合中央協会

自己資本規制比率の基礎

カリキュラム 10:00~16:00 (9:30 受付開始)

I. 自己資本比率規制

1. 自己資本比率規制とは
2. 早期是正措置
3. 関連法令・諸規則

II. 自己資本比率の規制の考え方

1. 金融規制当局と金融機関の対峙
2. リスクと自己資本
3. 銀行は8%、証券会社は140%はなぜか
4. 証券自己資本規制比率改正の順序

III. 自己資本比率の変遷

1. 証券会社等に対する自己資本規制比率
2. 銀行に対する自己資本比率規制

IV. 自己資本の計算の概要 (証券会社等)

1. Tier1~Tier3
2. 控除資産

V. リスク区分毎の計算の概要 (証券会社等)

1. 市場リスク
2. 取引先リスク
3. 基礎的リスク

VI. 連結規制の概要

1. 連結規制導入の背景
2. 川下連結規制
3. 川上連結規制

VII. パーゼル3の証券会社等の波及 (今後の規制の方向性)

1. 自己資本
2. 市場リスク
3. 取引先リスク
4. 基礎的リスク
5. その他

小西 仁 氏 プロフィール

慶應義塾大学(経済学部)卒業。大手証券会社、情報システムベンダーに勤務の後、大手監査法人系コンサルティング会社を経て、07年に有限責任監査法人トーマツ入社。日本証券アナリスト協会検定会員。銀行、保険、証券等の金融機関に対して、パーゼルやソルベンシー等の規制関連業務、オペレーショナルリスク管理態勢高度化支援業務、内部監査支援業務等を実施している。

加瀬 鶴佳 氏 プロフィール

早稲田大学(法学部)卒業。大手金融機関にて法人および個人営業に従事。その後、07年に有限責任監査法人トーマツ入社。銀行、保険、証券等の金融機関に対して、市場リスク管理・オペレーショナルリスク管理態勢高度化支援業務、内部管理態勢・コンプライアンス態勢の構築・高度化支援業務、内部監査関連業務を実施している。

FAX 03-3261-4570 CMC事務局まで

24

【第一種金融商品取引業者向け】

第27回 金融機関 経営管理セミナー

自己資本規制比率の基礎

ホームページ用受講申込書

2018年6月29日(金)開講

貴社名

所在地 (〒 -)

連絡責任者

TEL

部署・役職

FAX

参加者氏名

所属 (部・課・グループ)

役職

☆お申し込みいただきました方には、受講証・請求書・会場地図を郵送いたします。

受講料 A: 41,040円 (本体価格 38,000円) <CMC会員価格>
B: 44,280円 (本体価格 41,000円) <後援協会会員価格>
C: 47,520円 (本体価格 44,000円) <一般価格>

お問い合わせは、 (昼食はこちらで用意いたします)

CMC TEL 03-3261-4550 FAX 03-3261-4570 まで。

注: (振込先銀行) みずほ銀行 市ヶ谷支店 普通預金 1797042

(名義) 株式会社 CMC

振込予定日 (できるだけご記入ください) 月 日

受講についてのお願い

- ①受講料は、できるだけセミナー開催日までにお振込みください。
- ②銀行振込の場合は領収書を発行いたしません。
- ③銀行振込に際しては、可能であれば貴社名の前に請求書番号の下3桁 (枝番数字) を付記してください。
振込手数料は貴社でご負担をお願い申し上げます。
- ④開催日一週間以内のキャンセルはできません。
- ⑤講演中は、録音・撮影ならびに携帯電話・パソコンの利用はご遠慮ください。
- ⑥諸般の事情により開催を中止させていただく場合がございます。