

【金融機関および金融機関関連会社限定】

(関係部門へご回覧ください)

IRRBB における内部モデル対応

～行動オプション性の対応について～

バーゼル銀行監督委員会から 2016 年に公表された「銀行勘定における金利リスク」(Interest rate risk in the banking book, IRRBB) の規制は、2018 年 3 月に国際統一基準行、2019 年 3 月に国内基準行への適用が開始されます。

銀行勘定の金利リスクを計測する際には、重要性に応じて、行動オプション性を、内部モデルの使用又は保守的な前提の反映により適切に考慮することが求められています。

本セミナーでは、基準文書で求められているモデル化の前提、文書化、管理について概観し、特に行動オプション性に着目したコア預金モデルや住宅ローン・定期預金プリペイメントの考え方について整理します。また、モデル等に関する現在の動向や実際のモデルの運用・管理・検証についても解説します。

開催日：2018年11月22日(木) 0.5日間

会場：第2ニッキンホール(東京・市ヶ谷)

講師：

(敬称略)

株式会社浜銀総合研究所

情報戦略コンサルティング部アナリティクス第2グループ

グループ長 上席主任研究員 内田 貴士

主任研究員 小柳 誠

主催：C M C

Computer Based Management College

<https://www.nikkin.co.jp/cmc.html>

※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

IRRBB における内部モデル対応

カリキュラム

13:30～16:00（13:00 受付開始）

I. IRRBB概要

1. IRRBB規制の概要
2. 内部モデルの取扱と行動オプション性の考慮

II. コア預金モデル

1. 既存コア預金モデルの問題点
2. IRRBBにおける要求事項
3. 新しいコア預金モデル

III. 住宅ローンのプリペイメントモデル

1. 推計対象
2. IRRBBにおける要求事項
3. プリペイメントのモデル化

IV. 定期預金の期限前解約モデル

1. 推計対象
2. IRRBBにおける要求事項
3. 期限前解約リスクのモデル化

V. モデルの運用と管理

1. モデルの管理
2. モデルの検証

VI. 質疑応答

70

第91回 金融機関 リスクマネジメントセミナー

「IRRBBにおける内部モデル対応」

ホームページ用受講申込書（11月22日開講）

貴社名

所在地 〒

TEL

FAX

Eメール

受付番号	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。
 ☆一週間経過しても届かない場合はご連絡ください。

受講料 A：CMC会員価格 29,160円（本体価格27,000円）

B：後援団体会員価格 31,320円（本体価格29,000円）

C：一般価格 33,480円（本体価格31,000円）

お問い合わせは、

株式会社 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、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。
振込手数料は貴機関でご負担をお願い申し上げます。
- ④開催日一週間以内の受講キャンセルの場合、受講料の払い戻しはいたしません。
- ⑤講演中の録音・撮影ならびにパソコン・携帯電話の利用はご遠慮ください。
- ⑥ホームページに提携ホテル一覧がございます。特別割引もございますので是非ご利用ください。
- ⑦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。