

GMS2014 (Global Market Solutions) 金融市場国際フォーラム

【登録フォーム】 <http://goodway.co.jp/fip/htdocs/event/gms2014/registration>

(GMS2014 運営事務局 : 株式会社グッドウェイ)

| |
|--|
| 講演タイトル |
| 「リスク管理の高度化と精緻化 ～バーゼルレポート BCBS239/277 の目指すもの～」 |
| 講演者 |
| SAS Institute Japan ソリューションコンサルティング第二本部 Risk Intelligence グループ 部長 柳 洋二郎 氏 |
| 講演概要 |
| <p>1988年に初めて制定されたバーゼルIから25年が経ち、リスク管理はより質の追及を求められている。また、金融危機を防止する様々な取り組みにもかかわらず、依然として金融危機は発生している。</p> <p>このような状況下、バーゼルは重要な国際銀行 (G-SIB)および国内銀行(D-SIB、今後認定される見込み) が守るべき原則として「実効的なリスクデータ集計とリスク報告に関する諸原則」(BCBS239)を発表した。また、銀行の資本政策の行動規範として「健全な資本政策プロセス：重要な要素」(BCBS277)を発表し、銀行がストレス状態においてもより健全な資本を維持するためのガイドが発表された。</p> <p>本講演ではこの2つのレポートの概要と対応するために何をすれば良いのか、システムとしてどこまで対応可能なのかについて述べる。</p> |