

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
「トレーディング勘定の抜本的見直し：マーケット・リスク枠組みの改定」に係る論点整理
講演者
あずさ監査法人 ディレクター 佐上 啓 氏 マネジャー 守谷 嘉洋 氏
講演概要
<p>本セミナーでは、先般の金融危機により明確になった現行枠組みの弱点や損失バッファとしての所要自己資本の不十分性、2011年より国内で適用されているバーセル 2.5 を解説した後、第2次市中協議文書「トレーディング勘定の抜本的見直し：マーケット・リスク枠組みの改定」にて提案された主な改定内容、特にトレーディング勘定における信用リスクの取り扱い、VaR（バリューアットリスク）からES（期待ショートフォール）へリスク指標見直し、標準的方式と内部モデル方式関係強化について、解説を行います。</p> <p>また、今次改定される方法で計測されるリスク量と、現行方法のリスク量について、サンプルポートフォリオを用いて検証した結果やそこからのインプリケーションを考察します。</p>