

与信ポート ストレストテストセミナーのご案内

拝啓、

時下、ますますご清栄のこととお喜び申し上げます。

本セミナーは、事業会社に対する与信（融資、長期売掛金等）を有する銀行、生命保険会社、商社などに対するものです。

第一セッション では、ストレステストの理論面について、

第二セッション では将来、与信ポートフォリオから発生する可能性のある最大ロスを、次のプロセスで推定します。

- ① ストレスパラメーターの生成（最大の売上減少、利益減少その他の把握）
- ② ストレス時の与信対象企業 PL、BS の作成
- ③ 内部格付モデルに②を読み込ませた結果得られる格付と現在の格付けの比較

第三セッション では、現在ストレステストに取り組んでいる金融機関の方にお集まり頂きパネルディスカッションおよび Q&A をおこないます。

ストレステストは、その結果を審査、営業部門と共有し、金融機関としてのリスクカルチャーをより強固なものとするだけでなく、取引先へのフィードバック、提案営業を通じて、営業面の差別化にもつながります。

万障お繰り合わせの上、御参加頂き、ご意見を開陳頂ければ光栄です。

尚、本セミナーのお知らせは、新日鉄ソリューションズとクレジット・プライシング・コーポレーションの両社から出されているため、重複していることもあるかと存じます。その際は、ご容赦賜りますようお願い申し上げます。

日時： 2010年9月16日（木） 13:30～16:20 （開場 13:15）
会場： 三菱ビル コンファレンススクエア エムプラス 1階 サクセス
東京都千代田区丸の内2-5-2 三菱ビル
03-3282-7777
主催： 新日鉄ソリューションズ株式会社（NSSOL）
株式会社クレジット・プライシング・コーポレーション（CPC）
費用： 無料（ただし、事前登録制）

【Agenda】

13:30-14:20 「ストレステスト概論」

日本銀行金融機構局 金融高度化センター
企画役 内田 善彦 様

- ・ ストレステストとは何か
- ・ ストレステストの目的
 - VaR とストレステストの役割の違い
 - シナリオ分析の利点・留意点
 - 経営の観点からみたストレステストの活用
- ・ 与信ポートへ適用する場合の留意点

14:30-15:30 「金融機関実務への適用」

CPC 代表取締役副社長 法月 洋

- ・ ストレスパラメーターのつくり方
- ・ マクロ要因の処理事例
 - 中国ゼロ成長のインパクト試算
- ・ ストレス時 PL、BS の作成
- ・ 内部格付モデルへの読み込みと結果分析
 - 与信コストはどれくらい増加するのか

15:40-16:40 「パネルディスカッションおよび Q&A」

[司会]

東京リスクマネジャー懇談会代表 藤井 健司 様
(みずほ証券株式会社リスク統括部長)

[パネリスト]

日本銀行 企画役 内田 善彦 様
住友信託銀行リスク統括部 主任調査役 多良 康彦 様
副調査役 小松崎 政浩 様

CPC 代表取締役社長 鈴木 洋壹

- ・ ストレステストへの取り組み状況と課題
- ・ セミナー参加者との Q&A

【お申込方法】

本セミナーへの参加をご希望される方は、下記の通り、Eメールにてお申込み下さい。
なお、Eメールでのお申込が出来ない方は、次ページの申込用紙により FAXにてお願い致します。

宛先： einfo@credit-pricing.com

件名： 「9/16 ストレステストセミナー参加希望」

本文： 会社名、所属部署、氏名、連絡先電話番号およびEメール

- ※ 同一部署からのご参加につきましては、原則として、最大3名までとさせていただきます。
- ※ なお、同一部署より複数名お申込の場合も、1名ずつお申込ください。
- ※ また、定員を超えるお申込を頂いた場合は抽選とさせていただきますので、予めご了承ください。

9/16 ストレストテスト セミナー 参加申込書

宛先：(株)クレジット・プライシング・コーポレーション 担当：法月・根本
FAX：03-3524-7221

本申込書1枚につき、1名様のお申し込みを承ります。

2名様以上のお申し込みは、お手数ですが、本書をコピーの上、ご利用ください。

(なお、本セミナーは、同業者およびシステム会社の方の参加はご遠慮いただいております。)

ご芳名	
貴社名	
所属部署	
役職名	
ご住所	〒
電話番号	
FAX 番号	
e-mail	
所定の項目 にチェックを してください	<input type="checkbox"/> セミナー参加を申込む <input type="checkbox"/> 個別相談を希望する (<input type="checkbox"/> 当日 <input type="checkbox"/> 後日)

- ・ 原則として、定員(70名程度)になり次第、締め切らせて頂きます。
- ・ 会場の収容人数が限られておりますので、お早めにお申込み頂きますよう、お願い申し上げます。
- ・ なお、お申込状況によりましては、抽選等の方法によりご参加頂く方を選定させて頂く場合がございますので、予めご了承ください。
- ・ 同一部署からのご参加につきましては、原則として、最大3名様までとさせて頂いております。ご協力の程お願い申し上げます。