

2019年2月13日

企業の資金調達の円滑化に関する協議会
会員企業各位

企業の資金調達の円滑化に関する協議会・事務局

プレゼンテーション&意見交換会（質疑応答）のご案内
「LIBOR 代替金利指標改革の現状と課題」に関するワークショップ

プレゼンテーションの部：日本銀行様/PwC コンサルティング(PwC)様による
『LIBOR 代替金利指標改革の現状と課題』のご説明

質疑応答の部：『事業会社における実務上の課題と影響』に関する意見交換（質疑応答）

謹啓 時下ますます御清祥のこととお慶び申し上げます。平素は協議会の活動に格別の御高配を賜り厚く御礼申し上げます。

さて今年度においては「LIBOR 代替指標改革に係る情報収集と関係者への働きかけ」を活動のテーマの一つとして採りあげており、事業法人として経済・金融環境の変化を捉え、迅速に適応すべく、金利指標変更による事業法人の資金調達活動への影響を会員企業間で共有・把握し考察を深めていく事を目指しております。

ご存知のとおり、LIBOR の公表停止に伴うリスク緩和と代替金利指標への移行の円滑化等を目的として各国の中央銀行において代替指標の検討がなされておりますが、当協議会の会員企業は金利指標の 1 ユーザーとして検討状況の動向に注視すべきと考えていますが、事業会社として何をいつまでに対応すべきか悩ましく、そもそも事業会社として対応すべき事項及び課題が何なのかといった点に関して、複数の会員企業から金利指標改革に関する周辺知識及び本邦における取組状況等につきお話を伺ってみたいという要望が寄せられていました。

そこで、この度当協議会では実際に我が国の中央銀行として「日本円金利指標に関する検討委員会」*において LIBOR 代替指標に関する改革を進めておられる日本銀行様、そして本件につき深い知見をお持ちでおられる PwC 様より金利指標改革に関する周辺知識、我が国の取り組み状況、並びに事業会社における課題等をメインに、ご高説賜るワークショップを開催することに致しました。

*下記のホームページに多くの情報が掲載されています。

https://www.boj.or.jp/paym/market/jpy_cmte/index.htm/

なお、本ワークショップの企画にあたっては、各会員企業における本件の問題意識及び検討状況が大きく異なりうることを日本銀行様及び PwC 様にご認識頂いており、金利指標改革の背景及び今後の方向性等に関して平易な言葉でご説明頂くことについてご快諾頂いています。そこで、会員の皆様のご関心事項及び分野を事前にある程度把握した上でニーズに沿う内容を探りあげて頂きます

ので、添付のアンケートへご協力賜りたくお願い申し上げます。

つきましては、アンケートへのご回答を2月26日（火）までに事務局の廣渡までメールにて御送付頂き、本ワークショップへの参加を希望される会員様は、後述の方法にて当会ホームページ上での参加登録のお手続きをお願いいたします。

日本銀行様及びPwC様より直接ご講演頂く大変貴重な機会でございますので、ご多用中とは存じますが、沢山の会員の皆様のご参加をお待ちしております。

記

1. 日時： 2019年3月8日（金）14:00～16:00
2. 場所： 企業活力研究所内大会議室 （東京都港区西新橋1-13-1 DLXビルディング3階）
3. 講師： 日本銀行 金融市場局 市場企画課長 大竹 弘樹 様

1974年北海道生まれ。東京大学法学部卒業。1997年日本銀行入行。2009年政策委員会室企画役、2012年金融機構局企画役、2013年内閣官房日本経済再生総合事務局参事官補佐、2015年業務局企画役、2017年金融市場局企画役を経て2018年6月より金融市場局市場企画課長。金融市場の制度設計や市場インフラの整備を担当し、「日本円金利指標に関する検討委員会」の事務局を務めている。

PwC コンサルティング合同会社 金融サービス事業部 パートナー 安達 哲也 様

- PwC コンサルティング合同会社 金融サービス事業部 ファイナンス&リスクチームにて、金融機関のリスク管理に関するアドバイザー業務に従事(専門分野:市場リスク(TB/BB) / カウンターパーティ・リスク(CCR) 管理態勢の整備/ CVA・XVA 導入支援/IFRS9・13 対応支援)
- 米系投資銀行の高頻度裁定取引チーム(自己勘定)を経て、国内大手監査法人にて金融機関に対する市場リスク(TB/BB) / カウンターパーティ・リスク(CCR) 管理態勢の整備(CVA/XVA 導入支援含む)、全社的ストレス・テストの導入支援 及び IFRS 9, 13 に関する助言業務に従事
- 日本銀行金融研究所にてシステミック・リスク/XVA (X-valuation adjustment) /資本コストの推定に関する調査研究を行い国内外の学会・中央銀行等で公表
- 金融庁監督局健全性基準室にてCVA 国内導入に関する監督業務、市場リスク/CCR の内部モデル(IMA、IMM) の審査およびIRRBB の国内実施案(内部モデルの利用方針等) の策定を担当
- 米国ミネソタ大学ツインシティ校 経済学博士(専門分野: 計量経済学・数理ファイナンス)、公認会計士(日本)

4. 費用： 無料

5. 構成：

受付開始	13:30
日本銀行様ご説明 ・金利指標改革の経緯や全体像等のご説明 ・検討委員会での検討状況のご説明	14:00-14:45
PwC コンサルティング様ご説明 ・金利指標改革のより詳細な論点等のご説明	14:45-15:30
質疑応答	15:30-16:00

6. 回答方法： 参加登録については当会ホームページ <https://www.cftaj.org/>のコミュニティ欄のフォームに参加者の情報をご入力ください。

コミュニティ欄は会員限定のページであり、下記の共通 ID とパスワードにてお入り頂けます。なお、コミュニティ欄へのアクセスに際し「パスワード再設定」ボタンを押されますと新しいパスワードが自動的に生成されてしまい、会員全社への新パスワードの連絡が必要になりますため、「パスワード再設定」ボタンを押されませぬようご注意ください。

ID：

パスワード：

お問合せ先

企業の資金調達の円滑化に関する協議会

TEL 050-3826-7229/050-3826-4192 事務局：廣渡/新井（三菱重工業グローバル財務部）

e-mail : kimiyo_hirowatari@mhi.co.jp/aturo_arai@mhi.co.jp