

ムーディーズ・アナリティックス プロフェッショナル能力開発

コースの概要:

銀行の信用リスク分析の基礎

2日間

CPEクレジット16ポイント

セミナーの概要

本セミナーでは、ムーディーズの銀行格付：グローバル格付手法を利用して、先進国市場および新興国市場の両方における銀行信用リスク分析に必要な枠組みおよびツールを参加者の皆様にご説明します。本コースは短いプレゼンテーション、討論、演習、事例研究の組み合わせにより構成されています。

学習目的

本セミナーを修了すると、以下のことが可能となります。

- » 金融機関の分析に使用する階層的な枠組みを適用する
- » 主要な定性リスク要因を分析する
- » 主要な比率の特定、計算、解釈を行う
- » 公表されている財務情報に基づいて銀行の体力を評価する
- » 成熟市場および発展途上市場の銀行にムーディーズの格付けツールおよび格付手法を適用する

参加対象者

本セミナーは、投資銀行業務および商業銀行業務の担当者、信用アナリスト、規制当局、中央銀行の職員、債券のプロフェッショナル、債券の調査担当者(バイサイド、セルサイドの両方)、企業の財務担当者、銀行に対するエクスポージャーや投資に関与する管理担当者向けに企画されたものです。本セミナーは集中コースの色合いが濃いいため、受講前の予習が必須となります。

プログラム・レベル

プログラム・レベル：入門編

前提条件：分析に関する経験は必要ありませんが、銀行の活動、事業内容、および組織について基礎的な知識を持っていることが望ましいと考えられます。

事前の準備：セミナーで行われるプレゼンテーションでは事例研究を行います。事例の背景を説明する調査資料が配布されます。

実施方法：グループを対象に現地に行います。

認定

ムーディーズ・アナリティックスは継続職業教育の全米公認スポンサーとして全米州公認会計士審査会協会 (NASBA)に登録しています。各々のコースをCPE

クレジットとして認定するか否かの最終決定権は各州の職業審査会にあります。登録スポンサーに関する苦情はCPEスポンサー登録局 (www.learningmarket.org.) に申し立てることができます。

ムーディーズ・アナリティックスはCFAインスティテュートおよび英国事務弁護士規制機関による認定を受けております。

ムーディーズ・アナリティックスを選択する理由協議型のアプローチ

ムーディーズ・アナリティックスの各コースは、広範にわたる調査、経験、そして金融市場の動的な変化に基づいて構築され、更新されています。社内研修については、貴社と連携して貴社組織の明確なニーズを理解し、学習プログラムの設計・実施から、技能の評価、プログラムの設計・実施・評価・強化等に関する成果の追跡まで一貫して行います。

網羅的な内容

広範にわたる技術的なノウハウおよび対人的なソフトスキルを、貴社の職員のニーズに合わせて、柔軟に組みかえることができるプログラムを提供します。以下はご提供できる主な分野です。

- » 金融業務および与信業務
- » 金融市場および投資
- » リスク管理および資本管理
- » コーポレート・ファイナンス
- » 派生商品および仕組み商品
- » »プロフェッショナルとしておよび個人としての能力開発

抜群の専門性

ムーディーズ・アナリティックスの研修ソリューションに生かされているのは、一世紀にわたるリスク管理に関する経験であり、詳細かつ総合的な知見をタイムリーに提供する総合ツール、データ、ムーディーズ・アナリティックスの分析成果です。当社の職員は、金融実務家としての豊富な経験、内容を重視する知的な情熱、優れた学歴に基

銀行の信用分析の基礎

第1セッション：ムーディーズ・インベスターズ・サービスの格付プロセスおよび銀行財務格付

- » グローバル格付手法
- » 銀行会計の基礎
- » 貸借対照表
- » 損益計算書
- » 決算書の注記
- » オフ・バランス項目
- » 派生商品

第2セッション：事業環境および規制環境

- » ソブリン環境：経済安定性、健全性および腐敗、法制度
- » 規制、監督および支援
- » 演習：事業環境および規制環境が銀行の収益性および資産の質に与える影響を評価する。

第3セッション：リスク・ポジションおよび営業権

- » 企業統治、企業経営、およびリスク管理
- » 財務報告の透明性
- » 信用リスクの集中
- » 流動性管理
- » 市場リスク選好度
- » 市場シェアおよび持続性
- » 地域的な分散
- » 収益の安定性
- » 収益の多角化
- » 演習：銀行のリスク・ポジションおよび営業権の質を評価する。

第4セッション：定量的な要因

- » 収益性
- » 流動性
- » 自己資本比率
- » 収益
- » 資産の質
- » 演習：主要な定量比率の計算および解釈
- » 演習：銀行財務格付決定のまとめ

関連各コース

- » 高度銀行信用分析
- » イスラム銀行に関する分析
- » 保険会社に関する分析
- » ヘッジファンドに関する分析
- » エコノミック・キャピタル：パーゼルII適用下における第2の柱およびICAAP

各コースを貴社の組織に合わせて設計

ムーディーズ・アナリティクスは社内研修、特別研修、およびEラーニングの各ソリューションも提供しており、貴社の研修向け投資を最大限に生かすお手伝いをします。当社の現場主義に基づくアプローチは、現地社員数名を対象とするものから世界中に散らばっているスタッフを対象とするものまで、あらゆる規模の企業のさまざまな要件に対応し、お役に立ちます。詳しいご説明、および貴社組織に合わせたプログラムの設計等のご相談は、当社研修コンサルタントまでご連絡ください。

複数コースに関する特典

複数のコースまたはグループでのご予約の場合の特別料金がございます。詳しい説明については、当社までお問い合わせください。

料金およびキャンセルについて

掲載されている料金は参加者一人あたりの料金であり、飲み物、昼食、セミナー資料を含みます。コース料金は税金、交通費、宿泊費を含みません。料金はセミナー開始日前に全額お支払いいただくこととなります。参加登録をキャンセルされる場合、書簡またはEメールによる文書を研修第一日目の30

日前までにご提出いただくことにより、全額を返却します。研修第一日目の30

日前以降のキャンセルの場合は、別のコースへ変更することができませんが、料金の返却は行いません。当社はいかなる時もセミナーのキャンセルまたは日程変更を行う権利を有します。