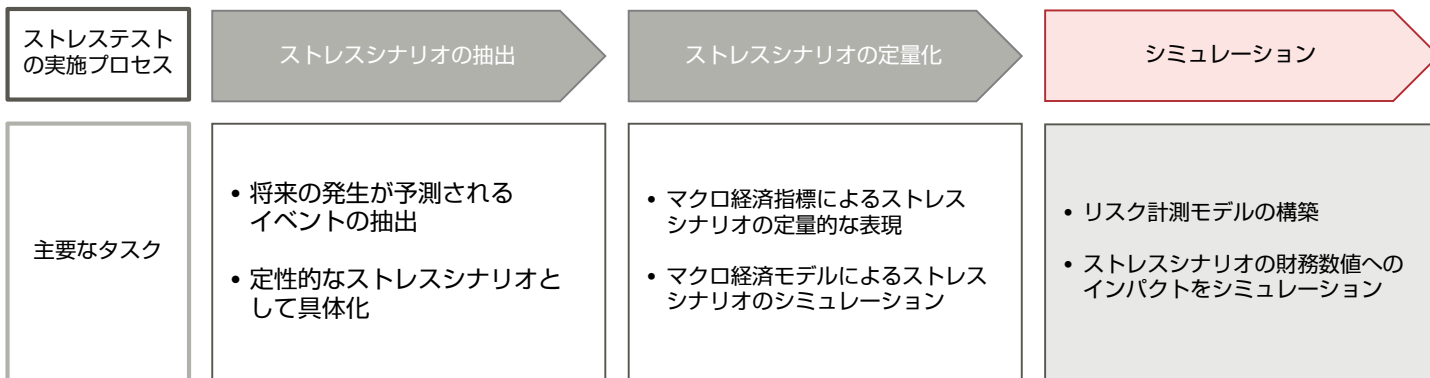


ストレステストにおけるリスク計測モデル構築支援

様々なストレステストシナリオにおける事業の収益を数値シミュレーションするリスク計測モデルを構築することで、ストレステストシナリオごとにリスクの大きさ、定量的な改善策の検討などを財務の数値で把握することが可能になります。

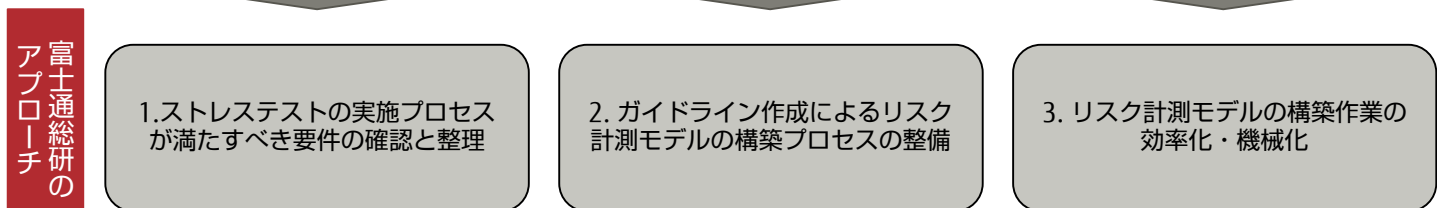
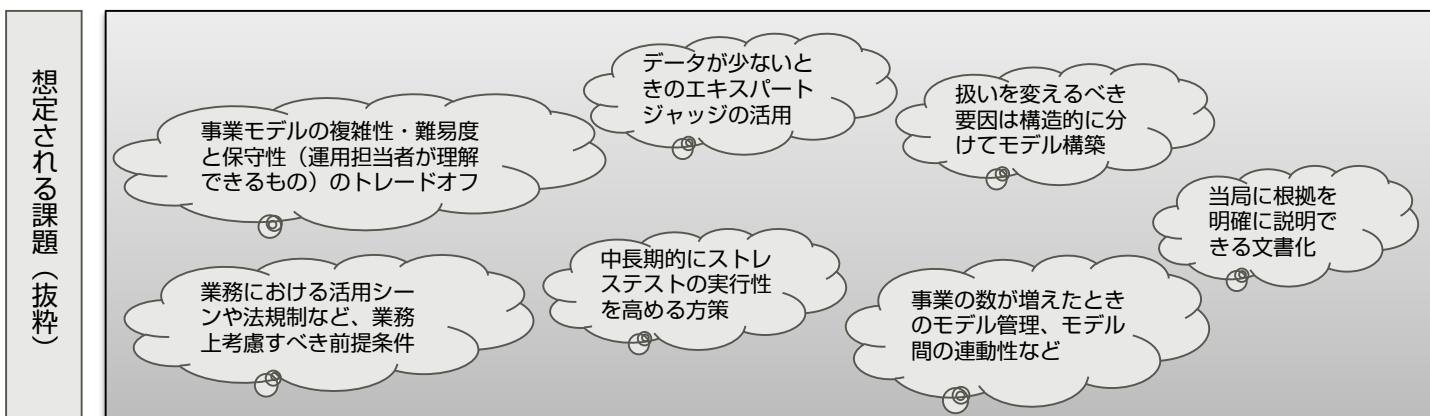
金融機関に課せられるストレステスト

グローバルに活動する金融機関では、金融不況などの不利な条件下でも収益性が法的基準を満たせるか、規制当局の基準に準拠して検査する「ストレステスト」が課せられています。しかし、想定されるストレステストシナリオが多いほど、また、検証すべき事業の数が多いほど、すべてのストレステストシナリオや事業について均質でアカウンタビリティのあるストレステストは、人手では実現困難になります。



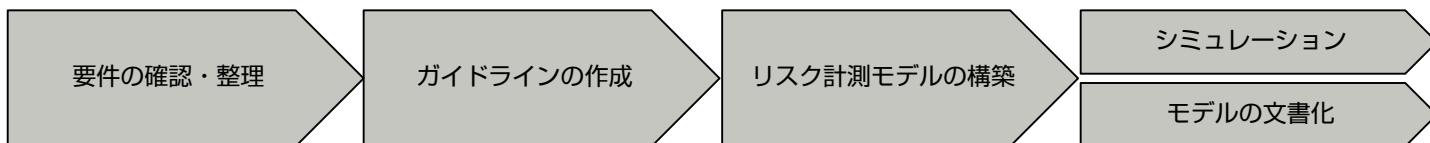
シミュレーションの実現に向けた課題と富士通総研のアプローチ

シミュレーション、および、これを実施するためのリスク計測モデルの構築には、様々な課題があります。これらの課題の整理から着手し、再現性・説明性のある進め方をすることで、均質かつアカウンタビリティの高いストレステストを実現することが、富士通総研のアプローチの特長です。



本サービスの進め方

均質かつアカウンタビリティの高いストレステストを実現するため、本サービスは以下の手順で実施します。



検討イメージ

上記における要件の確認・整理～ガイドラインの作成では、下図のようなテンプレートや資料を用いて検討します。ストレステストにおけるリスク計測モデルを構築することで、全社の収益に関する収支予測・事業評価シミュレーションを実現できるようにするため、このモデルを経営・事業戦略の策定支援に活用した業務マネジメントの高度化も期待されます。

このカタログに掲載されている内容については、予告なしに変更することがありますのでご了承ください。

2016年6月

お問い合わせ先

株式会社富士通総研

コンサルティング本部 ビジネスサイエンスグループ

〒105-0022 東京都港区海岸1丁目16番1号 ニューピア竹芝サウスタワー TEL:03-5401-8394