

金融システム研究フォーラム 概要

第3回 2009.03.23(月)

野村証券金融工学研究センターの進藤久佳氏から「サブプライム危機と CDS 市場」について報告を受け、議論と意見交換を行った。

証券化、derivative、mortgage、sub-prime loan、ABS CDO、CDS、ABCP などの聞きなれない用語、さらに Lehman shock などとその事後処理などの事象という、多くの参加者にとって接近することすら容易でない素材について、「サブプライム危機と CDS 市場」と題して、混乱とその処理過程の実態に即した説明を受け、参加メンバーの理解が大いに進んだ。同時に、議論が沸騰し、用意していただいた材料の一部を今後の検討課題として残すことになった。