

Bryan Lee McKelvey

bryan.mckelvey@gmail.com

1-21-7-402 Hongō, Bunkyo-ku

Tokyo 113-0033

+81-80-3934-3664

www.brymck.com

EXPERIENCE

WELLS FARGO-WACHOVIA, Asset-Liability Management

Wells Fargo is the fourth-largest US financial services company, with \$1.2 trillion in assets. Acquired Wachovia in December 2008.

San Francisco, CA

Sep 2007 – Mar 2010

Assistant Vice President

Mar 2009 – Mar 2010

- Responsible for design of \$18 billion hedge to eliminate FAS 133 ineffectiveness
- Developed system allowing Treasury to continuously monitor market, optimizing execution timing and enhancing discussion with traders
- Proved importance of retaining Wachovia's proprietary loan index for adjustable-rate mortgages, which saved \$150 million of interest over 5 years

Financial Analyst

Sep 2007 – Mar 2009

- Modeled distressed loan portfolio, forecasting nonperforming loans and loan modification impact. Demonstrated even aggressive principal and rate forgiveness was preferable to foreclosure in some cases. Basis for an initial loan modification drive.
- Created model analyzing balance and expense sensitivity of \$135 billion consumer time deposit portfolio to interest rate changes and other market factors
- Wrote heavily detailed report on consumer deposit competition. Along with above model, used by management to raise \$20 billion in CDs in July 2008 without overpaying or cannibalizing other deposits.

KENAN INSTITUTE OF PRIVATE ENTERPRISE

KIPE is the economic development research arm of the University of North Carolina's Kenan-Flagler Business School, focusing on air commerce and entrepreneurship studies.

Chapel Hill, NC

Jun 2006 – Jul 2007

Research Assistant

- Issued weekly research reports to professors and senior researchers on their industries' conditions
- Collected data for professors' research on air cargo regulatory environment and economic impact of migrant workers in North Carolina

EDUCATION

UNIVERSITY OF TOKYO, Faculty of Economics

Japan Ministry of Education Scholarship Research Student

Tokyo, Japan

Apr 2010 – May 2011 (expected)

UNIVERSITY OF NORTH CAROLINA, Kenan-Flagler Business School

BS in Business Administration, highest distinction (GPA: 3.80)

Chapel Hill, NC

Aug 2003 – May 2007

- Double major in Japanese
- Inducted into Phi Beta Kappa and Beta Gamma Sigma honor societies
- Wrote honors thesis entitled *Business Effects on Migrant Labor Policy Formation in Japan*, which received the Michael P. & Jean W. Carter Research Award
- National Merit, Robert C. Byrd and Edmister Family Scholarships

NANZAN UNIVERSITY, Center for Japanese Language Studies

Exchange Student

Nagoya, Japan

Aug 2004 – May 2005

CERTIFICATIONS & OTHER DATA

- CFA Charter Pending passed all three levels of the CFA Program on first try and eligible for charter upon completion of required work experience
- GMAT 770
- Programs Office (including add-in programming), Calypso, Bancware, QRM, ALMeter
- Programming VBA, C#/VB .NET, HTML, PHP, JavaScript
- Languages English (native), Japanese (business-level)
- South Mecklenburg High School valedictorian (first in class of 407 students)

References available upon request

ブライアン・リー・マッケルビー

bryan.mckelvey@gmail.com

〒113-0033

東京都文京区本郷 1-21-7-402

+81-80-3934-3664

www.brymck.com

職歴

ウェルズ・ファーゴ(元ワコビア) 資産負債管理部門

カリフォルニア州サンフランシスコ

総資産 1 兆 2 千億ドルの米大手銀行、2008 年 12 月に同じく米大手銀行のワコビアを取得 2007 年 9 月～2010 年 3 月

アシスタント・バイス・プレジデント

2009 年 3 月～2010 年 3 月

- FAS 第 133 号のヘッジ無効性によるリスクを排除するための 180 億ドル規模のヘッジを構築
- トレジャーリーが、取引のタイミングを最適化し、トレーダーとのコミュニケーションを強化するための市場を随時観察できるシステムを開発
- ワコビア独自の変動金利型住宅ローン用のインデックスを残す重要性を立証し、5 年で 1.5 億ドルの損失を回避

ファイナンシャル・アナリスト

2007 年 9 月～2009 年 3 月

- 不良住宅ローンの予測及びローンの変更による影響の推定のための不良住宅ローンポートフォリオを構築し、場合によっては差し押さえよりも大幅な元本及び金利の引き下げのほうが好ましいことを立証することで、ローン変更のキャンペーンを促進
- 1350ドルの定期預金ポートフォリオの金利変動等に対する残高と収支の感応度を分析するためのモデルを構築
- 個人預金における競合に関して詳細に渡る報告書を作成し、上記モデルに加え、過剰な利率の引き上げや他の預金を蝕むことなく、2008 年 7 月に 200 億ドル分の定期預金を調達

ケナン民間企業研究所

ノース・カロライナ州チャペル・ヒル

ノース・カロライナ大学ケナン・フラグラール・ビジネス・スクールの研究機関

2006 年 6 月～2007 年 7 月

経済発展、特に航空通商、起業家精神及びバイオベンチャーに焦点を置く

研究助手

- 教授と主任研究家による産業研究をまとめた週刊研究報告書を作成
- 空輸貨物規制環境及び移民労働者のノース・カロライナへの経済的影響の情報を収集

学歴

東京大学 経済学研究科

東京

文部科学省奨学金研究生

2010 年 4 月～2011 年 3 月(予定)

ノース・カロライナ大学 ケナン・フラグラール・ビジネス・スクール

ノース・カロライナ州チャペル・ヒル

経営学学士号取得、最優等 (GPA: 3.80)

2003 年 8 月～2007 年 5 月

- 副専攻として日本語学を履修
- ファイ・ベータ・カッパ及びベータ・ガンマ・シグマの優等学生友愛会の会員
- 卒業論文「日本における移民労働政策のビジネスへの影響」にて、マイケル・P とジーン・W・カーター研究賞受賞
- ナショナル・メリット奨学金、ロバート・C・バード奨学金、エドミスター家奨学金を授与

南山大学 外国人留学生別科

名古屋

2004 年度交換留学生

2004 年 8 月～2005 年 5 月

資格・その他

- **CFA** 資格申請中 全ての試験に(一回目で)合格、必須職務経験年数を勤務後に受取予定
- **GMAT** 770 点
- 使用可能ソフト マイクロソフト・オフィス(アドインのプログラミングも可)、Calypso、Bancware、QRM、ALMeter
- プログラミング言語 VBA、C#・VB .NET、HTML、PHP、JavaScript
- 言語 英語(ネイティブ・レベル)、日本語(ビジネス・レベル)
- サウス・メックレンバーグ高等学校を首席で卒業

照会先は必要に応じてご提供致します。