

(仮 訳)

## プレス・リリース

2011 年 9 月 28 日  
バーゼル銀行監督委員会

### 2011 年 9 月バーゼル委員会合の結果

バーゼル銀行監督委員会(以下「バーゼル委」)は、本日、委員会の政策課題の重要な要素を最終化し、また、政策の強力な実施評価の枠組みを設定するための一連の措置に合意した。

2011 年 7 月の市中協議文書について受領したパブリックコメントを注意深くレビューした結果、バーゼル委は、グローバルにシステム上重要な銀行(以下「G-SIBs」)に関する評価手法を最終化することに合意した。バーゼル委は、銀行のシステム上の重要性に応じて普通株等 Tier1(以下「CET1」)で 1%から 2.5%の範囲で追加的な損失吸収力を課し、銀行がシステム上の重要性をより高めることを防ぐ方策として CET1 で 3.5%の空バケットを設ける、というカリブレーションの提案を維持することで合意した。バーゼル委は G-SIBs の特定手法を改善するため、一部の指標にいくらかの変更を加えることを提案しており、これは 2012 年 3 月までに、更新された銀行データを用いて更にテストされることになる。バーゼル委はこの作業を金融安定理事会と緊密に協働して行っていく。

バーゼル委は G-SIBs に関するルールテキストの修正、パブリックコメントの要約及び評価を、2011 年 11 月の G20 首脳会合の前に公表する。バーゼル委は、2016 年 1 月 1 日までの実施に間に合うように、評価手法の基礎となるデータの質と透明性の改善を続けていく。

バーゼル委は銀行の中央清算機関(CCPs)向けエクスポージャーの資本賦課を導入するという提案に対するコメントについて議論した。これらのエクスポージャーは中央清算機関を利用するデリバティブ取引の文脈において発生するが、これに対する適切な資本賦課がシステミックな相互関連性に対処する追加的な手段であるとバーゼル委は信じる。バーゼル委は、中央清算機関のデフォルト基金に対する銀行のエクスポージャーの取扱いについて複数の修正を行うことで合意し、これらの変更についての最終市中協議案を数週間のうちに発表する。その目的は、銀行が直面するエクスポージャーに対して適切な資本賦課を確保しつつ、中央清算機関のより一層の

利用を促すことにある。

バーゼル委は、観察期間を通じ流動性基準を最終化する作業についてもレビューを行った。流動性カバレッジ比率(LCR)の観察期間は2013年半ばまでであるが、バーゼル委は2013年半ばの期限より十分前に重要な分野について調整を行えるよう、そのレビューを加速させることに合意した。この加速されたプロセスは、LCRの技術的な詳細の最終的な姿と水準調整について、市場により大きな確実性を与えるはずである。残りの観察期間は、LCRに関する上記の問題、あるいはその他の問題に完全に対処することを確保するために使用されうる。バーゼル委は観察期間にわたり、安定調達比率(NSFR)を評価する作業を継続する。バーゼル委は、事実と十分な情報に裏打ちされた分析に基づく建設的な対話を行うよう、引き続き業界に呼びかけていく。

最後に、バーゼル委は、メンバー国によるバーゼル資本規制の枠組みの実施をモニターしレビューするための厳格な枠組みを実施する。この包括的で強固な枠組みはバーゼル委監督基準実施部会によって調整され、ピア・レビューを中心とすることになる。当該枠組みでは、バーゼルⅡ、Ⅱ.5(トレーディング勘定のエクスポージャー)及びⅢを含む、バーゼル資本規制枠組みに係るメンバー国の国内採択及び実施のタイムラインに関するレビューを行う。当該モニタリングに基づき、バーゼル委は、メンバー国による資本枠組みの採択状況を近いうちに公表し、それを定期的にアップデートしていく。また、バーゼル委は、公平な競争条件上の懸念をもたらし得る差異を特定するために、メンバー国による立法又は規制の国際的最低基準との整合性をレビューしていく。さらに、バーゼル委は、新しい規制が各銀行及び地域を通じて統合的に実施されることを確保するために、バンキング勘定及びトレーディング勘定両方におけるリスクウエイト資産の計測のあり方についてレビューすることを合意した。

バーゼル銀行監督委員会議長・スウェーデン中央銀行総裁であるステファン・イングベス氏は、「バーゼル委は、合意されたタイムラインどおりに懸案の政策課題を最終化できる状況にある。バーゼル委の基準の実施は、現在、我々の最も優先順位の高い課題の一つである。金融危機に対応してバーゼル委が講じてきたバーゼルⅢ及びその他の措置は、完全かつグローバルに統合的な政策の実施があって初めて成功する。バーゼル委の実施モニタリングの枠組みは、基準を合意されたタイムラインに沿って完全に実施する強力なインセンティブを加盟国に対して与えるものである。」と述べた。

規制に関する作業に加え、バーゼル委のメンバーは、各国の銀行システムにおける

最近の状況について情報・意見を交換した。

バーゼル銀行監督委員会は、銀行監督に関する継続的な協力のための協議の場である。同委員会は、監督及びリスク管理に関する慣行を世界的に奨励し、強化することを目指している。委員会は、アルゼンチン、オーストラリア、ベルギー、ブラジル、カナダ、中国、フランス、ドイツ、香港特別行政区、インド、インドネシア、イタリア、日本、韓国、ルクセンブルク、メキシコ、オランダ、ロシア、サウジアラビア、シンガポール、南アフリカ、スペイン、スウェーデン、スイス、トルコ、英国及び米国の代表で構成されている。バーゼル銀行監督委員会の事務局はスイス・バーゼルの国際決済銀行に置かれている。