

(仮訳)

プレス・リリース

2020年2月27日

バーゼル銀行監督委員会は、脆弱性や新たなリスクをレビューし、監督上の取組みを前進させ、バーゼルⅢの実施を促すために会議を開催

バーゼル銀行監督委員会（以下「バーゼル委」）は、2020年2月26日から27日にかけてスイス・バーゼルで会合を開催し、銀行システムに影響を与えているリスクをレビューし、一連の監督上の取組みを進め、バーゼルⅢの実施を促した。

バーゼル委は、会合の一部を、昨年開始した戦略的レビューの進捗を議論するために割いた。バーゼル委は、バーゼル委メンバーや利害関係者に、バーゼル委の将来的な優先事項、組織形態、手続き面について、意見を聴取してきた。バーゼル委メンバーは、得られたフィードバックについて議論し、今後の方針に関する最初の意見交換を行った。バーゼル委は、このレビューを本年中に最終化することを目指している。

バーゼル委は、新型コロナウイルスの流行（Covid-19）の銀行システムに対する金融安定上の含意について議論するとともに、銀行や当局が実施した業務継続措置に関して情報交換を行った。バーゼル委は、銀行や監督当局に、変化する状況に警戒を続けることを奨励するとともに、こうしたショックに対応する際には、実効的なクロスボーダーでの情報共有や協力が重要であることを確認した。

バーゼル委は、レバレッジド・ローンやローン担保証券（CLO）に関する脆弱性についてレビューした。金融参加者の中では、銀行がこれらの市場に対して最大の直接的なエクスポージャーを有している。また、銀行は、いくつかの間接的なチャネルを通じてもこれらの市場に晒されている。バーゼル委は、レバレッジド・ローンやCLOに関する3つの分野、すなわち、バーゼル委メンバー当局によるリスク計測やリスク軽減に向けた監督上のアプローチ、これらのエクスポージャーに対する現行の規制上の取扱い、銀行が有する直接・間接のエクスポージャーを更に定量化する必要性について、作業を継続することで合意した。

バーゼル委メンバーは、銀行による、ロンドン銀行間取引金利（Libor）から代替金利指標への移行準備の進捗についても議論した。2019年12月に、バーゼル委と金融安定理事会（FSB）は、Liborへのエクスポージャーとそれに関連する監督手段のサーベ

イを開始した。このサーベイの結果と、指標の移行に係る残された課題に関する報告書は、7月のG20財務大臣・中央銀行総裁会議に提出される。この間、バーゼル委は、銀行が、金利指標改革のビジネスへの影響を把握し、円滑な移行のために必要な準備を行うために、所要のリソースを割くことの必要性を強調した。バーゼル委は、金利指標改革に係る規制上および監督上の含意の概略を示したニューズレターを本日公表した。

バーゼル委では、最近、気候関連金融リスクに関するハイレベル・タスクフォースを設置した。バーゼル委は、以下の点を含む、当該タスクフォースの作業計画と将来の成果物について議論した。

- 文献レビューや、気候関連金融リスクの銀行システムへの波及経路と計測手法に関する報告書を含む、気候関連金融リスクに関する一連の分析報告書
- 気候関連金融リスクを軽減させるための実効的な監督実務の構築

バーゼル委はまた、この分野におけるメンバーの現在の取組みに関する実態把握（ストックテイク）についてもレビューした。このストックテイクの要旨は、3月に公表される。

現在行っている整合性評価プログラム(RCAP)の一環として、バーゼル委は、香港、インドネシア、シンガポールにおける安定調達比率と大口与信規制の実施を評価した報告書を承認した。これらの報告書は来月公表される。

バーゼル委メンバーは、バーゼル委加盟法域におけるバーゼルⅢの実施状況についてもレビューした。バーゼル委は、各メンバーから、バーゼルⅢの実施の進捗について、アップデートを受けた。バーゼル委メンバーは、バーゼルⅢを、完全、適時かつ整合的に実施していくことへのコミットメントを改めて表明するとともに、その状況を継続的にモニタリングし、互いに情報共有していくことについて合意した。

バーゼル委は、また、以下の文書を公表することについても合意した。

- 銀行のオペレーショナルな頑健性を強化することを目的とした市中協議文書(3月公表予定)
- カウンター・シクリカル・バッファの利用についてのバーゼル委メンバーの経験に関する報告書(今後公表予定)