

(仮訳)

プレス・リリース

2012年8月17日
バーゼル銀行監督委員会

バーゼル銀行監督委員会による 外為取引の決済に関連するリスク管理に関する市中協議文書の公表について

バーゼル銀行監督委員会（以下、バーゼル委）は、本日、「外為取引の決済に関連するリスクを管理するための監督上の指針」（原題：Supervisory guidance for managing risks associated with the settlement of foreign exchange transactions）の市中協議文書を公表した。

本日公表した提案は、バーゼル委「外為取引における決済リスクを管理するための監督上の指針」（原題：Supervisory guidance for managing settlement risk in foreign exchange transactions）を改定するものである。同指針が2000年に公表されて以降、外為市場は、外為取引の決済に関連するリスク削減の面で大きな進展を遂げてきた。しかし、とりわけ外為取引が急速に拡大してきているため、外為決済に関連するリスクは少なからず残っている。

今回提案した新たな指針は、そのようなリスクの効果的な管理が確保されることを目的としたものである。今回の指針は、ガバナンス態勢や、元本リスク、再構築コスト・リスク、その他の外為決済に関連するリスクの管理について、より包括的で詳細な指示を行っている。加えて、元本リスクの削減を目的として、実務的に可能な場合にはPVP決済を利用することを促している。

この指針は、ガバナンス、元本リスク、再構築コスト・リスク、流動性リスク、オペレーショナル・リスク、リーガル・リスク、外為取引のための資本、に関する7つの「ガイドライン」で構成される。

バーゼル委は、本市中協議文書に対するコメントを歓迎する。コメントは、baselcommittee@bis.org宛てに、電子メールで2012年10月12日（金）までに提出するものとする。また、バーゼル委事務局（The Secretariat of the Basel Committee on Banking Supervision, Bank for International Settlements, CH-4002 Basel, Switzerland）宛てに、郵送でコメントを提出することもできる。すべてのコメントは、コメント提出者から特段の要請がない限り、国際決済銀行のウェブサイトに掲載される。