

## 金融研究センター 研究プロジェクト

### 「バーゼルⅢの国際的な実施状況と影響度評価」

#### ● 背景

バーゼル銀行監督委員会（バーゼル委）では、昨年3月の銀行市場の混乱を踏まえ、流動性規制や銀行勘定の金利リスク等に係る分析作業を実施している。今後国際的な議論に臨む際には、様々な仮定を置いて、詳細なデータを用いたシミュレーションを行い、邦銀を含め銀行への影響を捕捉することが重要である。

また、バーゼルⅢの国際的な実施については、実施時期及びその内容にばらつきがみられ、それによって生じる課題や影響についても把握する必要がある。

#### ● 研究内容

- ①バーゼル規制（流動性規制、銀行勘定の金利リスク等）に関し、今後考えられる論点を踏まえた影響度評価
- ②バーゼルⅢの各法域における実施状況と、規制内容の差異による影響分析  
⇒上記①及び②の結果について、今後の各部会の議論に活用することを目的とする。