

バーゼル委員会による「先進的計測手法（AMA）の主な論点について
みられたプラクティスの幅」の公表について

2006年10月13日

本日、バーゼル銀行監督委員会は先進的計測手法（AMA）の主な論点についてみられたプラクティスの幅に関するペーパー（レンジ・オブ・プラクティス・ペーパー）を公表した。

本ペーパーには、AMAを目指す銀行がオペレーショナル・リスクに関連して取り組んでいる主な作業課題について、当局により観測されたプラクティスが横断的に記述されている。本ペーパーは、AIGOR（注）メンバーの監督実務、ベンチマーキング、銀行の経営陣との議論、その他から得られた情報を用いてAIGORにより作成され、記述内容は内部統制、損失データ、計量モデルの三つに大別される。

本日、Nout Wellink バーゼル銀行監督委員会議長（オランダ中央銀行総裁）は、「オペレーショナル・リスクの管理と計測は、リスク管理の中でも比較的新しく急速に発展している分野であるが、現状ではこれらの分野における業界のプラクティスについて、公開情報がほとんど入手できない。このペーパーは、こうした情報の空白に対処しようとする試みである」と発言した。

Nick Le Pan 銀行監督新規制実施作業部会議長（カナダ OSFI 長官）は、「オペレーショナル・リスク管理のような分野における業界のプラクティスについて、監督当局の経験、知識を共有することは、バーゼルⅡの実施を成功させることに役立つものである。かように、本ペーパーは、監督当局及び銀行にとって大いに興味を引くものとなる」と付け加えている。

当ペーパーは、国際決済銀行のホームページで入手可能（<http://www.bis.org>）。

以上

（注）AIGOR（the Accord Implementation Group's Operational Risk Subgroup）は、バーゼルⅡ実施グループのオペレーショナル・リスク・サブグループであり、特に先進的計測手法（AMA：Advanced Measurement Approaches）に関する要件を討議している。