

(仮 訳)

プレス・リリース

2012年7月25日
バーゼル銀行監督委員会

銀行の清算機関向けエクスポージャーに対する資本賦課

バーゼル銀行監督委員会(以下、「バーゼル委」)は、本日、銀行の清算機関(以下、「CCP」)向けエクスポージャーに対する資本賦課について暫定規則を公表した。

2009年より、バーゼル委は、銀行による CCP のより一層の利用を促すと同時に、銀行の CCP 向けエクスポージャーに対して適切な資本賦課を確保するという G20 首脳の目標を達成すべく取り組んできた。二度にわたる市中協議と、BIS 支払・決済システム委員会(CPSS)及び証券監督者国際機構(IOSCO)との協議を経て、バーゼル委は、本日、バーゼルⅢの一部として、2013年1月から実施される CCP 向けエクスポージャーに対する資本賦課についての暫定規則を公表した。

バーゼル委の CCP 向けエクスポージャーに対する資本賦課の枠組みは、国際金融市場を支える CCP を含む重要なインフラストラクチャーの頑健性を高めることを企図して構築された CPSS-IOSCO の新しい「金融市場インフラのための原則」に基づいている。CCP がこの原則と統合的な方法で監督されている場合、そうした CCP に対するエクスポージャーについての資本賦課は特恵的に扱われる。特に、トレード・エクスポージャーは、2%のリスク・ウェイトを課せられることになる。加えて、本日公表した暫定規則は、銀行に対して、清算基金向けエクスポージャーに対する所要自己資本を求める上で、2つの手法:(i)過去数年において、バーゼル委が二度市中協議を実施したリスク感応的な手法、あるいは、(ii)清算基金向けエクスポージャーについて1250%のリスク・ウェイトを課す一方で、銀行のトレード・エクスポージャーの大きさにより上限を設定する簡便な手法、のうちどちらか一方を選択することを許容している。

これらの規則を策定する際に、バーゼル委は、直接参加者を經由して行なう清算(顧客取引)が行われている状況においても、CCP の利用を一層促すような動機付けを構築する必要性を認識していた。このため、顧客も CCP を通じた取引による特恵的な扱いを受けることができるように、この暫定規則は顧客取引に対する措置も含まれている。

バーゼル委は、より良い資本賦課の枠組みを策定する上では、更なる追加的な取り組みが必要であることを認識している一方で、この暫定規則がバーゼルⅢの完全実施を考慮したものになることを意図している。この分野における更なる取り組みは2013年にかけて予定されている。バーゼル銀行監督委員会議長であるスウェーデン中央銀行総裁のステファン・イングベス氏は、「銀行のCCP向けエクスポージャーに対する資本賦課は、バーゼルⅢの資本規制の最後の部分の一つであり、我々はこの暫定規則を確立することが出来たことに対して満足している。もっとも、バーゼル委では、店頭デリバティブ取引に係るG20の改革議題の構成要素が未だ最終化していないことを認識している。このため、我々は、この分野における所要自己資本及び他の政策イニシアティブとの相互関係を積極的に監視し続けることで、この枠組みが頑健であり、幅広くG20の目標と整合的であることを確保していきたい」と述べた。

バーゼル委は、2010年12月と2011年11月の過去の市中協議文書にフィードバックやコメントを提供して頂いた方々に感謝を述べたい。また、今後CCP向けエクスポージャーに対する資本賦課に係るより良い規則を策定する中で、市場参加者が今後の影響度調査や協議に関与していくことを奨励する。