

(仮 訳)

プレス・リリース

2013年3月26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市中協議文書
「大口エクスポージャーの計測と管理のための監督上の枠組」の公表

バーゼル銀行監督委員会(以下「バーゼル委」)は、本日、「大口エクスポージャーの計測と管理のための監督上の枠組」と題する文書を公表し、市中協議に付した。

提案された新基準は、銀行及び監督当局による、一人の受信者に対するエクスポージャーの計測、合算、管理の方法について、更なる一貫性を確保することを目的とするものである。本基準は、リスク・ベースの資本規制のバックストップとしての役割を有し、一人の受信者又は関連性のある受信者のグループの突然のデフォルトを原因として銀行が重大な損失を負うことを防ぐことにより、既存のリスク・ベースの資本規制を補完するものである。本日公表された市中協議文書は、1991年にバーゼル委が公表したガイダンス「大口エクスポージャーの計測と管理」に代わるものとなるだろう。

提案された基準は、民間セクターの一人の受信者のデフォルトに関連する集中リスクに焦点を絞っているほか、同基準は、関連性のある受信者のグループに対するエクスポージャーにも適用される。本基準の対象は包括的であり、全ての業務や勘定に亘る受信者に対する直接のエクスポージャーを対象とするほか、信用リスク補完の提供者に対するエクスポージャーも対象とする。ファンド、証券化のためのストラクチャー、集団投資スキームに対するエクスポージャーに同基準の適用の対象を広げることにより、バーゼル委はシャドバンキング・システムに係る懸念に対処しようとしている。バーゼル委はまた、グローバルにシステム上重要な銀行(G-SIB)間のエクスポージャーに対しより厳格な制限を課すことを提案することで、G-SIB間のリスクの伝播を抑制することを目指している。

バーゼル委員会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、**2013年6月28日(金)までに**、電子メールで baselcommittee@bis.org 宛に提出することが求められる。あるいは、「スイス連邦、CH-4002 バーゼル市、国際決済銀行、バーゼル銀行監督委員会事務局」宛にコメントを郵送することもできる。全てのコメントは、コメント提出者が明示的に機密扱いを要求しない限り、国際決済銀行のウェブサイトに公表されることがある。