

(仮訳)

プレス・リリース

2018年9月20日

バーゼル銀行監督委員会はストレステスト諸原則を最終化、規制裁定行動を阻止する手段を検討、グローバルなシステム上重要な銀行（G-SIB）の2018年リストを合意したほか、レバレッジ比率規制、暗号資産（crypto-assets）、マーケット・リスクの枠組み、合意済みのバーゼル規制の実施について議論

バーゼル銀行監督委員会（以下「バーゼル委」）は、2018年9月19日から20日にかけてスイス・バーゼルで会合を開催し、規制・監督上の諸課題について議論したほか、各メンバー国における金融危機後の規制改革の実施に関する状況把握（ストックテイク）を行った。

バーゼル委は、以下の点について議論した。

- グローバルなシステム上重要な銀行（G-SIB）の2018年選定結果。2018年の選定結果はバーゼル委により承認され、金融安定理事会（FSB）に提出される。後日、FSBは2018年のG-SIBリストを公表する。バーゼル委はG-SIB評価対象銀行のハイレベルな指標値の公表についても合意した。
- マーケット・リスクの枠組みの見直しに係る進捗。バーゼル委は見直し内容を2018年末頃に最終化することを企図している。
- 潜在的な規制裁定取引を含む、銀行の規制変化への対応。バーゼル委は、レバレッジ比率規制上の数値に影響を与えるために、銀行が規制上の報告時期にバランスシートを調整する、所謂 window-dressing 行動に関してニュースレターを公表する。バーゼル委は、この行動を阻止するために、第一の柱（最低所要自己資本）や第三の柱（開示）による措置を検討する。また、所謂 settled-to-market デリバティブ取引の流動性規制上の取扱いを明確化することに合意し、本件に係るFAQを公表した。
- レバレッジ比率規制が顧客清算取引に与える影響評価の結果。G20 首脳は店頭デ

リバティブ（OTC）市場改革にコミットメントしているが、そのこととの関係で、バーゼル委は、金融危機後の規制改革が店頭デリバティブ取引の中央清算化のインセンティブに与える影響に係るバーゼル委・FSB・BIS 決済市場インフラ委員会（CPMI）・証券監督者国際機構（IOSCO）との共同市中協議文書についても議論した。この点、バーゼル委は、来月、レバレッジ比率規制に係る市中協議文書を公表し、エクスポージャー計測の見直しの是非について、また、見直す場合にはそのオプションについて、関係者の意見を求めることに合意した。

バーゼル委は、2017年12月に公表された市中協議文書を踏まえ、ストレステストに係る諸原則の改訂版を公表することにも合意した。改訂された諸原則は、来月公表される予定である。

バーゼル委は、現在の局面において重要なリスク及び構造的なリスクに関する意見交換を行った。その際、特に銀行の暗号資産（crypto-assets）に対するエクスポージャーや保有に伴う潜在的なリスクについて議論した。バーゼル委は、銀行の暗号資産エクスポージャーに対するバーゼル委としての見解の形成に役立つよう、追加的な検討を行うことに合意した。

バーゼル委メンバーは、国際的に活動する銀行を対象とするバーゼルⅢ規制が完全、適時かつ整合的に実施されるべきものである点を再確認した。バーゼル委は、整合性審査（Regulatory Consistency Assessment Programme）の一環として、サウジアラビアの安定調達比率及び大口エクスポージャー規制の審査を実施し、「遵守」と評価した。整合性審査の報告書は、近々公表される。

次回バーゼル委員会合は2018年11月26日から27日にかけて、アラブ首長国連邦・アブダビで開催される予定。