

(仮訳)

2013年8月12日

プレス・リリース

CPSS と IOSCO による金融市場インフラの再建に関する
市中協議報告書の公表について

支払・決済システム委員会 (CPSS) と証券監督者国際機構 (IOSCO) 代表理事会は、本日、「金融市場インフラ (以下「FMI」) の再建」に関する市中協議報告書を公表した。

本報告書は、清算機関 (CCP) 等の FMI が、その参加者および業務を提供する市場にとって不可欠なサービスを継続して提供するのを妨げる可能性のある存続可能性および財務基盤に対する脅威からの回復を可能とする計画をどのように策定するのかについてのガイダンスを、FMI に提供する。また、本報告書は、関係当局が、再建計画・手法の作成と実施に関する当局の責務を遂行するにあたってのガイダンスも提供する。

本報告書は、2012年7月の CPSS と IOSCO による報告書「金融市場インフラの再建と破綻対応」に対し、どのような再建手法が FMI にとって適切であるかについて追加的なガイダンスを求めたコメントが寄せられたことを受けて作成された。

本報告書は、CPSS と IOSCO により 2012年4月に公表された、FMI のための国際基準である「金融市場インフラのための原則」(以下「FMI 原則」) を補足するものである。本報告書は、FMI が実効的な再建計画を備えるべきとの FMI 原則上の要請を FMI が遵守するうえでのガイダンスも提供する。本報告書は市中協議文書であり、FMI のための追加的な基準を新たに定めるものではない。本報告書は、金融安定理事会 (FSB) により 2011年10月に公表された、「金融機関の実効的な破綻処理の枠組みの主要な特性」とも整合的である。

資金決済システム、証券決済システム、証券集中振替機関、清算機関および取引情報蓄積機関は、グローバル金融システムにおいて必要不可欠な役割を果たしている。FMI の無秩序な破綻は、それが市場の効果的な機能を阻害する場合、深刻でシステミックな混乱をもたらし得る。

本報告書と合わせて、両委員会が市中協議期間中に特にコメントを求めている論点を列挙したカバー・ノートが公表されている。あらゆる関係者からのコメントを募っており、コメントの提出期限は 2013年10月11日とする(下掲の注記1を参照)。

注記

1. 本報告書へのコメントは、CPSS 事務局 (cpss@bis.org) と IOSCO 事務局 (fmirecovery@iosco.org) の双方宛てに、2013年10月11日までに提出するものとする。それらのコメントは、コメント提供者から特段の要請がない限り、BIS および IOSCO のウェブサイト

に公表される。

2. CPSS は、中央銀行が支払・決済の仕組みやクロスボーダーまたは多通貨決済スキームの動向についてモニタリングおよび分析を行うためのフォーラムである。CPSS 事務局は、BIS 内に置かれている。CPSS に関する情報および CPSS の公表物は BIS のウェブサイト (www.bis.org/cpss) より入手可能である。
3. IOSCO は、証券監督当局のための国際政策フォーラムである。同機構は、国際的な証券・先物取引に関する主要な規制上の課題を検討し、そうした課題に対する実務的な対応を調整することを目的としている。www.iosco.org を参照。
4. 両委員会とも、FSB により国際基準設定主体として承認されている (www.financialstabilityboard.org)。
5. 本報告書は、BIS (www.bis.org/publ/cpss109.htm) および IOSCO (www.iosco.org/library/pubdocs/pdf/IOSCOPD418.pdf) のウェブサイトより入手可能である。
6. 2012 年 4 月の CPSS-IOSCO「金融市場インフラのための原則」は、BIS (www.bis.org/publ/cpss101.htm) および IOSCO (www.iosco.org/library/pubdocs/pdf/IOSCOPD377.pdf) のウェブサイトより入手可能である。2012 年 7 月の CPSS-IOSCO「金融市場インフラの再建と破綻対応」は、BIS (www.bis.org/publ/cpss103.htm) および IOSCO (www.iosco.org/library/pubdocs/pdf/IOSCOPD388.pdf) のウェブサイトより入手可能である。
7. FSB の「金融機関の実効的な破綻処理の枠組みの主要な特性」(以下、主要な特性)は、FSB (www.financialstabilityboard.org/publications/r_111104cc.pdf) のウェブサイトより入手可能である。
8. FSB は、本日、主要な特性のノンバンク金融機関への適用方法を説明する市中協議文書を公表しており、当該文書には、FMI の破綻処理に対応するための特則が含まれている。「実効的な破綻処理の枠組みにおける主要な特性のノンバンク金融機関への適用」は、FSB のウェブサイト (http://www.financialstabilityboard.org/publications/r_130812a.pdf) より入手可能である。破綻処理下にある FMI の扱いは、今後公表が予定されている主要な特性の評価方法においても取り扱われる予定である。