

(仮訳)

プレス・リリース

2013年2月15日
バーゼル銀行監督委員会

バーゼル銀行監督委員会が 外為取引の決済に関連するリスクを管理するための監督上の指針を公表

バーゼル銀行監督委員会（以下、バーゼル委）は、本日、「外為取引の決済に関連するリスクを管理するための監督上の指針」（原題：Supervisory guidance for managing risks associated with the settlement of foreign exchange transactions）を公表した。

本日公表された指針は、バーゼル委「外為取引における決済リスクを管理するための監督上の指針」（原題：Supervisory guidance for managing settlement risk in foreign exchange transactions）を改定するものである。同指針が2000年に公表されて以降、外為市場は、外為取引の決済に関連するリスク削減の面で大きな進展を遂げてきた。しかし、とりわけ外為取引が急速に拡大してきているため、外為決済に関連するリスクは少なからず残っている。

2000年に公表された指針は、外為決済に関連するリスクのうち主に元本リスクに焦点を当てていた一方で、今回の新たな指針は、外為決済に関連するより幅広いリスクに対処することを意図している。今回の指針は、ガバナンス態勢や、元本リスク、その他の外為決済に関連するリスクの管理について、より包括的で詳細な方向性を示している。加えて、元本リスクの削減を目的として、実務的に可能な場合には PVP 決済を利用することを促している。

本指針は、ガバナンス、元本リスク、再構築コスト・リスク、流動性リスク、オペレーショナル・リスク、リーガル・リスク、外為取引のための資本、に関する7つの「ガイドライン」で構成される。

バーゼル委議長を務めるリクスバンクのステファン・イングベス総裁は、「本指針は、大きな金融の混乱の潜在的な要因となる、銀行の外為決済に関連するリスクの管理を更に向上させるための重要な一歩である」と述べ、加えて「バーゼル委は、監督当局と銀行、特に国際的に活動する銀行が、本指針を完全に採用することを慫慂し、各国の銀行と監督当局による本指針の適用状況の進捗をモニターする予定である」と述べた。

本指針は、支払決済システム委員会との間の緊密な議論に基づいて策定されたことに留意されたい。また、本指針は2012年8月に公表された市中協議文書に対するコメントも踏まえたものである。バーゼル委は、これらのフィードバックとコメントに謝意を表したい。