

(仮訳)

プレス・リリース

2019年6月20日

バーゼル銀行監督委員会は規制・監督上の取組みについて議論し、規制の実施に係る報告書を承認

バーゼル銀行監督委員会（以下「バーゼル委」）は、6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、各メンバー法域における金融危機後の規制改革の実施についての状況把握（ストックテイク）を行った。

今回のバーゼル委会合は、パブロ・エルナンデス・デ・コス・スペイン中央銀行総裁が、2019年3月に中央銀行総裁・銀行監督当局長官グループからバーゼル委議長に任命されてから初めて議長を務めた会合であった。バーゼル委は、前議長であるステファン・イングベス・スウェーデン・リクスバンク総裁の、バーゼル委における強いリーダーシップと金融危機後のバーゼルⅢの諸改革を最終化まで監督したことについて感謝した。また、バーゼル委メンバーは、20年間バーゼル委に務め、2014年からは事務局長も務めてきたウィリアム・コーエン氏に対しても、感謝の意を表した。バーゼル委は、コーエン氏に、彼の多大な貢献について感謝した。バーゼル委は、2019年8月14日から新たに職責を負うことになるキャロリン・ロジャース氏の次期事務局長への任命を歓迎した。

バーゼル委は、以下の点について議論した。

- レバレッジ比率について、顧客から受領した証拠金と、顧客清算取引のデリバティブ・エクスポージャー額との相殺を認める、焦点を絞った限定的な改定に合意した。来週公表予定の本改定は、持続不可能な水準のレバレッジに対する予防手段としてのレバレッジ比率の頑健性と、標準的なデリバティブ契約の中央清算を推進するG20首脳のコミットメントとのバランスをとることを企図している。バーゼル委は、本改定がレバレッジ比率の枠組みにどのような影響を与えるかについてモニターしていく。
- 昨年公表されたバーゼル委のニュースレターで概説された諸手段を踏まえ、レバレッジ比率のウィンドウ・ドレッシングを抑制するための一連の開示要件に合意

した。開示要件は、証券金融取引の四半期末残値と平残値に基づくレバレッジ比率の開示を銀行に求めるべく改定される。これらの開示要件は来週公表される予定である。バーゼル委は、金融市場におけるウィンドウ・ドレッシング行動について引き続きモニターしていく。

- 第2の柱に関する監督上の実務や手法に関する報告書を承認した。同報告書は間もなく公表される。
- オーストラリア、カナダおよびインドにおける安定調達比率（NSFR）及び大口エクスポージャー規制の実施状況を審査した報告書のレビューを行った。本報告書の公表は7月を予定している。

バーゼル委は、金融危機後の規制改革の影響評価に関する作業計画について議論し、本作業に関する追加情報をこの先公表していく。

バーゼル委メンバーは、金融技術や暗号資産に係る事項についても議論した。バーゼル委は、オープン・バンキングとアプリケーション・プログラミング・インターフェース（API）の規制・監督への含意に関する報告書を確認した。報告書はこの先公表される。バーゼル委は、金融サービスにおける人工知能や機械学習の利用に関するリスク管理上の課題を含む、金融技術に関する追加作業を行うことに合意した。バーゼル委メンバーは、暗号資産に関する最近の進展を確認し、暗号資産における技術的、経済的な特徴に関する多様な幅について議論した。暗号資産は高いボラティリティを有しており、銀行に対し多くのリスクをもたらす。バーゼル委は、暗号資産によるリスクとそれに対する最適な対応の検討を続けていく。

また、バーゼル委は、気候変動リスクに係る金融当局ネットワーク（NGFS）による初の統合レポートを確認し、レポートにおける提言の、バーゼル委の将来の活動への含意について議論した。バーゼル委は、NGFSにオブザーバーとして参加することを合意した。