

金融商品取引業者等向けの総合的な監督指針 新旧対照表

現 行	改 正 案
<p>IV 監督上の評価項目と諸手続(第一種金融商品取引業)</p> <p>IV-5 指定親会社グループについて</p> <p>IV-5-3 自己資本の充実</p> <p>IV-5-3-1 最終指定親会社における自己資本の適切性・十分性</p> <p>IV-5-3-1-2 自己資本の充実度の評価</p> <p>(1)~(3)(略)</p> <p>(中略)</p> <p>(4) 最終指定親会社告示第2条に基づき連結自己資本規制比率の算出を行っている最終指定親会社については、バーゼル合意を踏まえて最終指定親会社告示に定める水準以上の資本保全バッファー、カウンター・シクリカル・バッファーに係る普通株式等 Tier 1 資本を、自己資本として追加的に保有することが求められる。また、最終指定親会社告示第2条の2第5項第1号の規定に基づき指定された最終指定親会社(以下、「最終指定親会社告示に指定されたG-SIBs」という。)又は最終指定親会社告示第2条の2第5項第2号の規定に基づき指定された最終指定親会社(以下、「最終指定親会社告示に指定されたD-SIBs」という。)については、G-SIBs バッファー又はD-SIBs バッファーとして、最終指定親会社告示に定める水準以上の普通株式等 Tier 1 資本を自己資本として追加的に保有することが求められる。</p> <p>資本保全バッファーとは、金融及び経済のストレス期において損失の</p>	<p>IV 監督上の評価項目と諸手続(第一種金融商品取引業)</p> <p>IV-5 指定親会社グループについて</p> <p>IV-5-3 自己資本の充実</p> <p>IV-5-3-1 最終指定親会社における自己資本の適切性・十分性</p> <p>IV-5-3-1-2 自己資本の充実度の評価</p> <p>(1)~(3)(略)</p> <p>(中略)</p> <p>(4) 最終指定親会社告示第2条に基づき連結自己資本規制比率の算出を行っている最終指定親会社については、バーゼル合意を踏まえて最終指定親会社告示に定める水準以上の資本保全バッファー、カウンター・シクリカル・バッファーに係る普通株式等 Tier 1 資本を、自己資本として追加的に保有することが求められる。また、最終指定親会社告示第2条の2第5項第1号の規定に基づき指定された最終指定親会社(以下、「最終指定親会社告示に指定されたG-SIBs」という。)又は最終指定親会社告示第2条の2第5項第2号の規定に基づき指定された最終指定親会社(以下、「最終指定親会社告示に指定されたD-SIBs」という。)については、G-SIBs バッファー又はD-SIBs バッファーとして、最終指定親会社告示に定める水準以上の普通株式等 Tier 1 資本を自己資本として追加的に保有することが求められる。</p> <p>資本保全バッファーとは、金融及び経済のストレス期において損失の</p>

金融商品取引業者等向けの総合的な監督指針 新旧対照表

現 行	改 正 案
<p>吸収に使用できる資本のバッファをいう。</p> <p>カウンター・シクリカル・バッファとは、金融市場における信用の供与が過剰な場合に、将来の景気の変動によって生じるおそれのある損失に対するバッファであり、各国又は各地域の金融当局が定める比率に当該国又は地域に係る信用リスクアセットの額を保有する信用リスクアセットの額の合計額で除して得た割合を乗じ、国又は地域に応じて得られた値を合計して算出する。</p> <p>(以下略)</p>	<p>吸収に使用できる資本のバッファをいう。</p> <p>カウンター・シクリカル・バッファとは、金融市場における信用の供与が過剰な場合に、将来の景気の変動によって生じるおそれのある損失に対するバッファであり、各国又は各地域の金融当局が定める比率に当該国又は地域に係る信用リスクアセットの額を保有する信用リスクアセットの額の合計額で除して得た割合を乗じ、国又は地域に応じて得られた値を合計して算出する。<u>最終指定親会社告示第2条の2第4項第1号における金融庁長官が別に指定した比率(以下「カウンター・シクリカル・バッファ比率」という。)については、金融庁が適切と認める指標(例えば、総与信・GDP 比率、金融機関の貸出態度 DI など)等を参考にしつつ、日本銀行との協議を踏まえ、総合判断を行い、カウンター・シクリカル・バッファ比率を決定する。カウンター・シクリカル・バッファ比率の引上げを行う場合、当該比率を公にした日から1年以内にその適用を開始する。カウンター・シクリカル・バッファ比率の引下げを行う場合には、当該比率を公にした日からその適用を開始する。</u></p> <p>(以下略)</p>