

「自己資本比率規制（第１の柱・第３の柱）に関する告示の一部改正（案）」に対するご意見の概要及びそれに対する金融庁の考え方

○銀行１柱告示に関するご意見

（※）本項目で参照している条文は、特段の断りのない限り、銀行１柱告示（銀行法第十四条の二の規定に基づき、銀行がその保有する資産等に照らし自己資本の充実の状況が適当であるかどうかを判断するための基準（平成十八年金融庁告示第十九号））の条項を指します。

No.	条文番号	ご意見の概要	金融庁の考え方
1	第 282 条の 4 第 2 項	「トレーディング・デスクごとの」という文言が削除されている。バンキング勘定のトレーディング・デスクが有する外国為替リスクと、トレーディング勘定のトレーディング・デスクが有する外国為替リスクを区分することなく、シナリオごとの相関を加味してマーケット・リスク相当額を合算するという理解でよいか。	国際合意文書（MAR21.7 等）では、シナリオごとの各リスク・クラスのデルタ・リスク、ベガ・リスク、カーベチャ－・リスクに対するマーケット・リスク相当額の算出過程において、トレーディング・デスク単位での算出は求めているため、国際合意に整合するように不要な記載箇所を削除するものです。