

1. FX 取扱会員の為替リスク管理の高度化に向けて

- 各 FX 取扱会員において、為替相場の急変等を見据えた為替リスク管理の高度化に向けて継続的に取り組む必要がある。金融先物取引業協会が中心となり、2016 年から実施しているストレステストの結果を踏まえ、為替変動リスクに伴う様々なリスクを各 FX 取扱会員が把握・分析し、それを今後のリスク管理の改善につなげていただくことが、ひいては業界全体としてのリスク管理の向上につながっていくものと考ええる。
- ストレステストの結果、業界全体として為替リスク管理態勢の見直しが進展しているものと認識しているが、課題も認識されており、ストレステストの継続的な実施をはじめ、業界全体における為替リスク管理の底上げをお願いしたい。
- また、本年 2 月に、法人顧客を相手方とする店頭 FX 取引について、店頭 FX 取扱会員の適切な為替リスク管理の確保の観点から証拠金規制を施行したところ、金融先物取引業協会及び各社の事前の入念な準備により、これまで問題なく対応出来ているものと承知している。引き続き、適時適切に必要な証拠金率を算出・公表出来るよう、業界内の適切な業務運営の確保に努めていただきたい。

(以上)