

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>- 2 - 4 取引先リスク管理態勢</p> <p>取引先リスクとは、取引先に対する債権の保有に伴うリスクをいい、取引先が義務を履行しないことなどにより、金融商品取引業者が損失を被るリスクである。金融商品取引業者は、取引先リスクを適切に管理していくことが重要である。</p> <p>(1) ~ (2) (略)</p> <p>(3) 具体的な取扱い ~ (略) <u>(新設)</u></p>	<p>- 2 - 4 取引先リスク管理態勢</p> <p>取引先リスクとは、取引先に対する債権の保有に伴うリスクをいい、取引先が義務を履行しないことなどにより、金融商品取引業者が損失を被るリスクである。金融商品取引業者は、取引先リスクを適切に管理していくことが重要である。</p> <p>(1) ~ (2) (略)</p> <p>(3) 具体的な取扱い ~ (略) <u>非清算店頭デリバティブ取引</u> <u>金商業等府令第 123 条第 1 項第 21 号の 5 及び第 9 項第 4 号口において、店頭デリバティブ取引残高が 3,000 億円以上の金融商品取引業者等は、非清算店頭デリバティブ取引を他の金融商品取引業者等と行う場合に、変動証拠金の預託等を求める措置を講じなければならないとしているところ。当該措置を講ずることが同府令において求められていない第一種金融商品取引業を行うものを含め、金融機関等を相手方とする非清算店頭デリバティブ取引について、バーゼル銀行監督委員会及び証券監督者国際機構における合意(注)を踏まえ、以下の点に留意し、変動証拠金の適切な管理に係る体制整備に努めているか。</u> <u>(注)バーゼル銀行監督委員会・証券監督者国際機構「中央清算されない店頭デリバティブ取引に係る証拠金規制に関する最終報告書」(平成 25 年 9 月)</u> <u>イ. 取引相手方との変動証拠金に係る適切な契約書(例えば、ISDA マス</u></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>__ ~ __ (略)</p>	<p><u>ターアグリーメント及びCSA契約)の締結</u> <u>ロ．取引の規模、リスク特性等を勘案した十分な頻度での定期的な変動</u> <u>証拠金の授受及びアドホックコール(証拠金の随時請求)に対応した</u> <u>変動証拠金の授受</u></p> <p>__ ~ __ (略)</p>