

○金融庁告示第十七号

金融商品取引業等に関する内閣府令（平成十九年内閣府令第五十二号）第二百二十三条第一項第二十一号の五口及び同項第二十一号の六口の規定に基づき、金融庁長官が定める方法を次のように定め、平成二十八年九月一日より適用する。

平成二十八年三月三十一日

金融庁長官 森 信親

（定義）

第一条 この告示において、次の各号に掲げる用語の意義は、それぞれ当該各号に定めるところによる。

- 一 非清算店頭デリバティブ取引 金融商品取引業等に関する内閣府令（以下「府令」という。）第二百二十三条第一項第二十一号の十に規定する非清算店頭デリバティブ取引をいう。
- 二 変動証拠金 府令第二百二十三条第一項第二十一号の十に規定する変動証拠金をいう。
- 三 預託等 府令第二百二十三条第一項第二十一号の十に規定する預託等をいう。
- 四 当初証拠金 府令第二百二十三条第一項第二十一号の十一に規定する当初証拠金をいう。

五 潜在的損失等見積額 府令第二百二十三条第一項第二十一号の十一に規定する潜在的損失等見積額をいう。

六 金融商品取引業者等 金融商品取引法（昭和二十三年法律第二十五号）第三十四条に規定する金融商品取引業者等をいう。

七 親会社等 金融商品取引法施行令（昭和四十年政令第三百二十一号）第十五条の十六第三項に規定する親会社等をいう。

八 子会社等 金融商品取引法施行令第十五条の十六第三項に規定する子会社等をいう。

（変動証拠金の計算方法）

第二条 府令第二百二十三条第一項第二十一号の十ロに規定する金融庁長官が定める方法は、次の各号に掲げる場合の区分に応じ、当該各号に定める方法とする。

一 非清算店頭デリバティブ取引の時価の合計額が零を上回る場合（相手方に変動証拠金の預託等をして
いる場合を除く。） 府令第二百二十三条第一項第二十一号の十イの規定に基づき算出した非清算店頭デリバティブ取引の時価の合計額から同号イの規定に基づき算出した当該相手方から預託等がされている

変動証拠金の時価（変動証拠金が府令第百二十三条第十項に規定する資産をもって充てられる場合には、同条第十一項に規定する方法により算出される当該資産に係る代用価格をいう。以下この条において同じ。）の合計額を控除する方法

二 非清算店頭デリバティブ取引の時価の合計額が零を上回る場合（相手方に変動証拠金の預託等をしている場合に限る。） 府令第百二十三条第一項第二十一号の十イの規定に基づき算出した非清算店頭デリバティブ取引の時価の合計額に同号イの規定に基づき算出した当該相手方に預託等をしている当該変動証拠金の時価の合計額を加える方法

三 非清算店頭デリバティブ取引の時価の合計額が零である場合又は零を下回る場合 府令第百二十三条第一項第二十一号の十イの規定に基づき算出した相手方に預託等をしている変動証拠金の時価の合計額から同号イの規定に基づき算出した非清算店頭デリバティブ取引の時価の合計額の絶対値の額を控除する方法

（当初証拠金の計算方法等）

第三条 府令第百二十三条第一項第二十一号の十一ロに規定する金融庁長官が定める方法は、同号イの規定

により算出した潜在的損失等見積額から、同号イの規定により算出した相手方から預託等がされている当初証拠金の時価（当初証拠金が府令第百二十三条第十項に規定する資産をもって充てられる場合には、同条第十一項に規定する方法により算出される当該資産に係る代用価格をいう。）の合計額及び潜在的損失等見積額から控除することができるとして当事者があらかじめ定めた額（当該定めがないときは、当該額は零とみなす。）を控除する方法とする。

2 前項に規定する潜在的損失等見積額から控除することができる額として当事者があらかじめ定めた額は、金融商品取引業者等並びにその親会社等、子会社等及び親会社等の子会社等（当該金融商品取引業者等を除く。）のいずれかが、当該相手方並びにその親会社等、子会社等及び親会社等の子会社等（当該相手方を除く。）のいずれかを行う非清算店頭デリバティブ取引において、合計して七十億円以下の額とする。