

「金融商品取引業者等検査マニュアル」(抄)

現行	改正(案)
<p data-bbox="219 296 775 328">- 1 - 2 態勢編・第一種金融商品取引業者</p> <p data-bbox="192 392 416 424">1. 内部管理態勢</p> <p data-bbox="210 488 443 520">(6) 業務運営状況</p> <p data-bbox="273 536 434 568">～ (略)</p> <p data-bbox="246 584 349 616">(新設)</p> <p data-bbox="237 823 488 855">__・__・__ (略)</p> <p data-bbox="192 967 443 999">2. リスク管理態勢</p> <p data-bbox="210 1062 667 1094">(2) リスク管理手法及び規程の整備</p> <p data-bbox="273 1110 434 1142">・ (略)</p> <p data-bbox="246 1158 349 1190">(新設)</p>	<p data-bbox="1160 296 1715 328">- 1 - 2 態勢編・第一種金融商品取引業者</p> <p data-bbox="1133 392 1357 424">1. 内部管理態勢</p> <p data-bbox="1151 488 1384 520">(6) 業務運営状況</p> <p data-bbox="1214 536 1375 568">～ (略)</p> <p data-bbox="1214 584 2047 807"><u>個人向けに通貨関連デリバティブ取引又は有価証券関連店頭デリバティブ取引を行う場合に、顧客の損失が預託した証拠金を上回ることがないようにロスカット水準を定めるなど、ロスカット取引を行うための体制を整備しているか。また、ロスカット取引を適切に行っているか。</u></p> <p data-bbox="1182 823 1433 855">__・__・__ (略)</p> <p data-bbox="1133 967 1384 999">2. リスク管理態勢</p> <p data-bbox="1151 1062 1608 1094">(2) リスク管理手法及び規程の整備</p> <p data-bbox="1214 1110 1375 1142">・ (略)</p> <p data-bbox="1214 1158 2047 1382"><u>低スプレッドの通貨関連店頭デリバティブ取引又は有価証券関連店頭デリバティブ取引を提供する場合に、低スプレッド取引のリスクを十分に認識し、当該取引の取引量、取引内容及び自社の財務状況に与える影響等を把握するなど、適切なリスク管理態勢を構築しているか。</u></p>

「金融商品取引業者等検査マニュアル」(抄)

<p>—</p> <p>- 2 - 2 業務編・第一種金融商品取引業者</p> <p>9 . 分別管理業務</p> <p>(5) <u>デリバティブ取引に係る顧客分別金</u></p> <ul style="list-style-type: none">・ (略) <p><u>店頭デリバティブ取引及び有価証券関連以外のデリバティブ取引に係る委託証拠金又はその代用有価証券については、自己の固有財産と明確に区分して管理しているか(分別管理は不要。)</u></p> <p><u>店頭金融先物取引に係る保証金の管理をカバー取引相手方に預託して行っている場合、当該保証金のうちカバー取引に該当しない自己取引に係る保証金がある場合は、カバー取引に係る保証金と自己取引に係る保証金とを明確に区分して管理しているか。</u></p>	<p>— (略)</p> <p>- 2 - 2 業務編・第一種金融商品取引業者</p> <p>9 . 分別管理業務</p> <p>(5) <u>デリバティブ取引に係る顧客分別金</u></p> <ul style="list-style-type: none">・ (略) <p><u>有価証券関連デリバティブ取引に係る保証金(第一種金融商品取引業者等を相手方とする場合を除く。)については、以下の取扱いがなされているか。</u></p> <p><u>イ 信託会社又は信託業務を営む金融機関へ信託しているか。</u></p> <p><u>ロ 顧客ごとの顧客区分管理金の額及びその合計額である顧客区分管理の必要額について、毎日計算を行っているか。</u></p> <p><u>ハ 信託財産の元本の評価額が顧客区分管理の必要額に満たない場合には、その日の翌日から起算して2営業日以内に不足額を信託財産に追加しているか。</u></p> <p><u>通貨関連デリバティブ取引に係る保証金(第一種金融商品取引業者等を相手方とする場合を除く。)については、以下の取扱いがなされているか。</u></p> <p><u>イ 信託会社又は信託業務を営む金融機関へ信託しているか。</u></p> <p><u>ロ 顧客ごとの顧客区分管理金の額及びその合計額である顧客区分管理の必要額について、毎日計算を行っているか。</u></p>
------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

「金融商品取引業者等検査マニュアル」(抄)

<p><u>カバー取引相手方へ預託した保証金について、相場の変動等により追加すべき保証金が発生した場合には、自己勘定において支払うこととし、顧客勘定として管理する他の顧客の保証金をこれに充てることのないよう管理しているか。</u></p>	<p><u>ハ 信託財産の元本の評価額が顧客区分管理の必要額に満たない場合には、その日の翌日から起算して2営業日以内に不足額を信託財産に追加しているか。</u></p> <p>(削除)</p>
-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--------------------------------------------------------------------------------------------------