

商品先物取引業者等の監督の基本的な指針改正（新旧対照表）

< 証拠金関連部分のみ抜粋 >

| 新  | 旧           |
|--|-------------|
| <p><u>VI-4 変動証拠金及び当初証拠金の授受に係る措置について</u></p> <p><u>金融商品取引業等に関する内閣府令（以下「金商業等府令」という。）第123条第1項第21号の5に定める変動証拠金及び同項第21号の6に定める当初証拠金については、以下の点に留意し監督するものとする。</u></p> <p><u>(1) 証拠金の授受</u></p> <p><u>金商業等府令における証拠金の授受に当たって、特定店頭商品デリバティブ取引業者（規則第168条第4項第4号の規定に基づき同号イに掲げる事項を届け出ることとされている特定店頭商品デリバティブ取引業者に限る。（2）において同じ。）は、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（金商業等府令第123条第1項第21号の5に規定する非清算店頭デリバティブ取引をいう。以下同じ。）において、同号及び第21号の6に規定する措置（変動証拠金及び当初証拠金の授受に係る措置）を講ずるに当たり、当該非清算店頭デリバティブ取引に店頭商品デリバティブ取引を含めた上で、「金融商品取引業者等向けの総合的な監督指針」の「IV-2-4（4）非清算店頭デリバティブ取引」等を参照して適切な対応をとるよう努めているか。</u></p> <p><u>また、金商業等府令第123条第10項第4号ロに規定する店頭デリバティブ取引に係る想定元本額の合計額の平均額が3000億円未満の特定店頭商品デリバティブ取引業者（第一種金融商品取引業者等（注）である者に限る。）であっても、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おける変動証拠金の授受等に関する体制整備について、当該店頭デリバティブ取引に店頭商品デリバティブ取引を含め、「金融商品取引業者等向けの総合的な監督指針」の「IV-2-4（4）非清算店頭デリバティブ取引」等を参照して、取引の規模やリスク特性</u></p> | <p>(新設)</p> |

等を勘案し、適切な対応をとるよう努めているか。

(注) 第一種金融商品取引業者及び登録金融機関のほか、「主要行等向けの総合的な監督指針」、「中小・地域金融機関向けの総合的な監督指針」、「系統金融機関向けの総合的な監督指針」、「保険会社向けの総合的な監督指針」、「信託会社等に関する総合的な監督指針」の対象となる者をいう。

(2) 定量的計算モデルの適合性の確保

「金融商品取引業等に関する内閣府令第百二十三条第一項第二十一号の六イの規定に基づき、金融庁長官が定める潜在的損失等見積額を算出する方法を定める件」(平成28年金融庁告示第15号。以下「金融庁告示」という。)第1条第1項の定量的計算モデルを用いる方法により、金商業等府令第123条第1項第21号の6イの潜在的損失等見積額を算出する特定店頭商品デリバティブ取引業者は、当該モデルの適合性を確保するため、以下の点に留意することとする。

- ① 当該定量的計算モデルの構築、使用その他の運用が、金融庁告示第3条から第6条の規定に適合しているか。
- ② 当該定量的計算モデルの構築、使用その他の運用が当該規定に反することとなったときは、特定店頭商品デリバティブ取引業者は、遅滞なく、その旨及びその内容を主務省に報告しているか。