

主要行等向けの総合的な監督指針 新旧対照表

現 行	改 正 案
<p>- 2 - 3 - 2 信用リスク管理 - 2 - 3 - 2 - 1 信用リスク管理・総論 - 2 - 3 - 2 - 1 - 2 主な着眼点</p> <p>(1) ~ (11) (略)</p> <p><u>(新設)</u></p>	<p>- 2 - 3 - 2 信用リスク管理 - 2 - 3 - 2 - 1 信用リスク管理・総論 - 2 - 3 - 2 - 1 - 2 主な着眼点</p> <p>(1) ~ (11) (略)</p> <p><u>(12) 金融商品取引業等に関する内閣府令第 123 条第 1 項第 21 号の 5 及び第 9 項第 4 号ロにおいて、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主要行等を含め、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></p> <p><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></p> <p><u>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 マスターアグリーメント及び CSA 契約)の締結</u></p> <p><u>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)に対応した変動証拠金の授受</u></p>