

平成 20 年 6 月 13 日

証券取引等監視委員会事務局証券検査課 御中

全 国 銀 行 協 会

「金融商品取引業者等検査マニュアル」の一部改正（案）に  
対する意見等の提出について

平成 20 年 5 月 14 日付で意見募集のありました標記に関する意見等を別紙のと  
おり取りまとめましたので、何卒ご高配賜りますようお願い申し上げます。

以 上

## 「金融商品取引業者等検査マニュアル」の一部改正(案)に対する意見等

該当箇所(改正案)	意見等(確認事項)
<p>Ⅱ-1-2 態勢編・第一種金融商品取引業者  Ⅱ-1-2 3. 自己資本規制関連リスクの管理態勢  Ⅱ-1-2 3. (7)マーケットリスクの管理  ③ 店頭金融先物取引において、顧客との取引とカバー取引とに時間差が生じる場合には、その間の相場の急激な変動等に備えたリスク管理態勢を整備しているか。また、カバー取引を行う際にカバー取引相手方との間で生じるシステム障害により取引が行えない間の相場の急激な変動等に備えたリスク管理態勢を整備しているか。</p> <p>Ⅱ-1-2 3. (8)信用リスク管理  ⑥ 外国為替関連取引、金利関連取引及び株式関連取引等について、適切な取り扱いを行っているか。  例えば、  イ～ニ(略)  ホ 店頭金融先物取引について、証拠金率(レバレッジ)に応じた適切なリスク管理態勢を整備しているか。また、顧客の損失が一定比率以上になった際に、自動的に反対取引により決済する、いわゆるロスカットルールを設定し、適切に運用しているか。</p> <p>Ⅱ-2-2 業務編・第一種金融商品取引業者  Ⅱ-2-2 5. デリバティブ営業  Ⅱ-2-2 5. (1)勧誘・取引実態の把握  ⑨ 店頭金融先物取引において、カバー取引相手方との取引、相場が急激に変動した場合の対応、自己勘定取引の有無、区分管理の状況について、顧客からの要請に応じて適切に説明を行っているか。</p>	<p>【確認事項】  Ⅱ-1-2 3. (7)③、同(8)⑥ホ、Ⅱ-2-2 5. (1)⑨の規定については、登録金融機関は、いわゆる外国為替証拠金取引を業として行う場合を除き、対象外と理解してよいか。</p> <p>【理由】  ○Ⅱ-1-2 3. (7)③、同(8)⑥ホ、Ⅱ-2-2 5. (1)⑨については、「改正の概要」にもあるとおり、いわゆる外国為替証拠金業者を対象としたものと考えられる。</p> <p>○Ⅱ-1-2 3. (7)③、Ⅱ-2-2 5. (1)⑨は、金融庁の「金融商品取引業者等向けの総合的な監督指針」ではⅣ-3-3-2(3)③～⑥、Ⅳ-3-3-4(1)①および④の記載内容に対応するものと考えられるが、同指針はこの部分を、(いわゆる外国為替証拠金取引を業として行う場合を除き)登録金融機関について適用除外としている(同指針Ⅷ-1)。</p> <p>○Ⅱ-1-2 3. (8)⑥ホは、上記監督指針では明記された箇所はないが、上記趣旨に鑑み、この部分も、登録金融機関について適用除外と扱われるものと考えられる。</p>