

取引証拠金の運用方針

取引参加者又は顧客から預託を受けた取引証拠金の運用方針について以下のとおり定める。

(1) 安全性の確保

- ① 運用対象は、金融商品取引法令で定められた、預金、貯金、日本国債又は金銭信託とし、預金、貯金又は金銭信託での運用先については、信用力の高い金融機関*とする。
- ② 運用先は、適切に分散する。

(2) 流動性の確保

- ① 運用は市場ストレス下で迅速に換金できる金額に限る。
- ② 預託を受けた取引証拠金の総額、過去の最低残高及び年間支払額等に照らして、一定期間当取引所に滞留すると合理的に見積もられる額を算定し、検証する。

(3) リスク管理

価格変動リスクについては、残存期間や商品性を勘案し、評価損益、リスク量を定期的に管理する。

* 複数の格付機関からA-格以上の格付けを取得している金融機関とする。