

「デリバティブ取引等に係る投資制限に関するガイドライン」の一部改正

平成 26 年 11 月 20 日  
(下線部分変更箇所)

新	旧
<p style="text-align: center;">デリバティブ取引等に係る投資制限に関するガイドライン</p> <p>1. 目的 本ガイドラインは、委託会社会員（投資信託及び投資法人に関する法律（昭和 26 年法律第 198 号）第 2 条第 11 項に規定する投資信託委託会社である会員をいう。以下同じ。）が「金融商品取引業等に関する内閣府令（平成 19 年府令第 52 号、以下「内閣府令」という。）」第 130 条第 1 項第 8 号及び「投資信託等の運用に関する規則」第 17 条に定めるデリバティブ取引等(以下「<u>デリバティブ取引等</u>」という。)に係る投資制限に該当しないよう適正に管理・運営していく上での基本的な考え方を示すことを目的とする。</p> <p>2. 基本的な考え方及び取扱い 委託会社会員は、デリバティブ取引等に係る投資を管理する方法については、「3」に掲げるリスク管理方法を参考に、あらかじめ社内規則に定め、府令の禁止行為に該当することのないよう適正に管理・運営するものとする。</p> <p>なお、このガイドラインにおいて示すリスク管理方法は例示であり、委託会社会員が適当と認めるリスク管理手法を社内規則において定めることを妨げるものではないことに留意する。</p> <p style="text-align: center;">(以下略)</p> <p><b>附 則</b> <u>この改正は、平成 26 年 12 月 1 日から実施する。</u></p>	<p style="text-align: center;">デリバティブ取引等に係る投資制限に関するガイドライン</p> <p>1. 目的 本ガイドラインは、委託会社会員（投資信託及び投資法人に関する法律（昭和 26 年法律第 198 号）第 2 条第 11 項に規定する投資信託委託会社である会員をいう。以下同じ。）が「金融商品取引業等に関する内閣府令（平成 19 年府令第 52 号、以下「内閣府令」という。）」第 130 条第 1 項第 8 号及び「投資信託等の運用に関する規則」第 17 条に定めるデリバティブ取引等に係る投資制限に該当しないよう適正に管理・運営していく上での基本的な考え方を示すことを目的とする。</p> <p>2. 基本的な考え方及び取扱い 委託会社会員は、デリバティブ取引 <u>(内閣府令第 130 条第 1 項第 8 号に規定するデリバティブ取引(新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券若しくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含む。))</u>をいう。以下同じ。)に係る投資を管理する方法については、「3」に掲げるリスク管理方法を参考に、あらかじめ社内規則に定め、府令の禁止行為に該当することのないよう適正に管理・運営するものとする。</p> <p>なお、このガイドラインにおいて示すリスク管理方法は例示であり、委託会社会員が適当と認めるリスク管理手法を社内規則において定めることを妨げるものではないことに留意する。</p> <p style="text-align: center;">(同 左)</p>