

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 7 に基づく
店頭外国為替証拠金取引に関する情報の保存及び同項第 21 号の 8 に基づく報告に関する規則（案）

2019. ○. ○制定
一般社団法人 金融先物取引業協会

（目的）

第 1 条 本規則は、店頭外国為替証拠金取引を取り扱う会員（以下「会員」という。）が金融商品取引業等に関する内閣府令（以下「金商業府令」という。）第 123 条第 1 項第 21 号の 7 及び同項第 21 号の 8 の規定に基づき当該取引に関する情報の保存及び本協会への報告を実施するにあたり必要な事項を定め、当該取引における不適切な取引の発見・防止機能の強化及び顧客への適切な取引機会の提供の確保を図ることを目的とする。

（定義）

第 2 条 本規則において、次の各号に掲げる用語の定義は、当該各号に定めるところによる。なお、本条で定めのない用語について、金融商品取引法（以下「法」という。）その他の法令に定めがある場合には、その定義に従うものとする。

（1）店頭外国為替証拠金取引

金商業府令第 117 条第 1 項第 28 号の 2 に規定する特定通貨関連店頭デリバティブ取引（法第 2 条第 8 項に規定する金融商品取引業から除かれるものを除く。以下「取引」という。）をいう。

（2）価格の配信

顧客からの注文の約定又は顧客の建玉の評価に用いる価格（以下「基本価格」という。）を生成し、顧客へ配信することをいう。

（3）注文価格

顧客が売買を希望する価格をいう。

（4）スリッページ

顧客の注文時の価格（顧客が注文価格を指定する注文においては当該注文価格をいい、顧客が注文価格を指定せずに行う注文においては当該顧客の注文時の表示価格をいい、顧客が注文執行の起点として価格を指定する注文においては当該指定する価格をいう。）と実際に約定した価格との相違をいう。

（対象）

第 3 条 本規則は、取引の媒介、取次ぎ又は代理（取引を媒介、取次ぎ又は代理する相手方が外国法人の場合を除く。）には適用しない。

(取引情報の保存)

第4条 会員は、顧客との取引が適正に行われていることを明らかにするために必要となる情報について、その作成又は取得の日から3年間（第4項第4号①に掲げる事項にあっては3月間）保存するものとする。

2 会員は、前項の情報について本協会へ報告する必要がある場合には速やかに、また、所定の期日がある場合には当該期日までに、本協会が指定する様式及び方法により報告可能な状態で保存するものとする。

3 第1項の情報は、次の各号に掲げる事項とする。

- (1) 価格の配信に関する情報
- (2) 注文に関する情報
- (3) 約定に関する情報
- (4) カバー取引に関する情報
- (5) その他自らの取引が適正に行われていることを明らかにするために必要になると会員が判断する情報

4 前項第1号の「価格の配信に関する情報」として保存すべき事項は、次の各号に掲げる事項とする。

- (1) 通貨ペア
- (2) 基本価格
- (3) 配信日時
- (4) 基本価格がその値となる根拠について説明するための次に掲げる情報
 - ① 当該基本価格の生成に用いたカバー取引先から取得した価格
 - ② 当該生成の過程で算出された価格
 - ③ ①又は②の情報と組み合わせることにより当該根拠について説明することが可能となる情報
- (5) 基本価格のうち、顧客に提示されていないものがある場合には、その提示の有無
- (6) 基本価格とは別に、発注に際して参照するための価格を顧客に提示している場合には、その通貨ペア、当該価格及び提示日時

5 第3項第2号の「注文に関する情報」として保存すべき事項は、次の各号に掲げる事項とする。

- (1) 識別情報
- (2) 注文の種類
- (3) 通貨ペア
- (4) 新規又は決済の別
- (5) 売り又は買いの別
- (6) 注文数量

- (7) 受注日時
 - (8) 注文価格又は注文執行の起点として指定する価格がある場合には、当該価格
 - (9) 顧客がスリッページの許容範囲を指定する場合には、当該範囲
 - (10) 注文期限がある場合には、当該期限
 - (11) 注文の変更若しくは取消し又は失効に関する情報
- 6 第3項第3号の「約定に関する情報」として保存すべき事項は、次の各号に掲げる事項とする。

- (1) 識別情報
- (2) 注文の種類
- (3) 通貨ペア
- (4) 新規又は決済の別
- (5) 売り又は買いの別
- (6) 約定数量
- (7) 約定日時
- (8) 約定価格
- (9) 顧客が指定した注文執行の条件がある場合には、当該条件を満たした日時
- (10) 手数料

- 7 第3項第4号の「カバー取引に関する情報」として保存すべき事項は、次の各号に掲げる事項とする。

- (1) 通貨ペア
- (2) 約定数量
- (3) 約定日時
- (4) 約定価格
- (5) カバー取引を発注した先及びギブアップ先がある場合には、その名称
- (6) カバー取引の発注に用いるプラットフォームの名称

- 8 会員は、顧客との取引を電気通信回線を通じて行う場合には、第4項第3号、第5項第7号、第6項第7号、9号及び前項第3号の日時に関する情報を1,000分の1秒以下の単位で保存するものとする。

(会員における保存態勢等の整備)

第5条 会員は、前条第3項各号に掲げる情報(以下この条において「当該情報」という。)の保存を確実にを行い、当該情報に基づき顧客との取引状況を点検するための態勢を整備するものとする。

- 2 会員は、前項の規定により点検を行った場合には、その記録を作成し、その作成の日から3年間保存するものとする。

- 3 会員は、顧客から当該会員との取引において不適切な状況が認められたとして損害賠

償その他の経済的な便宜を求める旨の申出があった場合その他会員が必要と認める場合には、当該情報を用いて当該申出に係る取引の検証を行い、その結果に基づいて当該顧客に具体的に説明するものとする。

- 4 会員は、前項の申出に関する記録を作成し、当該申出への対応が終了した日から3年間保存するものとする。
- 5 会員は、第3項の顧客以外の顧客から取引の適正性について具体的な説明を求められた場合には、自己の判断により、当該情報に基づき当該顧客に誠実に説明するものとする。

(協会への報告等)

第6条 会員は、第4条第3項第3号に掲げる約定に関する情報及びそれに係る同項第2号に掲げる注文に関する情報(次の各号に掲げる事項に限る。)その他本協会が必要と認める情報について、営業日ごとにまとめて翌営業日17時までに本協会へ報告するものとする。

- (1) 第4条第5項第7号に掲げる受注日時
 - (2) 前号の受注日時における基本価格(顧客が注文価格を指定しない注文の場合に限る。)
 - (3) 第4条第5項第8号に掲げる価格(顧客が注文執行の起点として指定する価格が相場変動に合わせて自動的に変更されるものを除く。)
- 2 会員は、前項又は次条第2項の規定により報告した情報を変更した場合には、翌営業日17時までに当該変更された情報を本協会へ報告するものとする。
 - 3 会員は、前条第4項の記録について月ごとにまとめて翌月10日までに本協会へ報告するものとする。

(協会における情報の分析)

第7条 本協会は、前条の規定により会員から報告された情報を分析し、その結果、次の各号に掲げる状況が認められる場合には、その要因を検証するものとする。

- (1) スリッページの発生状況が他の会員の傾向と大きく異なっている状況
 - (2) 約定価格が外国為替相場の実勢を反映したリファレンス・レートから大きく乖離していると認められる状況
 - (3) 取引時間中に継続的に約定がない事象が生じていると認められる状況
 - (4) その他本協会が必要と認める状況
- 2 本協会は、前項の要因を検証するにあたって必要な場合には、会員に説明を求め、又は第4条の規定により保存する情報のうち必要な情報について報告を求めるものとする。
 - 3 会員は、前項の求めがあった場合には、速やかに応じるものとする。
 - 4 本協会は、第1項の分析及び検証の結果に関して、月ごとにまとめて翌月20日までに金融庁へ報告するものとする。

(会員における報告態勢の整備)

第8条 会員は、第6条及び前条第2項の規定に基づく報告を、本協会所定の様式及び方法により確実にを行うための態勢を整備するものとする。

(協会における態勢整備等)

第9条 本協会は、第6条及び第7条第2項の規定により報告された情報（以下この条において「当該情報」という。）について、その報告を受けた日から3年間、電磁的方法により保存するものとする。

2 本協会は、次の各号に掲げる場合を除き、当該情報を第三者（金融庁を除く。）に提供してはならない。

(1) 法令に基づく場合

(2) 国の機関若しくは地方公共団体又はその委託を受けた者が法令の定める事務を遂行することに対して協力する必要がある場合

3 本協会は、本規則に基づく取引情報の保存・報告制度に係る態勢整備及び当該制度の運用に係る費用について、収支相償の原則に基づき、別に定めるところにより、当該制度を利用する会員に負担を求めるものとする。

(規則の見直し)

第10条 本規則の改正は、理事会の決定を以って行うものとする。

2 本協会は、本規則を改正する場合には、金融庁長官へ事前に通知するものとする。