

# FMI原則を踏まえた対応と論点

2013年1月31日

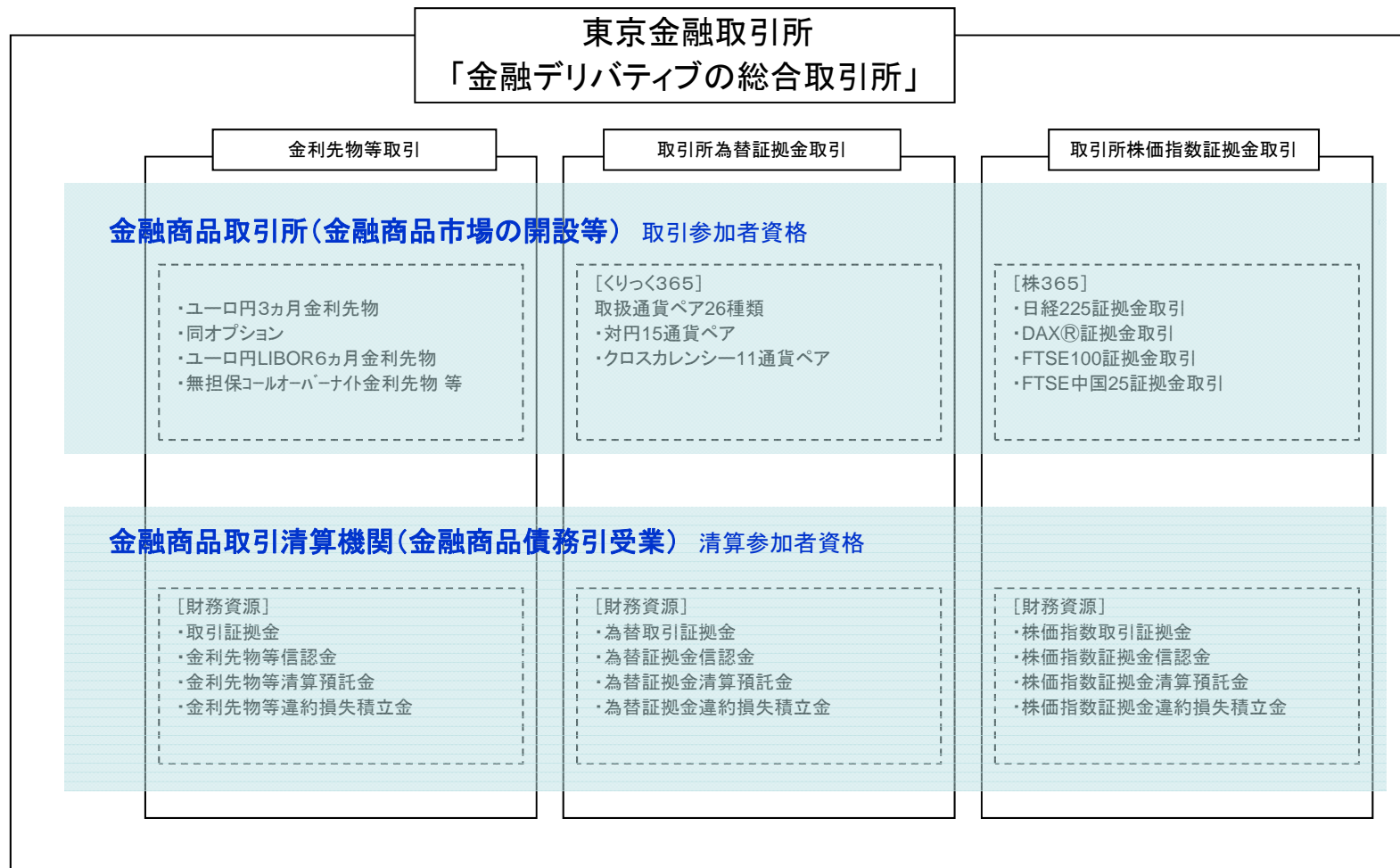
株式会社 東京金融取引所



金融取

株式会社 東京金融取引所  
Tokyo Financial Exchange Inc.

# I. 清算機関としての東京金融取引所



## Ⅱ．FMI原則に対する対応

### 『勧告』から『原則』へ

・2004年『清算機関のための勧告』への対応

- ・『清算機関のための勧告』から『FMI原則』への変更点を抽出
- ・『FMI原則』への適合状況を確認
- ・『情報開示の枠組みと評価方法』の遵守状況を自己評価

課題の洗出し

対応策の検討



### Ⅲ. 検討課題

#### [一例]

- ・FMI原則が求めるストレステストシナリオ
  - ・信用リスク
  - ・資金流動性リスク

財務資源総額の決定と定期的検証

- ・『FMI原則』が求める財務資源及び資金流動性資源
  - ・取引証拠金制度  
(片側信頼水準99%、バックテスト、感応度分析)
  - ・清算預託金制度 等

