規定する方法により算出される当該資産に係る代用価格をいう。以下イにおいて同じ。）の合計額又は当該相手方に預託等をしている変動証拠金の時価の合計額を毎日算出すること。

［ロ～ホ　略］

二十一の九　非清算店頭デリバティブ取引（法第二条第二十二項第五号に掲げる取引（通貨に係るものに限る。）のうち元本として定めた金額に相当する金銭又は金融商品（同条第二十四項第三号に掲げるものに限る。）を授受することを約する部分を除く。以下この号において同じ。）に係る当初証拠金（非清算店頭デリバティブ取引について将来発生し得る費用又は損失の合理的な見積額（以下この号において「潜在的損失等見積額」という。）に対応して預託等をする証拠金をいう。以下この号、第九項及び第十項並びに第百七十七条第一項第三号イにおいて同じ。）に関して次に掲げる行為を行うための措置を講じていないと認められる状況

イ　非清算店頭デリバティブ取引の相手方との間で次に掲げる事由が生じた場合に、当該相手方との間における非清算店頭デリバティブ取引に係る潜在的損失等見積額（あらかじめ金融庁長官に届け出た定量的計算モデルを用いる方法その他の金融庁長官が定める方法により算出されるものに限る。）並びに当該相手方から預託等がされている当初証拠金の時価（当初証拠金が第九項に規定する資産をもって充てられる場合には、第十項に規定する方法により算出される当該資産に係る代用価格をいう。以下イにおいて同じ。）の合計額及び当該相手方に預託等をしている当初証拠金の時価の合計額を算出すること。

［(1)～(3)　略］

規定する方法により算出される当該資産に係る代用価格をいう。以下イにおいて同じ。）の合計額又は当該相手方に預託等をしている変動証拠金の時価の合計額を毎日算出すること。

［ロ～ホ　同上］

二十一の六　非清算店頭デリバティブ取引（法第二条第二十二項第五号に掲げる取引（通貨に係るものに限る。）のうち元本として定めた金額に相当する金銭又は金融商品（同条第二十四項第三号に掲げるものに限る。）を授受することを約する部分を除く。以下この号において同じ。）に係る当初証拠金（非清算店頭デリバティブ取引について将来発生し得る費用又は損失の合理的な見積額（以下この号において「潜在的損失等見積額」という。）に対応して預託等をする証拠金をいう。以下この号、第八項及び第九項並びに第百七十七条第一項第三号イにおいて同じ。）に関して次に掲げる行為を行うための措置を講じていないと認められる状況

イ　非清算店頭デリバティブ取引の相手方との間で次に掲げる事由が生じた場合に、当該相手方との間における非清算店頭デリバティブ取引に係る潜在的損失等見積額（あらかじめ金融庁長官に届け出た定量的計算モデルを用いる方法その他の金融庁長官が定める方法により算出されるものに限る。）並びに当該相手方から預託等がされている当初証拠金の時価（当初証拠金が第八項に規定する資産をもって充てられる場合には、第九項に規定する方法により算出される当該資産に係る代用価格をいう。以下イにおいて同じ。）の合計額及び当該相手方に預託等をしている当初証拠金の時価の合計額を算出すること。

［(1)～(3)　同上］

［ロ～ト　略］

［二十二～三十　略］

［2～5　略］

6　第一項第二十一号の四から第二十一号の六までに規定する協会規則には、次に掲げる事項が定められていなければならない。

一　当該協会規則の定めるところによりストレステストを実施する金融商品取引業者に関する事項

二　当該協会規則の定めるところにより金融商品取引業者が実施するストレステストにおける外国為替相場の変動その他の変化に関する事項

三　当該協会規則の定めるところにより金融商品取引業者がストレステストを実施する頻度に関する事項

四　当該協会規則の定めるところにより金融商品取引業者が実施するストレステストにおいて、当該金融商品取引業者に生ずる損失の計算方法及び当該損失が当該金融商品取引業者の経営の健全性に与える影響の分析に関する事項

五　第一項第二十一号の五に規定する経営の健全性を確保するための措置に関する事項

六　当該協会規則の定めるところにより実施したストレステストの結果に係る報告に関する事項

七　当該協会規則を変更する場合には、あらかじめその内容を金融庁長官に通知する旨

7　第一項第二十一号の七の「特定店頭オプション取引」とは、店頭デリバティブ取引であって、法第二条第二十二項第三号に掲げる取引（同号に規定する権利を行使することにより成立する取引が同項第二号に掲げる取引であるものに限る。）又は同項第四号に掲げる取引のうち、これらの取引に係るオプションが行使された場合に一定額の金銭を授受することとなるものをいう。

［ロ～ト　同上］

［二十二～三十　同上］

［2～5　同上］

［項を加える。］

6　第一項第二十一号の四の「特定店頭オプション取引」とは、店頭デリバティブ取引であって、法第二条第二十二項第三号に掲げる取引（同号に規定する権利を行使することにより成立する取引が同項第二号に掲げる取引であるものに限る。）又は同項第四号に掲げる取引のうち、これらの取引に係るオプションが行使された場合に一定額の金銭を授受することとなるものをいう。