

---

# 取引証拠金の運用方針

---

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、銀行預金、金銭信託(元本保証しているものに限る)、国債、地方債又は政府保証債とし、銀行預金、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運用規模については、市場ストレス下で迅速に換金できる金額の範囲に限るものとする。
- ②一定期間の現金預託額と現金返戻額の差額及び過去の最低現金預託残高等に照らして、一定期間当社に滞留すると合理的に見積もられる額を算定し、運用を行うものとする。

## (3) リスク管理

有価証券の運用については、価格変動リスクに留意し、残存期間や商品性を勘案のうえ、定期的に評価損益を管理する。

---

※信用力の高い金融機関は、大手格付機関から A 格を取得している金融機関に限定する。