

## デリバティブ関連取扱暗号資産に関する規則

2020年4月24日

### 第1章 総則

#### (目的)

第1条 本規則は、会員が暗号資産関連デリバティブ取引の原資産とする暗号資産及び暗号資産関連金融指標とする暗号資産(以下併せて「デリバティブ関連取扱暗号資産」という。)の決定及び廃止その他の取扱い業務に関し、必要な事項を定めることを目的とする。

### 第2章 取扱審査の体制

#### (取扱審査)

第2条 会員は、デリバティブ関連取扱暗号資産の審査に関する社内規則を定めなければならない。

- 2 会員は、前項の社内規則の策定にあたっては、次の各号に掲げる事項(以下「必要審査項目」という。)を審査項目に含めなければならない。
  - イ 発行状況に関する事項
  - ロ 取引状況に関する事項
  - ハ 利用状況に関する事項
  - ニ 暗号資産の関係者に関する事項
  - ホ 暗号資産及び記録台帳の技術に関する事項
  - ヘ 対象プロジェクトに関する事項
- 3 会員は、当該暗号資産をデリバティブ関連取扱暗号資産として取り扱った場合に直面し得るリスク(以下「取扱リスク」という。)を包括的かつ具体的に検証の上、その取扱リスクを特定しなければならない。
- 4 会員は、前項に基づき特定した取扱リスクを、必要審査項目に基づいて適切に評価の上、当該暗号資産のデリバティブ関連取扱暗号資産としての取扱いの適否を審査しなければならない。また、会員は、本規則の施行時点でデリバティブ関連取扱暗号資産としての取扱いを開始している暗号資産についても、取扱いの適否を審査するよう努めなければならない。当該審査の結果、取扱いが不適切と判断される場合には、顧客の利益保護に十分配慮しつつ、第5章の規定に従い、取扱いを廃止しなければならない。

#### (社内体制)

第3条 会員は、デリバティブ関連取扱暗号資産を審査するに際して、次の各号に定める

体制を整備しなければならない。

- (1) 前条第3項に基づき取扱リスクを包括的かつ具体的に検証し、特定できる専門的知見を有する人材の確保
  - (2) 前条第4項に基づき審査を行う部門（以下「取扱審査部門」という。）並びにその責任者及び担当役員の設置
  - (3) デリバティブ関連取扱暗号資産の審査結果が取締役会その他これに準ずる意思決定機関に報告され、当該意思決定機関の下で最終的な取扱いの可否が決定される手続の確保
  - (4) デリバティブ関連取扱暗号資産の審査過程及び審査結果に係る資料の保存
- 2 会員は、取扱審査部門並びにその責任者及び担当役員を、営業部門から独立させるものとし、デリバティブ関連取扱暗号資産の審査を行うに際しては、取扱審査部門と営業部門が相互に牽制が図られる体制（役職の兼務の禁止を含むがこれに限られない。）を構築しなければならない。

### 第3章 新規取扱

（取扱いに慎重な判断を要する暗号資産）

第4条 会員は、デリバティブ関連取扱暗号資産として取り扱おうとする暗号資産の特性に鑑み、次の各号のいずれかに該当すると認められる場合には、その適否を慎重に判断しなければならない。

- (1) 法令又は公序良俗に違反する方法で利用されている又は利用されるおそれが高い暗号資産
  - (2) 犯罪に利用されている又は利用されるおそれが高い暗号資産
  - (3) マネー・ローンダリング及びテロ資金供与に利用されている又は利用されるおそれが高い暗号資産
- 2 会員は、デリバティブ関連取扱暗号資産として取り扱おうとする暗号資産の特性及び会員自身の体制に鑑み、次の各号のいずれかに該当すると認められる場合には、当該暗号資産をデリバティブ関連取扱暗号資産として取扱ってはならない。
- (1) 移転・保有記録の更新・保持に重大な支障・懸念が認められる暗号資産
  - (2) 前各号のほか、当該会員において金融商品取引法上の義務を適正かつ確実に履行できない又は困難な暗号資産
- 3 会員は、移転記録の追跡ができない又は著しく困難である暗号資産については、第1項第3号又は前項第2号に該当するおそれがあることから、これらの問題が解決されない限り、当該暗号資産を取り扱ってはならない。

（協会への届出）

第5条 会員は、新たな暗号資産のデリバティブ関連取扱暗号資産としての取扱いを開始する場合には、協会に対して、次の各号に掲げる書類を事前に届出なければならない

ない。

- (1) 協会が別に作成する審査報告書
  - (2) 協会が別に作成する当該暗号資産及び暗号資産関連金融指標の概要説明書  
(以下「概要説明書」という。)
  - (3) 当該暗号資産に関して顧客に開示・提供する資料等
  - (4) 当該暗号資産に係るホワイトペーパーその他当該暗号資産の内容を説明した資料
  - (5) 当該暗号資産の流通状況に関する資料（流通実績がある場合に限る。）
  - (6) 当該暗号資産に関連する事件・事故に関する資料
  - (7) 当該暗号資産を取り扱う暗号資産デリバティブ取引の概要書
  - (8) 概要説明書を作成・管理する者の氏名、役職、所属部署、経歴、連絡方法を記した書面
  - (9) 当該暗号資産の管理者等の関係者の反社会的勢力との関係性その他マネー・ローンダリング及びテロ資金供与の関連性について社内検証を行った資料
  - (10) その他協会が提出を求める書面又は資料
- 2 会員は、前項の届出を行った場合において、当該会員が当該暗号資産のデリバティブ関連取扱暗号資産としての取扱いを開始することについて、協会が異議を述べた場合においては、当該暗号資産のデリバティブ関連取扱暗号資産としての取扱いを開始してはならない。
- 3 協会は、前項に基づき異議を述べるにあたっては、会員から届出のあった暗号資産のデリバティブ関連取扱暗号資産としての取扱いの適否を判断するために必要な調査を行うものとする。

(概要説明書の公表等)

- 第6条 会員は、新たに暗号資産のデリバティブ関連取扱暗号資産としての取扱いを開始する場合には、自社のウェブサイトその他顧客が容易に閲覧可能な伝達手段を用いて、概要説明書を公表しなければならない。
- 2 会員は、定期的には又は必要に応じて適時に、概要説明書の内容を更新しなければならない。
  - 3 会員は、概要説明書を更新した場合には、更新後の概要説明書を協会に提出するとともに、自社のウェブサイトその他顧客が容易に閲覧可能な伝達手段を用いて、速やかにこれを公表しなければならない。

#### 第4章 取扱開始後の対応

(情報の収集等)

- 第7条 会員は、デリバティブ関連取扱暗号資産に関し、会員が特定した取扱リスク及び

当該暗号資産の価格に影響を及ぼすおそれのある情報の収集に努めなければならない。

- 2 会員は、デリバティブ関連取扱暗号資産に関し、会員が特定した取扱いリスク及び当該暗号資産の価格に著しい影響を及ぼすおそれのある重要な情報のうち、取扱い開始時点で考慮していなかった情報を入手した場合には、取締役会その他これに準ずる意思決定機関に報告しなければならない。
- 3 会員は、前項の場合において、当該情報を公表しないことにより顧客保護が図られないおそれが認められる場合には、自社のウェブサイトその他顧客が容易に閲覧可能な伝達手段を用いて、速やかに当該情報を公表しなければならない。

(取扱いリスクの検証)

第8条 会員は、定期的に又は必要に応じて適時に、デリバティブ関連取扱暗号資産に係る取扱いリスクの内容を検証し直すものとし、当該検証の結果、取扱いリスクの内容を更新する必要がある場合には、第2章の定めにしたがって、当該暗号資産のデリバティブ関連取扱暗号資産としての取扱いの可否を改めて判断しなければならない。

- 2 会員は、前項のほか、取扱いリスクを評価する前提事実が変更された場合など当該デリバティブ関連取扱暗号資産の取扱い判断に至った事情に大きな変更が生じた場合には、第2章の定めにしたがって、当該暗号資産のデリバティブ関連取扱暗号資産としての取扱いの可否を改めて判断しなければならない。
- 3 会員は、前二項に基づいて改めて当該暗号資産のデリバティブ関連取扱暗号資産としての取扱いの可否を判断した結果、当該暗号資産が第4条各項のいずれかに該当すること又はその他の事情により、事後的にデリバティブ関連取扱暗号資産としての取扱いが適切でないと判断した場合には、第5章の定めに従ってデリバティブ関連取扱暗号資産としての取扱いを中止又は廃止しなければならない。

## 第5章 取扱中止等

(一時中止時の対応)

第9条 会員は、特定のデリバティブ関連取扱暗号資産を対象とする暗号資産関連デリバティブ取引の取扱いを一時中止する場合には、原則として、一時中止を開始する日の前日(第5号に該当する場合には、一時中止を開始する日の30日前)までに、次の各号の事項について、自社のウェブサイトその他顧客が容易に閲覧可能な伝達手段を用いて、顧客に対して周知しなければならない。

- (1) 一時中止する暗号資産関連デリバティブ取引の対象とするデリバティブ関連取扱暗号資産の名称
- (2) 一時中止の開始日時
- (3) 一時中止の終了日時(未定の場合にはその旨)
- (4) 一時中止を行う理由

- (5) 一時中止する暗号資産関連デリバティブ取引の対象とするデリバティブ関連取扱暗号資産に関して顧客から預託を受けた財産を顧客に返還する場合には、当該返還等の方針及び顧客に返還等を行うために必要となる情報
- 2 会員は、一時中止を解除し、取扱いを再開する場合には、再開する日の1週間前までに、その旨を自社のウェブサイトその他顧客が容易に閲覧可能な伝達手段を用いて、顧客に対して周知しなければならない。ただし、一時中止の期間が1週間に満たない場合には、再開日の前日までに顧客に周知するものとする。
- 3 会員は、1年を超えて一時中止を続けてはならない。

(取扱廃止時の対応)

第10条 会員は、特定のデリバティブ関連取扱暗号資産を対象とする暗号資産関連デリバティブ取引の取扱いを廃止する場合には、取扱中止日の30日前までに、金融商品取引法第50条の2第6項に基づく廃業公告の実施とともに、自社のウェブサイトその他顧客が容易に閲覧可能な伝達手段を用いて、顧客に対して周知しなければならない。

- 2 前項に基づく周知を行う場合、会員は、次の各号の情報を顧客に提供しなければならない。
- (1) 取扱いを廃止する暗号資産関連デリバティブ取引に係るデリバティブ関連取扱暗号資産の名称
  - (2) 取扱廃止日時
  - (3) 取扱を廃止する理由

(協会への報告等)

第11条 会員は、特定のデリバティブ関連取扱暗号資産を対象とする暗号資産関連デリバティブ取引の取扱いを一時中止する場合には、原則として、当該中止を公表する前日までに、次の各号に掲げる事項を協会に報告しなければならない。

- (1) 第9条第1項各号の事項
  - (2) 顧客への周知の方法及び周知日
  - (3) 一時中止する暗号資産の保有者数、保有数量及び保有金額
- 2 会員は、特定のデリバティブ関連取扱暗号資産を対象とする暗号資産関連デリバティブ取引の一時中止に係る措置を解除し、当該暗号資産関連デリバティブ取引の取扱いを再開する場合には、当該再開を公表する日の相当期間前までに、次の各号に掲げる事由を協会に届け出なければならない。会員は、本項に基づく届出を行った場合において、当該会員が当該暗号資産関連デリバティブ取引の取扱いを再開することについて、協会から異議が出された場合においては、当該暗号資産関連デリバティブ取引の取扱いを再開してはならない。
- (1) 取扱いを再開する理由
  - (2) 顧客への周知の方法及び周知日

3 会員は、特定のデリバティブ関連取扱暗号資産を対象とする暗号資産関連デリバティブ取引の取扱いを廃止する場合には、当該廃止の2週間前までに、次の各号に掲げる事項を協会に報告しなければならない。

- (1) 前条第2項各号の事項
- (2) 顧客への周知の方法及び周知日
- (3) 取扱廃止の機関決定日

## 第6章 その他

(公表)

第12条 協会は、会員が新たなデリバティブ関連取扱暗号資産を対象とする暗号資産関連デリバティブ取引として取り扱う場合には、取扱開始日に、次の各号に掲げる事項を公表する。

- (1) 当該会員が新たに取り扱う暗号資産関連デリバティブ取引に係るデリバティブ関連取扱暗号資産の名称
- (2) 会員が作成した当該デリバティブ関連取扱暗号資産に係る概要説明書
- (3) 取扱開始日

2 協会は、会員が更新した概要説明書を受領した場合には、速やかにこれを公表する。

3 協会は、会員から前条第1項に基づく特定のデリバティブ関連取扱暗号資産を対象とする暗号資産関連デリバティブ取引の取扱いの一時中止の報告を受けた場合には、中止公表日と同日付けで、次の各号に掲げる事項を公表する。

- (1) 当該会員が特定のデリバティブ関連取扱暗号資産を対象とする暗号資産関連デリバティブ取引の取扱いを中止する暗号資産の名称
- (2) 取扱中止日時

4 協会は、会員から前条第2項に基づく暗号資産関連デリバティブ取引の取扱いの一時中止に係る再開の届出がなされた場合であって、当該届出に対して協会が異議を行わない場合には、取引再開の公表日と同日付けで、次の各号に掲げる事項を公表する。

- (1) 当該会員が取扱いを再開する暗号資産関連デリバティブ取引の対象とするデリバティブ関連取扱暗号資産の名称
- (2) 取引再開日時

5 協会は、会員から前条第3項に基づく暗号資産関連デリバティブ取引の取扱いの廃止の報告を受けた場合には、廃業公告日と同日付けで、次の各号に掲げる事項を公表する。

- (1) 当該会員が取扱いを廃止する暗号資産関連デリバティブ取引の対象とするデリバティブ関連取扱暗号資産の名称
- (2) 取扱廃止日時

(相互協力)

第 13 条 会員は、デリバティブ関連取扱暗号資産について、他の会員から当該暗号資産に係る情報（取扱リスクや暗号資産の価格に影響を及ぼすおそれのある情報を含むがこれに限られない。）の提供を求められた場合には、合理的な範囲においてこれに応じることに努めるものとする。