

2016年6月8日

株式会社日本証券クリアリング機構

**SPANパラメーター（売オプション1単位当たりの最低証拠金額）
の設定方法の見直しについて**

平素は当社清算・決済業務の運営に格別の御高配を賜り、厚く御礼申し上げます。

さて、当社では、エクイティ関連商品の売オプション1単位当たりの最低証拠金額について、足元までのカバレッジ状況を勘案し、現行の「基準日の原資産終値の1%相当額」から「基準日の原資産終値の0.4%相当額」に変更¹することとし、別紙のとおり、「SPANパラメーターの取扱い」を一部改定いたしますので、御通知申し上げます。

《本通知の別紙資料》

【別紙】 SPANパラメーターの取扱い

【参考資料】 見直し後の設定方法によるSPANリスク・パラメーター・ファイル（6／7本番ファイルを基に作成したサンプルファイル）

以 上

¹ 長期国債グループの同パラメーターについては、現行どおり「基準日原資産終値の0.01%相当額」とする。