

2016年7月5日

株式会社日本証券クリアリング機構

一部商品に係るプライス・スキャンレンジの設定方法の変更等について

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。

下記の商品グループのプライス・スキャンレンジ（PSR）の設定方法について、当社が定める「SPANパラメーターの取扱い」（参考）に基づき¹、下記のとおりとしますので御通知いたします。

記

1. 日経平均ボラティリティー・インデックスグループにおけるPSRの設定方法の変更

基準日までの4週間及び54週間における各商品グループの原資産の日々の価格変動率のうち、すべての取引日の99%（階級値換算）の日をカバーできる価格変動率の中で最小の数値に基準日における直近の各商品グループの原資産の終値を乗じて得た額のうち大きい方の額に10,000円を乗じて得た額とします。²

2. 日経平均・配当指数グループ、TOPIX配当指数グループ及びTOPIX Core 30配当指数グループにおけるPSRの設定方法の変更

基準日における各配当指数グループの原資産終値のY%（各配当指数グループの先物取引の立会取引における呼値の単位の整数倍に切り上げる）に各配当指数グループの先物取引の取引換算乗数を乗じて得た額とします。³

※Y%については、日経平均・配当指数グループ及びTOPIX配当指数グループは3%、TOPIX Core 30配当指数グループは5%とします。

¹ 「SPANパラメーターの取扱い」Ⅱ. 1. ③において、PSRの水準が原資産の変動に対して明らかに低い場合など、当該グループに適用する設定方法により算出するPSRが適当でない場合には、原資産の終値に当社が定める率を乗じる方法でPSRを算出することとしております。この度、日経平均VIグループはこの対象から外れ、一方、各配当指数グループは新たにこれに該当します。

² 現行は、基準日における日経平均VIの終値の30%（0.05の整数倍に切り上げる）に10,000円を乗じて得た額としています。また、日経平均VIグループのその他のSPANパラメーターの設定方法については、SPANパラメーターの取扱いに定めるとおりとします。

³ 現行は、「1. 日経平均ボラティリティー・インデックスグループのPSRの設定方法の変更」に記載の方法で設定しています。各配当指数グループのその他のSPANパラメーターの設定方法については、SPANパラメーターの取扱いに定めるとおりとします。

3. 上記1及び2の適用開始日

2016年7月15日を基準日として算出するSPANパラメーターから適用します。

《本通知の参考資料》

【参考】SPANパラメーターの取扱い

以 上

《本件に関するお問合せ先》

株式会社日本証券クリアリング機構 取引所取引清算グループ

T e l : 03-3665-1381

E - m a i l : dailybiz@jscc.co.jp