

当初証拠金所要額の算出のためのストレスイベントシナリオについて

2014年11月4日

改正	2015年5月25日	2015年7月13日
	2015年9月24日	2015年10月19日
	2016年1月12日	2016年4月11日
	2016年10月11日	2017年1月16日
	2017年4月10日	2017年7月10日
	2017年10月23日	2018年4月9日
	2018年7月9日	2019年7月12日
	2020年4月13日	2020年7月6日
	2021年1月12日	2021年10月11日
	2021年12月6日	2022年4月11日
	2022年7月11日	2022年10月11日
	2023年1月10日	2023年4月10日
	2023年7月10日	2023年7月24日
	2023年10月10日	2024年1月9日
	2024年4月8日	2024年4月22日

株式会社日本証券クリアリング機構

金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の取扱い別表2第1項第1号d及びeに規定する、ストレスイベントシナリオ想定変動イールド・カーブの作成及びストレスイベントシナリオ想定変動値段による先物清算値段価値の算出の対象とする期間は別紙のとおりとする。

別紙の期間について作成したイールド・カーブにより算出した正味現在価値又は想定変動値段により算出した先物清算値段価値、先物約定値段価値若しくは先物日中価値の変動額のうち、当該変動額が負の数となるもののうちその絶対値が大きい上位3つの額を、金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の取扱い別表2第1項第1号a(b)、同第2項第1号b(b)及び同第3項第1号b(b)に定める額とする。

以上

当初証拠金所要額の算出のためのストレスイベントシナリオ対象期間

2006年6月13日
2006年7月18日
2006年8月25日から同月31日まで
2008年4月25日から同月28日まで
2008年6月23日
2008年10月8日から同月21日まで
2008年11月4日
2009年3月2日から同月12日まで
2009年11月10日
2009年11月17日
2010年3月4日
2010年3月11日
2010年5月17日
2010年9月1日から同月3日まで
2013年1月15日
2013年4月12日
2013年5月13日から同月15日まで
2013年5月23日から同月24日まで
2016年2月1日から同月9日まで
2016年8月3日から同月4日まで
2020年3月18日から同月23日まで
2022年6月15日
2022年12月21日から同月23日まで
2023年1月16日から同月23日まで
2023年3月14日から同月16日まで
2023年8月3日