

代用有価証券の掛目の変更に伴う
「先物・オプション取引に係る取引証拠金等に関する規則」等の一部改正について

I. 改正趣旨

代用有価証券の代用価格算出のために時価に乗すべき率について、直近の市場実勢を踏まえた水準に見直しを行うこととし、証券取引等清算業務について規定する「先物・オプション取引に係る取引証拠金等に関する規則」等について、別紙のとおり所要の改正を行う。

II. 改正概要

○ 時価に乗すべき率の見直し

- ・ 代用有価証券のうち債券の代用価格算出のために時価に乗じる率について、直近の市場実勢を踏まえた水準に変更を行う。

(備 考)

- ・ 先物・オプション取引に係る取引証拠金等に関する規則 別表
- ・ 業務方法書の取扱い 別表第1

III. 施行日

2017年1月10日から施行する。

以 上

「先物・オプション取引に係る取引証拠金等に関する規則」等の一部改正新旧対照表

目 次

1. 先物・オプション取引に係る取引証拠金等に関する規則
2. 業務方法書の取扱い

先物・オプション取引に係る取引証拠金等に関する規則の一部改正新旧対照表

新			旧		
別表 代用有価証券の種類及びその代用価格等に関する表			別表 代用有価証券の種類及びその代用価格等に関する表		
1 (略)			1 (略)		
2 前項の有価証券の種類、時価及び当社の定める率は以下のとおりとする。			2 前項の有価証券の種類、時価及び当社の定める率は以下のとおりとする。		
有価証券の種類	時価	時価に乗すべき率	有価証券の種類	時価	時価に乗すべき率
国債証券	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するものの	当該売買参考統計値のうち平均値	国債証券	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するものの	当該売買参考統計値のうち平均値
	売買参考統計値が発表されていないものうち国内の金融商品取引所において上場されているもの	金融商品取引所(注1)における最終価格(注2)			
		(1) 国債証券(変動利付国債、分離元本振替国債及び分離利息振替国債を除く。) a 残存期間1年以内のもの 100分の99 b 残存期間1年超5年以内のもの 100分の98 c 残存期間5年超10年以内のもの 100分の97 d 残存期間10年超20年以内のもの 100分の96 e 残存期間20年超30年以内のもの 100分の94 f 残存期間30年超のもの 100分の93 (2) 変動利付国債 a 残存期間1年以内のもの 100分の99 b 残存期間1年超5年以内のもの 100分の98 c 残存期間5年超10年以内のもの 100分の98 d 残存期間10年超20年以内のもの 100分の97 (3) 分離元本振替国債及び分離利息振替国債 a 残存期間1年以内のもの 100分の98 b 残存期間1年超5年以内のもの 100分の98 c 残存期間5年超10年以内のもの 100分の97 d 残存期間10年超20年以内のもの 100分の96 e 残存期間20年超30年以内のもの 100分の93 f 残存期間30年超のもの 100分の92			(1) 国債証券(変動利付国債、分離元本振替国債及び分離利息振替国債を除く。) a 残存期間1年以内のもの 100分の99 b 残存期間1年超5年以内のもの 100分の99 c 残存期間5年超10年以内のもの 100分の98 d 残存期間10年超20年以内のもの 100分の97 e 残存期間20年超30年以内のもの 100分の94 f 残存期間30年超のもの 100分の93 (2) 変動利付国債 a 残存期間1年以内のもの 100分の99 b 残存期間1年超5年以内のもの 100分の98 c 残存期間5年超10年以内のもの 100分の98 d 残存期間10年超20年以内のもの 100分の97 (3) 分離元本振替国債及び分離利息振替国債 a 残存期間1年以内のもの 100分の98 b 残存期間1年超5年以内のもの 100分の98 c 残存期間5年超10年以内のもの 100分の97 d 残存期間10年超20年以内のもの 100分の96 e 残存期間20年超30年以内のもの 100分の93 f 残存期間30年超のもの 100分の91

政府保証債券 金融商品取引法施行令第2条の11に定める債券である円貨債券(注3)	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの	当該売買参考統計値のうち平均値	(1) 残存期間1年以内のもの 100分の98 (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の97 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の96 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の95 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の93 (6) 残存期間30年超のもの 100分の92	政府保証債券 金融商品取引法施行令第2条の11に定める債券である円貨債券(注3)	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの	当該売買参考統計値のうち平均値	(1) 残存期間1年以内のもの 100分の98 (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の98 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の97 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の96 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の93 (6) 残存期間30年超のもの 100分の92
	売買参考統計値が発表されていないものうち国内の金融商品取引所において上場されているもの	金融商品取引所(注1)における最終価格(注2)			売買参考統計値が発表されていないものうち国内の金融商品取引所において上場されているもの	金融商品取引所(注1)における最終価格(注2)	
アメリカ合衆国財務省証券		ニューヨーク市場における前日の最終の気配相場	(1) 残存期間1年以内のもの 100分の87 (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の87 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の87 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の87 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の87 (6) 残存期間30年超のもの 100分の87	アメリカ合衆国財務省証券		ニューヨーク市場における前日の最終の気配相場	(1) 残存期間1年以内のもの 100分の88 (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の88 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の88 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の88 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の88 (6) 残存期間30年超のもの 100分の87
地方債証券(注3)	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの	当該売買参考統計値のうち平均値	(1) 残存期間1年以内のもの 100分の98 (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の97 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の96 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の95 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の93 (6) 残存期間30年超のもの 100分の92	地方債証券(注3)	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの	当該売買参考統計値のうち平均値	(1) 残存期間1年以内のもの 100分の98 (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の98 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の97 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の96 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の93 (6) 残存期間30年超のもの 100分の92
	売買参考統計値が発表されていないものうち国内の金融商品取引所において上場されているもの	金融商品取引所(注1)における最終価格(注2)			売買参考統計値が発表されていないものうち国内の金融商品取引所において上場されているもの	金融商品取引所(注1)における最終価格(注2)	
特殊債券(政府保証債券を除く。)(注4) 社債券(新株予約権付社債券及び交換社債券を除く。)(注3)(注4)	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの	当該売買参考統計値のうち平均値	(1) 残存期間1年以内のもの 100分の97 (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の97 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の96 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の95 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の92 (6) 残存期間30年超のもの 100分の92	特殊債券(政府保証債券を除く。)(注4) 社債券(新株予約権付社債券及び交換社債券を除く。)(注3)(注4)	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの	当該売買参考統計値のうち平均値	(1) 残存期間1年以内のもの 100分の97 (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の97 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の96 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の95 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の92 (6) 残存期間30年超のもの 100分の91
	売買参考統計値が発表されていないものうち国内の金融商品取引所において上場されているもの	金融商品取引所(注1)における最終価格(注2)			売買参考統計値が発表されていないものうち国内の金融商品取引所において上場されているもの	金融商品取引所(注1)における最終価格(注2)	

円貨建外国債券(金融商品取引法施行令第2条の11に定める債券である円貨債券、転換社債型新株予約権付社債券及び交換社債券を除く。)(注3)(注4)	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの	当該売買参考統計値のうち平均値	(1) 残存期間1年以内のもの <u>100分の85</u> (2) 残存期間1年超5年以内のもの <u>100分の85</u> (3) 残存期間5年超10年以内のもの <u>100分の84</u> (4) 残存期間10年超20年以内のもの <u>100分の83</u> (5) 残存期間20年超30年以内のもの <u>100分の80</u> (6) 残存期間30年超のもの 100分の80	円貨建外国債券(金融商品取引法施行令第2条の11に定める債券である円貨債券、転換社債型新株予約権付社債券及び交換社債券を除く。)(注3)(注4)	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの	当該売買参考統計値のうち平均値	(1) 残存期間1年以内のもの <u>100分の86</u> (2) 残存期間1年超5年以内のもの <u>100分の86</u> (3) 残存期間5年超10年以内のもの <u>100分の85</u> (4) 残存期間10年超20年以内のもの <u>100分の84</u> (5) 残存期間20年超30年以内のもの <u>100分の81</u> (6) 残存期間30年超のもの 100分の80
(略)				(略)			
(注) 1.～5. (略)				(注) 1.～5. (略)			
3 (略)				3 (略)			
付 則(平成29年1月10日) この改正規定は、平成29年1月10日から施行する。							

業務方法書の取扱いの一部改正新旧対照表

新			旧		
別表第1 代用有価証券の種類及びその代用価格等に関する表			別表第1 代用有価証券の種類及びその代用価格等に関する表		
1 業務方法書第15条の2第3項及び第4項、第16条第3項及び第4項、第52条第2項及び第3項並びに第70条第2項及び第3項に定める当社が適当と認める有価証券の種類並びに当社が定める時価及び率は以下のとおりとする。			1 業務方法書第15条の2第3項及び第4項、第16条第3項及び第4項、第52条第2項及び第3項並びに第70条第2項及び第3項に定める当社が適当と認める有価証券の種類並びに当社が定める時価及び率は以下のとおりとする。		
有価証券の種類	時価	時価に乗すべき率	有価証券の種類	時価	時価に乗すべき率
国債証券	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの	(1) 国債証券(変動利付国債、分離元本振替国債及び分離利息振替国債を除く。) a 残存期間1年以内のもの 100分の99 b 残存期間1年超5年以内のもの 100分の98 c 残存期間5年超10年以内のもの 100分の97 d 残存期間10年超20年以内のもの 100分の96 e 残存期間20年超30年以内のもの 100分の94 f 残存期間30年超のもの 100分の93 (2) 変動利付国債 a 残存期間1年以内のもの 100分の99 b 残存期間1年超5年以内のもの 100分の98 c 残存期間5年超10年以内のもの 100分の98 d 残存期間10年超20年以内のもの 100分の97	国債証券	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの	(1) 国債証券(変動利付国債、分離元本振替国債及び分離利息振替国債を除く。) a 残存期間1年以内のもの 100分の99 b 残存期間1年超5年以内のもの 100分の99 c 残存期間5年超10年以内のもの 100分の98 d 残存期間10年超20年以内のもの 100分の97 e 残存期間20年超30年以内のもの 100分の94 f 残存期間30年超のもの 100分の93 (2) 変動利付国債 a 残存期間1年以内のもの 100分の99 b 残存期間1年超5年以内のもの 100分の98 c 残存期間5年超10年以内のもの 100分の98 d 残存期間10年超20年以内のもの 100分の97
	売買参考統計値が発表されていないものうち国内の金融商品取引所において上場されているもの	金融商品取引所(注1)における最終価格(注2)		(3) 分離元本振替国債及び分離利息振替国債 a 残存期間1年以内のもの 100分の98 b 残存期間1年超5年以内のもの 100分の98 c 残存期間5年超10年以内のもの 100分の97 d 残存期間10年超20年以内のもの 100分の96 e 残存期間20年超30年以内のもの 100分の93 f 残存期間30年超のもの 100分の92	売買参考統計値が発表されていないものうち国内の金融商品取引所において上場されているもの

政府保証債券 金融商品取引法施行令第2条の11に定める債券である円貨債券(注3)	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの	当該売買参考統計値のうち平均値	(1) 残存期間1年以内のもの 100分の98 (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の97 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の96 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の95 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の93 (6) 残存期間30年超のもの 100分の92
	売買参考統計値が発表されていないものうち国内の金融商品取引所において上場されているもの	金融商品取引所(注1)における最終価格(注2)	
地方債証券(注3)	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの	当該売買参考統計値のうち平均値	(1) 残存期間1年以内のもの 100分の98 (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の97 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の96 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の95 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の93 (6) 残存期間30年超のもの 100分の92
	売買参考統計値が発表されていないものうち国内の金融商品取引所において上場されているもの	金融商品取引所(注1)における最終価格(注2)	
特殊債券(政府保証債券を除く。)(注4) 社債券(新株予約権付社債券及び交換社債券を除く。)(注3)(注4)	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの	当該売買参考統計値のうち平均値	(1) 残存期間1年以内のもの 100分の97 (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の97 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の96 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の95 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の92 (6) 残存期間30年超のもの 100分の92
	売買参考統計値が発表されていないものうち国内の金融商品取引所において上場されているもの	金融商品取引所(注1)における最終価格(注2)	
円貨建外国債券(金融商品取引法施行令第2条の11に定める債券である円貨債券、転換社債型新株予約権付社債券及び交換社債券を除く。)(注3)(注4)	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの	当該売買参考統計値のうち平均値	(1) 残存期間1年以内のもの 100分の85 (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の85 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の84 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の83 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の80 (6) 残存期間30年超のもの 100分の80
	売買参考統計値が発表されていないものうち国内の金融商品取引所において上場されているもの	金融商品取引所(注1)における最終価格(注2)	
(略)			

(注) 1. ~5. (略)

2~8 (略)

政府保証債券 金融商品取引法施行令第2条の11に定める債券である円貨債券(注3)	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの	当該売買参考統計値のうち平均値	(1) 残存期間1年以内のもの 100分の98 (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の98 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の97 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の96 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の93 (6) 残存期間30年超のもの 100分の92
	売買参考統計値が発表されていないものうち国内の金融商品取引所において上場されているもの	金融商品取引所(注1)における最終価格(注2)	
地方債証券(注3)	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの	当該売買参考統計値のうち平均値	(1) 残存期間1年以内のもの 100分の98 (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の98 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の97 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の96 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の93 (6) 残存期間30年超のもの 100分の92
	売買参考統計値が発表されていないものうち国内の金融商品取引所において上場されているもの	金融商品取引所(注1)における最終価格(注2)	
特殊債券(政府保証債券を除く。)(注4) 社債券(新株予約権付社債券及び交換社債券を除く。)(注3)(注4)	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの	当該売買参考統計値のうち平均値	(1) 残存期間1年以内のもの 100分の97 (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の97 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の96 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の95 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の92 (6) 残存期間30年超のもの 100分の91
	売買参考統計値が発表されていないものうち国内の金融商品取引所において上場されているもの	金融商品取引所(注1)における最終価格(注2)	
円貨建外国債券(金融商品取引法施行令第2条の11に定める債券である円貨債券、転換社債型新株予約権付社債券及び交換社債券を除く。)(注3)(注4)	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの	当該売買参考統計値のうち平均値	(1) 残存期間1年以内のもの 100分の86 (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の86 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の85 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の84 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の81 (6) 残存期間30年超のもの 100分の80
	売買参考統計値が発表されていないものうち国内の金融商品取引所において上場されているもの	金融商品取引所(注1)における最終価格(注2)	
(略)			

(注) 1. ~5. (略)

2~8 (略)

付 則(平成29年1月10日)

この改正規定は、平成29年1月10日から施行する。