

## 「清算基金所要額に関する規則」の一部改正について

### 1. 改正趣旨

平成26年1月6日に予定する次期清算システムの稼働により、現物取引に係る清算基金の日中預託制度において、決済日当日の決済進捗を踏まえた清算基金所要額の算出が可能となることに伴い、清算基金所要額に関する規則について、所要の改正を行う。

### 2. 改正概要

(備考)

○日中預託制度に係る清算基金所要額

- ・現物清算基金所要額（日中算出分）について、決済日当日の決済進捗を踏まえて算出することとする。

・清算基金所要額に関する規則別表2

### 3. 施行日

平成26年1月6日から施行する。

以上

清算基金所要額に関する規則の一部改正新旧対照表

新	旧
<p>別表 2 現物清算基金所要額（日中算出分）の算出に関する表</p> <p>現物清算基金所要額（日中算出分）（現物清算資格に係る清算基金所要額（日中算出分）をいう。以下同じ。）は、次の計算式により算出される額（当該額が負である場合はゼロ）とする。ただし、当該額が適当でないと認められる場合には、当社が定める額とする。なお、計算式における用語の意義は、次の（a）から（c）までに定めるとおりとする。</p> <p>現物清算基金所要額（日中算出分） ＝（総値洗損失相当額（日中算出分）＋総想定損失相当額（日中算出分））×（1＋その他有価証券加算率）</p> <p>（a） 総値洗損失相当額（日中算出分）とは、別表 1 第 1 項 b の（a）の規定中「当日までの」とあるのは「当日の午前立会終了後、当社が確認した」と、「値洗損失相当額」とあるのは「値洗損失相当額（日中算出分）」と、「総買付有価証券当日評価額」とあるのは「総買付有価証券前場評価額」と、「総売付有価証券当日評価額」とあるのは「総売付有価証券前場評価額」と、「翌日の当該銘柄に係る D V P 清算値段」とあるのは「午前立会終了時の当該銘柄に係る日中清算値段」と、「D V P 清算値段がない銘柄については、当社が定める値段」とあるのは「日中清算値段がない銘柄については、当社が定める値段」と、それぞれ読み替えて同（a）の規定により計算した額をいう。なお、日中清算値段とは、各銘柄の当日の午前立会における売買状況に基づき、各銘柄の当日の午前立会終了時の約定値段として業務方法書の取扱い第 1 1 条に定める D V P 清算値段の算出方法に準じて算出した値段をいう（次（b）におい</p>	<p>別表 2 現物清算基金所要額（日中算出分）の算出に関する表</p> <p>現物清算基金所要額（日中算出分）（現物清算資格に係る清算基金所要額（日中算出分）をいう。以下同じ。）は、次の計算式により算出される額（当該額が負である場合はゼロ）とする。ただし、当該額が適当でないと認められる場合には、当社が定める額とする。なお、計算式における用語の意義は、次の（a）から（c）までに定めるとおりとする。</p> <p>現物清算基金所要額（日中算出分） ＝（総値洗損失相当額（日中算出分）＋総想定損失相当額（日中算出分））×（1＋その他有価証券加算率）</p> <p>（a） 総値洗損失相当額（日中算出分）とは、別表 1 第 1 項 b の（a）の規定中「当日までの」とあるのは「当日の午前立会終了後、当社が確認した」と、「<u>未決済のもの</u>」とあるのは「<u>未決済のもの（当日が決済日であるものを除く。）</u>」と、「値洗損失相当額」とあるのは「値洗損失相当額（日中算出分）」と、「総買付有価証券当日評価額」とあるのは「総買付有価証券前場評価額」と、「総売付有価証券当日評価額」とあるのは「総売付有価証券前場評価額」と、「翌日の当該銘柄に係る D V P 清算値段」とあるのは「午前立会終了時の当該銘柄に係る日中清算値段」と、「D V P 清算値段がない銘柄については、当社が定める値段」とあるのは「日中清算値段がない銘柄については、当社が定める値段」と、それぞれ読み替えて同（a）の規定により計算した額をいう。なお、日中清算値段とは、各銘柄の当日の午前立会における売買状況に基づき、各銘柄の当日の午前立会終了時の約定値段として業務方法書の取扱い第 1</p>

て同じ。)

(b) 総想定損失相当額(日中算出分)とは、別表1第1項bの(b)の規定中「、当日までの」とあるのは「、当日の午前立会終了後、当社が確認した」と、「差引有価証券当日評価額」とあるのは「差引有価証券前場評価額」と、「翌日の当該銘柄に係るDVP清算値段」とあるのは「午前立会終了時の当該銘柄に係る日中清算値段」と、「当該銘柄のDVP清算値段変動率の当日から起算して120日前から当日までの間の99%カバー最小値」とあるのは「当該銘柄のDVP清算値段変動率の当日から起算して120日前から前日までの間の数値及び当該銘柄の当日の午前立会变動率の99%カバー最小値」と、それぞれ読み替えて同(b)の規定により計算した額をいう。なお、各銘柄の午前立会变動率とは、次に定める計算式により算出される数値をいう。

各銘柄の午前立会变動率

$$= \frac{|\text{一の日の各銘柄の日中清算値段} - \text{前日の各銘柄のDVP清算値段}|}{\text{前日の各銘柄のDVP清算値段}}$$

(c) (略)

付 則

この改正規定は、平成26年1月6日から施行する。

1条に定めるDVP清算値段の算出方法に準じて算出した値段をいう(次(b)において同じ。)

(b) 総想定損失相当額(日中算出分)とは、別表1第1項bの(b)の規定中「、当日までの」とあるのは「、当日の午前立会終了後、当社が確認した」と、「未決済のものとあるのは「未決済のもの(当日が決済日であるものを除く。)」と、「差引有価証券当日評価額」とあるのは「差引有価証券前場評価額」と、「翌日の当該銘柄に係るDVP清算値段」とあるのは「午前立会終了時の当該銘柄に係る日中清算値段」と、「当該銘柄のDVP清算値段変動率の当日から起算して120日前から当日までの間の99%カバー最小値」とあるのは「当該銘柄のDVP清算値段変動率の当日から起算して120日前から前日までの間の数値及び当該銘柄の当日の午前立会变動率の99%カバー最小値」と、それぞれ読み替えて同(b)の規定により計算した額をいう。なお、各銘柄の午前立会变動率とは、次に定める計算式により算出される数値をいう。

各銘柄の午前立会变動率

$$= \frac{|\text{一の日の各銘柄の日中清算値段} - \text{前日の各銘柄のDVP清算値段}|}{\text{前日の各銘柄のDVP清算値段}}$$

(c) (略)