

国債証券先物取引における受渡決済制度の変更等及び円位未満の呼値の単位の定められる株券に係るDVP清算値段等の取扱いの変更に伴う「業務方法書」等の一部改正について

2015年2月17日
株式会社日本証券クリアリング機構

1. 改正趣旨

株式会社大阪取引所に上場する国債証券先物取引（Large 取引）について受渡決済における経過利子の計算方法が変更されるとともに同先物取引における取引最終日から受渡決済期日までの期間が2日間短縮されることから、当社は、同先物取引の受渡決済における経過利子の課税・非課税扱い区分を廃止するとともに受渡決済に係る決済物件の申告時限を見直し、かつ、国債先物取引清算資格に係る清算基金所要額を構成する受渡決済清算基金基準額の算出方法を一部見直すべく、所要の制度改正を行う。

また、現状、DVP 清算値段及び代用有価証券の時価等について1円未満の数値を切り捨てる取扱いを改め、1円未満の数値をDVP 清算値段及び代用有価証券の時価等に採用すべく、所要の制度改正を行う。

2. 改正概要

| | (備 考) |
|--|--|
| (1) 受渡決済における課税・非課税区分の廃止 | |
| ・ 国債証券先物取引の受渡決済に係る経過利子の取扱いに際して、課税扱いと非課税扱いの区分を廃止する。 | ・ 業務方法書第73条の10、第73条の11、業務方法書の取扱い第20条の6 |
| (2) 決済物件の申告時限の変更 | |
| ・ 決済物件の申告時限を取引最終日の終了する日から起算して2日目の日の午後5時とする。 | ・ 業務方法書の取扱い第20条の7 |
| (3) 受渡決済清算基金基準額の算出方法の変更 | |
| ・ 国債先物取引清算資格に係る清算基金所要額を構成する受渡決済清算基金基準額の算出の際に用いている清算値段価格変動率について、参照する価格変動期間を「6取引日」から「4取引日」に変更する。 | ・ 清算基金所要額に関する規則別表1第2項 |
| (4) 証券決済未了の場合の決済繰り延べ日の取扱いの変更 | |
| ・ 新日銀ネットにおいて利払日前の振替停止期間が廃止されることに伴い、証券決済未了の場合の決済繰り延べ可能日を約定決済日から起算して5日目までの日に統一し、併せて利子の補償に係る取扱いを改正する。 | ・ 業務方法書第73条、国債証券に関する証券決済未了の場合の取扱いに関する規則第4条 |

(5) DVP 清算値段及び代用有価証券の時価等の採用方法の変更

- ・ 1円未満の数値を DVP 清算値段及び代用有価証券の時価等に採用する。

・先物・オプション取引に係る取引証拠金等に関する規則別表第2項、業務方法書の取扱い第11条、別表第1、証券決済未了の場合及びバイインの取扱いに関する規則第15条

(6) その他

- ・ その他所要の改正を行う。

・業務方法書第83条の2、業務方法書の取扱い第20条

3. 施行日

2015年10月13日から施行する。ただし、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社又は当社以外の機関が設置するシステムの稼働に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、2015年10月13日以後の当社が定める日から施行する。

以上

国債証券先物取引における受渡決済制度の変更等及び円位未満の呼値の単位が定められる
株券に係るDVP清算値段等の取扱いの変更に伴う関連諸規則の一部改正について

目 次

(ページ)

| | | |
|---|---|-----|
| 1 | 業務方法書の一部改正新旧対照表 | 2 |
| 2 | 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 | 5 |
| 3 | 業務方法書の取扱いの一部改正新旧対照表 | 7 |
| 4 | 清算基金所要額に関する規則の一部改正新旧対照表 | 1 2 |
| 5 | 証券決済未了の場合及びバイインの取扱いに関する規則の一部改正新旧対照 表 | 1 4 |
| 6 | 国債証券に関する証券決済未了の場合の取扱いに関する規則の一部改正新旧 対照表 | 1 6 |

業務方法書の一部改正新旧対照表

| 新 | 旧 |
|--|--|
| <p>(証券決済未了の場合の取扱い)</p> <p>第73条 (略)</p> <p>2 前項の場合においては、当該渡方現物清算参加者は、約定決済日から起算して5日目の日までの日(休業日を除く。)に決済を行わなければならない。この場合において、当該渡方現物清算参加者は、あらかじめ決済を行う日を当社に申告するものとし、当該日をもって証券決済未了の場合における決済日とする。</p> <p>3～5 (略)</p> | <p>(証券決済未了の場合の取扱い)</p> <p>第73条 (略)</p> <p>2 前項の場合においては、当該渡方現物清算参加者は、約定決済日から起算して5日目の日までの日(約定決済日から起算して5日目の日が当該国債証券の利払期日前3日間(銀行休業日を除外する。)のいずれかの日に当たる場合にあっては、当該利払期日の3日前(銀行休業日を除外する。)の日の前日までの日又は当該利払期日(休業日に当たる場合は、順次繰り下げる。)のいずれかの日)(休業日を除く。)に決済を行わなければならない。この場合において、当該渡方現物清算参加者は、あらかじめ決済を行う日を当社に申告するものとし、当該日をもって証券決済未了の場合における決済日とする。</p> <p>3～5 (略)</p> |
| <p>第73条の10 削除</p> | <p>(経過利子の取扱い)</p> <p>第73条の10 受渡決済(指定市場開設者が定めるLarge取引(指定市場開設者が定める国債証券先物取引に係るLarge取引をいう。以下この項において同じ。)に係る受渡決済をいう。以下同じ。)における経過利子(指定市場開設者がLarge取引について定める経過利子をいう。以下この節において同じ。)の課税扱いと非課税扱いの取扱いの区分は、国債先物等清算参加者からの申告に基づき当社が定めるものとする。この場合において、各国債先物等清算参加者からの申告を集計した結果、経過利子を非課税扱いとする最終総売建玉(取引最終日(指定市場開設者がLarge取引に関し定める取引最終日をいう。以下この項において同じ。)までの間に買戻しがされなかった売建玉(以下「最終売建玉」という。)をLarge取引の各限月取引について合計した数量をいう。)と最終総買建玉(取引最終日までの間に転売がされなかった買建玉(以下「最終買建玉」という。)をLarge</p> |

| | |
|---|---|
| | <p><u>r g e取引の各限月取引について合計した数量をいう。）が一致しない場合には、当社は、その一致しない数量について、当社が別に定めるところにより指定する国債先物等清算参加者の非課税扱いに係る最終売建玉又は最終買建玉の全部又は一部の経過利子の取扱いを課税扱いに変更する。</u></p> <p>2 <u>国債先物等清算参加者は、当社が定めるところにより、最終売建玉及び最終買建玉について、経過利子の取扱いの区分を当社に申告するものとする。</u></p> |
| <p>(受渡決済のために授受する国債証券及び金銭)</p> <p>第73条の11 <u>国債先物等清算参加者が受渡決済(指定市場開設者が定めるL a r g e取引(指定市場開設者が定める国債証券先物取引に係るL a r g e取引をいう。以下この条において同じ。))に係る受渡決済をいう。以下同じ。))のために授受する国債証券の数量及び金銭の額は、次の各号に定めるところによる。</u></p> <p>(1) <u>国債証券の数量は、最終売建玉(取引最終日(指定市場開設者がL a r g e取引に関し定める取引最終日をいう。以下この条において同じ。))までの間に買戻しがされなかった売建玉をいう。))と最終買建玉(取引最終日までの間に転売がされなかった買建玉をいう。))の差引数量</u></p> <p>(2) (略)</p> | <p>(受渡決済のために授受する国債証券及び金銭)</p> <p>第73条の11 <u>国債先物等清算参加者が受渡決済のために授受する国債証券の数量及び金銭の額は、次の各号に定めるところによる。</u></p> <p>(1) <u>国債証券の数量は、前条第1項の規定により当社が定めた経過利子の取扱いの区分ごとの最終売建玉と最終買建玉の差引数量</u></p> <p>(2) (略)</p> |
| <p>(国債証券先物取引の決済物件の変更等)</p> <p>第83条の2 <u>当社は、建玉の状況等から受渡決済が困難であると認める場合は、L a r g e取引(第73条の11に定めるL a r g e取引をいう。))における当社と清算参加者の間の決済物件の変更又は受渡決済期日の変更に関する措置を行うことができる。</u></p> | <p>(国債証券先物取引の決済物件の変更等)</p> <p>第83条の2 <u>当社は、建玉の状況等から受渡決済が困難であると認める場合は、L a r g e取引(第73条の10第1項に定めるL a r g e取引をいう。))における当社と清算参加者の間の決済物件の変更又は受渡決済期日の変更に関する措置を行うことができる。</u></p> |

付 則

- 1 この改正規定は、平成27年10月13日から施行する。
- 2 前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者との間の決済を行うために必要な当社又は当社以外の機関が設置するシステムの稼働に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、平成27年10月13日以後の当社が定める日から施行する。

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 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。 | | | | 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) 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 ずべき率 | 有価証券の種類 | | 時価 | 時価に乗 ずべき率 |
| (略) | | | | (略) | | | |
| 株券 | 国内の金融 商品取引所 に上場され ているもの | 金融商品 取引所 (注1) における 最終価格 (注2) | 100分 の70 | 株券 | 国内の金融 商品取引所 に上場され ているもの | 金融商品 取引所 (注1) における 最終価格 (株券に ついて は、円位 未満の端 数金額を 切り捨て る。)(注 2) | 100分 の70 |
| 優先出資証券 | | | | 優先出資証券 | | | |
| 外国株預託証 券 | | | | 外国株預託証 券 | | | |
| 外国投資信託 の受益証券 | | | | 外国投資信託 の受益証券 | | | |
| 外国投資証券 | | | | 外国投資証券 | | | |
| 受益証券発行 信託の受益証 券 | | | | 受益証券発行 信託の受益証 券 | | | |
| 外国受益証券 発行信託の受 益証券 | 外国受益証券 発行信託の受 益証券 | | | | | | |
| (略) | | | | (略) | | | |
| (注) 1. ~ 5. (略) | | | | (注) 1. ~ 5. (略) | | | |
| 3 (略) | | | | 3 (略) | | | |
| 付 則 | | | | | | | |
| 1 この改正規定は、平成27年10月13日から施行する。 | | | | | | | |
| 2 前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社又は当社以外の機関が設置するシステムの稼働に支障が生 | | | | | | | |

じた場合その他やむを得ない事由により、改正後の規定を適用することが適当でないとして当社が認める場合には、平成27年10月13日以後の当社が定める日から施行する。

業務方法書の取扱いの一部改正新旧対照表

| 新 | 旧 |
|---|---|
| <p>(DVP清算値段)</p> <p>第11条 業務方法書第49条に規定するDVP清算値段は、当該銘柄について前日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。以下同じ。)に約定値段(各指定市場開設者が定める気配値段を含む。以下この条、第18条及び第19条において同じ。)がある指定金融商品市場(取引所金融商品市場に限る。以下この条、第18条及び第19条において同じ。)から一定の順位により選択された指定金融商品市場における前日の最終値段(指定市場開設者が定めるところにより気配表示された最終気配値段を含む。以下この条、第18条及び第19条において同じ。)とする。</p> <p>2 前項の場合において、当該前日に指定金融商品市場のいずれにおいても約定値段がない場合は、指定金融商品市場から一定の順位により選択した指定金融商品市場における当該前日の基準値段をDVP清算値段とする。</p> <p>3・4 (略)</p> | <p>(DVP清算値段)</p> <p>第11条 業務方法書第49条に規定するDVP清算値段は、当該銘柄について前日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。以下同じ。)に約定値段(各指定市場開設者が定める気配値段を含む。以下この条、第18条及び第19条において同じ。)がある指定金融商品市場(取引所金融商品市場に限る。以下この条、第18条及び第19条において同じ。)から一定の順位により選択された指定金融商品市場における前日の最終値段(指定市場開設者が定めるところにより気配表示された最終気配値段を含む、<u>株券については、円位未満の端数を切り捨てる。</u>以下この条、第18条及び第19条において同じ。)とする。</p> <p>2 前項の場合において、当該前日に指定金融商品市場のいずれにおいても約定値段がない場合は、指定金融商品市場から一定の順位により選択した指定金融商品市場における当該前日の基準値段(<u>株券については、円位未満の端数を切り捨てる。</u>)をDVP清算値段とする。</p> <p>3・4 (略)</p> |
| <p>(国債証券及び金銭の授受方法)</p> <p>第20条 業務方法書第72条第1項に規定する決済及び同第73条の12第1項に規定する受渡決済に伴う国債証券の授受は、社債、株式等の振替に関する法律(平成13年法律第75号)に基づき日本銀行に開設された口座の振替により行うものとし、この場合における国債資金同時受渡依頼及び決済指示(国債)は、次の各号に定めるところによる。</p> <p>(1) 渡方清算参加者と当社との間の決済については、次のaからcまでに掲げる区分に従い、当該aからcまでに定めるところにより行う。</p> <p>a 渡方清算参加者の口座と当社の口座との間で</p> | <p>(国債証券及び金銭の授受方法)</p> <p>第20条 業務方法書第72条第1項に規定する決済及び同第73条の12第1項に規定する受渡決済に伴う国債証券の授受は、社債、株式等の振替に関する法律(平成13年法律第75号)に基づき日本銀行に開設された口座の振替(<u>非課税扱いの条件が付された売買の決済にあつては、非課税口座の振替</u>)により行うものとし、この場合における国債資金同時受渡依頼は、次の各号に定めるところによる。</p> <p>(1) 渡方清算参加者と当社との間の決済については、次のaからcまでに掲げる区分に従い、当該aからcまでに定めるところにより行う。</p> <p>a 渡方清算参加者の口座と当社の口座との間で</p> |

振替を行う場合

渡方清算参加者が、日本銀行に対して国債資金同時受渡依頼及び決済指示（国債）を行う。

- b 日本銀行が定める日本銀行国債振替決済業務規程第11条第1項の規定により日本銀行が指定する参加者（あらかじめ当社に届け出た者に限る。）の口座と当社の口座との間で振替を行う場合

当該日本銀行が指定する参加者が、日本銀行に対して国債資金同時受渡依頼及び決済指示（国債）を行う。この場合において、渡方清算参加者は、当該日本銀行が指定する参加者に対し必要な指示を行うものとする。

- c 代理人の口座と当社の口座との間で振替を行う場合（当社が定めるところによりあらかじめ当社の承認を得た場合に限る。）

当該代理人が、日本銀行に対して国債資金同時受渡依頼及び決済指示（国債）を行う。この場合において、当社の承認を得た渡方清算参加者は、当該代理人に対し必要な指示を行うものとする。

- (2) 当社と受方清算参加者との間の決済については、当社が日本銀行に対して国債資金同時受渡依頼及び決済指示（国債）を行う。

- 2 業務方法書第72条第1項規定する決済及び同第73条の12第1項に規定する受渡決済に伴う金銭の授受は、次の各号に定めるところにより行うものとする。

- (1) 金銭を支払う清算参加者は、日本銀行金融ネットワークシステムを利用した国債資金同時受渡に伴う金銭の受払いを行うために日本銀行に設けられた当該清算参加者の口座（当該口座がない場合には、日本銀行に設けられた日本銀行当座勘定取引先の口座のうちから、当該清算参加者が日本銀行金融ネットワークシステムを利用した国債資金同時受渡に伴う金銭の受払いを行うために選定した口座）のうちから、当該清算参加者が指定した口座（以

振替を行う場合

渡方清算参加者が、日本銀行に対して国債資金同時受渡依頼を行う。

- b 日本銀行が定める日本銀行国債振替決済業務規程第11条第1項の規定により日本銀行が指定する参加者（あらかじめ当社に届け出た者に限る。）の口座と当社の口座との間で振替を行う場合

当該日本銀行が指定する参加者が、日本銀行に対して国債資金同時受渡依頼を行う。この場合において、渡方清算参加者は、当該日本銀行が指定する参加者に対し必要な指示を行うものとする。

- c 代理人の口座と当社の口座との間で振替を行う場合（当社が定めるところによりあらかじめ当社の承認を得た場合に限る。）

当該代理人が、日本銀行に対して国債資金同時受渡依頼を行う。この場合において、当社の承認を得た渡方清算参加者は、当該代理人に対し必要な指示を行うものとする。

- (2) 当社と受方清算参加者との間の決済については、当社が日本銀行に対して国債資金同時受渡依頼を行う。

- 2 業務方法書第72条第1項規定する決済及び同第73条の12第1項に規定する受渡決済に伴う金銭の授受は、次の各号に定めるところにより行うものとする。

- (1) 金銭を支払う清算参加者は、日本銀行金融ネットワークシステムを利用した国債資金同時受渡に伴う金銭の受払いを行うために日本銀行に設けられた当該清算参加者の口座（当該口座がない場合には、日本銀行に設けられた日本銀行当座勘定取引先の口座のうちから、当該清算参加者が日本銀行金融ネットワークシステムを利用した国債資金同時受渡に伴う金銭の受払いを行うために選定した口座）のうちから、当該清算参加者が指定した口座（以

下「指定口座」という。)から、日本銀行に設けられた当社の口座に振り込むものとする。この場合における決済指示(資金)は、次のa又はbに定めるところにより行うものとする。

a 金銭を支払う清算参加者の口座から振り込む場合

金銭を支払う清算参加者が、日本銀行に対して決済指示(資金)を行う。

b 金銭を支払う清算参加者以外の日本銀行当座勘定取引先の口座から振り込む場合

当該日本銀行当座勘定取引先が、日本銀行に対して決済指示(資金)を行う。この場合において、金銭を支払う清算参加者は、当該日本銀行当座勘定取引先に対し必要な指示を行うものとする。

(2) 金銭を受領する清算参加者は、指定口座において受領するものとし、この場合における決済指示(資金)は当社が行う。

3 (略)

第20条の6 削除

下「指定口座」という。)から、日本銀行に設けられた当社の口座に振り込むものとする。この場合における資金受渡依頼は、次のa又はbに定めるところにより行うものとする。

a 金銭を支払う清算参加者の口座から振り込む場合

金銭を支払う清算参加者が、日本銀行に対して資金受渡依頼を行う。

b 金銭を支払う清算参加者以外の日本銀行当座勘定取引先の口座から振り込む場合

当該日本銀行当座勘定取引先が、日本銀行に対して資金受渡依頼を行う。この場合において、金銭を支払う清算参加者は、当該日本銀行当座勘定取引先に対し必要な指示を行うものとする。

(2) 金銭を受領する清算参加者は、指定口座において受領するものとし、この場合における資金受渡依頼は当社が行う。

3 (略)

(経過利子の取扱いの区分等)

第20条の6 業務方法書第73条の10第1項に規定する経過利子の取扱いの区分は、次項に規定する各国債先物等清算参加者からの申告に基づき、経過利子を非課税扱いとする最終総売建玉と最終総買建玉のいずれか大きな数量について、各国債先物等清算参加者又は各国債先物等非清算参加者の自己分の数量及び顧客ごとの委託分の数量を最小単位に細分化して、変更を行うものとする。

2 国債先物等清算参加者は、業務方法書第73条の10第2項の規定に基づき、当該国債先物等清算参加者の最終売建玉及び最終買建玉について、次に掲げる事項を取引最終日の終了する日の翌日の午後3時まで当社に申告するものとする。ただし、当社が、必要があると認めるときは、当該申告時限を臨時に変更することができる。

(1) 経過利子を課税扱いとする数量

| | | |
|--|----|-------|
| <p>(国債証券先物取引の受渡決済に係る決済物件の申告時限)</p> <p>第20条の7 業務方法書第73条の14に規定する当社が定める時限は、取引最終日の終了する日から起算して<u>2日目の日の午後5時</u>とする。ただし、当社が必要と認める場合には、当社がその都度定める時限とする。</p> <p style="text-align: center;">付 則</p> <p>1 この改正規定は、平成27年10月13日から施行する。</p> <p>2 前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社又は当社以外の機関が設置するシステムの稼働に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、平成27年10月13日以後の当社が定める日から施行する。</p> <p>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</p> <p>1 業務方法書第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。</p> | | |
| 有価証券の種類 | 時価 | 時価に乘ず |

| | | |
|--|----|-------|
| <p>(2) <u>経過利子を非課税扱いとする数量については、国債先物等清算参加者の自己分の数量、国債先物等清算参加者の顧客ごとに区分した委託分の数量、国債先物等非清算参加者ごとに区分した国債先物等非清算参加者の自己分の数量、各国債先物等非清算参加者の顧客ごとに区分した国債先物等非清算参加者の委託分の数量</u></p> <p>(国債証券先物取引の受渡決済に係る決済物件の申告時限)</p> <p>第20条の7 業務方法書第73条の14に規定する当社が定める時限は、取引最終日の終了する日から起算して<u>4日目の日の午後3時</u>とする。ただし、当社が必要と認める場合には、当社がその都度定める時限とする。</p> <p>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</p> <p>1 業務方法書第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。</p> | | |
| 有価証券の種類 | 時価 | 時価に乘ず |

| | | べき率 | |
|-----------------|----------------------|-------------------------|---------|
| (略) | (略) | (略) | (略) |
| 株券 | | | |
| 優先出資証券 | | | |
| 外国株預託証券 | | | |
| 外国投資信託の受益証券 | 国内の金融商品取引所に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) | 100分の70 |
| 外国投資証券 | | | |
| 受益証券発行信託の受益証券 | | | |
| 外国受益証券発行信託の受益証券 | | | |
| (略) | | | |

(注) 1. ~ 5. (略)
2~8 (略)

| | | べき率 | |
|-----------------|----------------------|---|---------|
| (略) | (略) | (略) | (略) |
| 株券 | | | |
| 優先出資証券 | | | |
| 外国株預託証券 | | | |
| 外国投資信託の受益証券 | 国内の金融商品取引所に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(株券については、円位未満の端数金額を切り捨てる。)(注2) | 100分の70 |
| 外国投資証券 | | | |
| 受益証券発行信託の受益証券 | | | |
| 外国受益証券発行信託の受益証券 | | | |
| (略) | | | |

(注) 1. ~ 5. (略)
2~8 (略)

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 1 清算基金所要額の算出に関する表</p> <p>1. (略)</p> <p>2. 国債先物等清算資格に係る清算基金所要額(以下「国債先物等清算基金所要額」という。)</p> <p>国債先物等清算基金所要額は、次に定める計算式により算出される額とする。ただし、当該額が1,000万円を下回る場合は、1,000万円とする。なお、計算式における用語の意義は、次のaからdまでに定めるとおりとする。</p> <p>国債先物等清算基金所要額 = 期間最大基準PML額_{JGB} × 個社按分基礎IM額_{JGB} / 按分基礎IM総額_{JGB} + 総受渡決済清算基金基準額</p> <p>a～c (略)</p> <p>d 総受渡決済清算基金基準額とは、Large取引の各限月取引の取引最終日から受渡決済期日の前日までに於いて、銘柄ごとに次に定める計算式により算出される受渡決済清算基金基準額の合計額をいう。なお、計算式における用語の意義は、次の(a)及び(b)に定めるとおりとする。</p> <p>受渡決済清算基金基準額 = 当該銘柄の受渡決済建玉数量 × 1億円 × 当該銘柄の価格変動率</p> <p>(a) (略)</p> <p>(b) 当該銘柄の価格変動率とは、Large取引の当該銘柄の清算値段価格変動率の価格変動率算定期間における99%カバー最小値をいう。</p> <p>(注1) 当該銘柄の清算値段価格変動率とは、次に定める計算式により算出される数値</p> | <p>別表 1 清算基金所要額の算出に関する表</p> <p>1. (略)</p> <p>2. 国債先物等清算資格に係る清算基金所要額(以下「国債先物等清算基金所要額」という。)</p> <p>国債先物等清算基金所要額は、次に定める計算式により算出される額とする。ただし、当該額が1,000万円を下回る場合は、1,000万円とする。なお、計算式における用語の意義は、次のaからdまでに定めるとおりとする。</p> <p>国債先物等清算基金所要額 = 期間最大基準PML額_{JGB} × 個社按分基礎IM額_{JGB} / 按分基礎IM総額_{JGB} + 総受渡決済清算基金基準額</p> <p>a～c (略)</p> <p>d 総受渡決済清算基金基準額とは、Large取引の各限月取引の取引最終日から受渡決済期日の前日までに於いて、銘柄ごとに次に定める計算式により算出される受渡決済清算基金基準額の合計額をいう。なお、計算式における用語の意義は、次の(a)及び(b)に定めるとおりとする。</p> <p>受渡決済清算基金基準額 = 当該銘柄の受渡決済建玉数量 × 1億円 × 当該銘柄の価格変動率</p> <p>(a) (略)</p> <p>(b) 当該銘柄の価格変動率とは、Large取引の当該銘柄の清算値段価格変動率の価格変動率算定期間における99%カバー最小値をいう。</p> <p>(注1) 当該銘柄の清算値段価格変動率とは、次に定める計算式により算出される数値</p> |

をいう。ただし、計算式における当該銘柄の清算値段について適当でないと認められる場合には、当社が定める値段とする。

当該銘柄の清算値段価格変動率

$$= \frac{\text{一の取引日の当該銘柄の清算値段} - \text{4取引日前の当該銘柄の清算値段}}{\text{4取引日前の当該銘柄の清算値段}}$$

をいう。ただし、計算式における当該銘柄の清算値段について適当でないと認められる場合には、当社が定める値段とする。

当該銘柄の清算値段価格変動率

$$= \frac{\text{一の取引日の当該銘柄の清算値段} - \text{6取引日前の当該銘柄の清算値段}}{\text{6取引日前の当該銘柄の清算値段}}$$

付 則

- 1 この改正規定は、平成27年10月13日から施行する。
- 2 前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社又は当社以外の機関が設置するシステムの稼働に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、平成27年10月13日以後の当社が定める日から施行する。

証券決済未了の場合及びバイインの取扱いに関する規則の一部改正新旧対照表

| 新 | 旧 |
|---|---|
| <p>(バイインによる売買の売付申込み)</p> <p>第15条 バイインの買付けに対する売付けの申込みは、現物清算参加者が、次の各号に定めるところにより行うものとする。</p> <p>(1)～(3) (略)</p> <p>(4) 売付申込値段の単位</p> <p>売付申込値段の単位は、当該銘柄の指定金融商品市場における呼値の単位に準じて当社が定めた単位とする。</p> <p>(5) 売付申込値段の制限</p> <p>売付申込値段は、バイインによる売買を行う日の一定の順位により選択された指定金融商品市場(取引所金融商品市場に限る。)における最終値段(指定市場開設者の定める気配表示が行われているときは、当該最終気配値段を含み、当該バイインを行う日に最終値段(当該最終気配値段を含む。)がないとき又は業務方法書第64条第3項各号(第4号を除く。)に掲げる日の2日前若しくは前日においては当社がその都度定める値段とする。)と当該値段からその10%相当額を加えた値段の範囲内の値段とする。ただし、当社は、必要があると認めるときは、当該売付申込値段の範囲を臨時に変更することができる。</p> | <p>(バイインによる売買の売付申込み)</p> <p>第15条 バイインの買付けに対する売付けの申込みは、現物清算参加者が、次の各号に定めるところにより行うものとする。</p> <p>(1)～(3) (略)</p> <p>(4) 売付申込値段の単位</p> <p>売付申込値段の単位は、当該銘柄の指定金融商品市場における呼値の単位(株券については、<u>円位未満の値段となる場合には、1円</u>)に準じて当社が定めた単位とする。</p> <p>(5) 売付申込値段の制限</p> <p>売付申込値段は、バイインによる売買を行う日の一定の順位により選択された指定金融商品市場(取引所金融商品市場に限る。)における最終値段(指定市場開設者の定める気配表示が行われているときは、当該最終気配値段を含み、<u>株券については、円位未満の端数を切り捨て</u>、当該バイインを行う日に最終値段(当該最終気配値段を含む。)がないとき又は業務方法書第64条第3項各号(第4号を除く。)に掲げる日の2日前若しくは前日においては当社がその都度定める値段とする。)と当該値段からその10%相当額を加えた値段の範囲内の値段とする。ただし、当社は、必要があると認めるときは、当該売付申込値段の範囲を臨時に変更することができる。</p> |
| 付 則 | |
| <p>1 この改正規定は、平成27年10月13日から施行する。</p> <p>2 前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社又は当社以外の機関が設置するシステムの稼働に支障が生</p> | |

じた場合その他やむを得ない事由により、改正後の規定を適用することが適当でないとして当社が認める場合には、平成27年10月13日以後の当社が定める日から施行する。

国債証券に関する証券決済未了の場合の取扱いに関する規則の一部改正新旧対照表

| 新 | 旧 |
|---|--|
| <p>(利子の補償)</p> <p>第4条 業務方法書第73条第2項の規定による決済を約定決済日以後最初に到来する利払期日(休業日に当たる場合は、順次繰り下げる。)以降の日に行う場合は、約定決済日に決済が行われていたとした場合に同条第3項の規定により当社が指定した決済に係る受方現物清算参加者が受領すべき利子に相当する額を決済のために授受する金銭の額から差し引くものとする。</p> <p>(削る)</p> <p style="text-align: center;">付 則</p> <p>1 この改正規定は、平成27年10月13日から施行する。</p> <p>2 前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社又は当社以外の機関が設置するシステムの稼働に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、平成27年10月13日以後の当社が定める日から施行する。</p> | <p>(利子の補償)</p> <p>第4条 業務方法書第73条第2項の規定により、決済を利払期日(休業日に当たる場合は、順次繰り下げる。)に行う場合は、約定決済日に決済が行われていたとした場合に同条第3項の規定により当社が指定した決済に係る受方現物清算参加者が受領すべき利子に相当する額を決済のために授受する金銭の額から差し引くものとする。</p> <p>2 <u>前項に規定する受領すべき利子に相当する額は、税額相当額を差し引いた額とする。ただし、非課税扱いの条件が付された売買の決済は、この限りではない。</u></p> |