

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

2016年7月4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	(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	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	(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
	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

政府保証 債券	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 <u>100分の96</u> (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
	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)	売買参考統計値 が発表されて いないもの 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)			
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 <u>100分の96</u> (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 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)

3 (略)

付 則(平成28年7月4日)

この改正規定は、平成28年7月4日から施行する。

政府保証 債券	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 <u>100分の95</u> (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
	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)	売買参考統計値 が発表されて いないもの 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)			
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 <u>100分の95</u> (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 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)

3 (略)

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
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) 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。)	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) 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			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			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			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			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			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			f 残存期間30年超のも の 100分の93
国債証券		(2) 変動利付国債	国債証券		(2) 変動利付国債
		a 残存期間1年以内のも の 100分の99			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			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			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			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	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			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			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			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			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			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			f 残存期間30年超のも の 100分の91

政府保証債券	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
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)	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) 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
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)	(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
(略)			

(注) 1.～5. (略)

2～8 (略)

付 則(平成28年7月4日)

この改正規定は、平成28年7月4日から施行する。

政府保証債券	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
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)	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) 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)	(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
(略)			

(注) 1.～5. (略)

2～8 (略)