

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1
- ・ 業務方法書の取扱い 別表第1

III. 施行日

2018年7月9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 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 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 (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 (物価連動国債には国債店頭取引清算業務において清算対象とするものに限る。)	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、物価連動国債、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92 (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99 d 残存期間10年超20年以内のもの 100分の99 (3) 物価連動国債 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95 c 残存期間5年超10年以内のもの <u>100分の94</u> d 残存期間10年超20年以内のもの <u>100分の94</u> e 残存期間20年超30年以内のもの <u>100分の94</u> f 残存期間30年超のもの <u>100分の94</u> (4) 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99 b 残存期間1年超5年以内のもの 100分の97 c 残存期間5年超10年以内	国債証券 (物価連動国債には国債店頭取引清算業務において清算対象とするものに限る。)	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、物価連動国債、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92 (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99 d 残存期間10年超20年以内のもの 100分の99 (3) 物価連動国債 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95 c 残存期間5年超10年以内のもの <u>100分の93</u> d 残存期間10年超20年以内のもの <u>100分の93</u> e 残存期間20年超30年以内のもの <u>100分の93</u> f 残存期間30年超のもの <u>100分の93</u> (4) 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99 b 残存期間1年超5年以内のもの 100分の97 c 残存期間5年超10年以内
	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

			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 f 残存期間30年超のもの 100分の90				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 f 残存期間30年超のもの 100分の90		
外国国債証券		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96 (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の94 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の92 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の90 (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88			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95 (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の94 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の92 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の90 (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88
		(略)				(略)			
		ドイツ連邦共和国政府の発行するユーロ建債券	フランクフルト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95 (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の93 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の92 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の90 (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85			ドイツ連邦共和国政府の発行するユーロ建債券	フランクフルト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95 (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の93 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の92 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の89 (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85
	(略)				(略)				
(略)				(略)					

(注) 1. ～6. (略)

3 (略)

付 則(平成30年7月9日)

この改正規定は、平成30年7月9日から施行する。

(注) 1. ～6. (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4項及び第5項、第16条第5項及び第6項、第52条第3項及び第4項並びに第70条第3項及び第4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4項及び第5項、第16条第5項及び第6項、第52条第3項及び第4項並びに第70条第3項及び第4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	時価に乘すべき率	有価証券の種類	時価	時価に乘すべき率
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 (物価連 動国債に あって は、当該 平均値に 財務省が 公表する 連動係数 を乗じた 値)	(1) 国債証券(変動利付国 債、物価連動国債、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 (物価連 動国債に あって は、当該 平均値に 財務省が 公表する 連動係数 を乗じた 値)	(1) 国債証券(変動利付国 債、物価連動国債、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
国債証券 (物価連 動国債に あっては 国債店頭 取引清算 業務にお いて清算 対象取引 とするも のに限 る。)	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	b 残存期間1年超5年以内 のもの 100分の97	国債証券 (物価連 動国債に あっては 国債店頭 取引清算 業務にお いて清算 対象取引 とするも のに限 る。)	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	b 残存期間1年超5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			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92			f 残存期間30年超のもの 100分の92
		(2) 変動利付国債			(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99			c 残存期間5年超10年以 内のもの 100分の99
		d 残存期間10年超20年 以内のもの 100分の99			d 残存期間10年超20年 以内のもの 100分の99
		(3) 物価連動国債			(3) 物価連動国債
		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95	b 残存期間1年超5年以内 のもの 100分の95				
c 残存期間5年超10年以 内のもの 100分の94	c 残存期間5年超10年以 内のもの 100分の94				
d 残存期間10年超20年 以内のもの 100分の94	d 残存期間10年超20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	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94	f 残存期間30年超のもの 100分の94				
(4) 分離元本振替国債及び 分離利息振替国債	(4) 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	b 残存期間1年超5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90
外国国債証券	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 <u>100分の96</u> (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の94 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の92 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の90 (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88
	(略)		
	ドイツ連邦共和国政府の発行するユーロ建債券	フランクフルト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95 (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の93 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の92 (4) 残存期間10年超20年以内のもの <u>100分の90</u> (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85
(略)			
(略)			

(注) 1.～4. (略)

2～7 (略)

付 則(平成30年7月9日)

この改正規定は、平成30年7月9日から施行する。

			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90
外国国債証券	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 <u>100分の95</u> (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の94 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の92 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の90 (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88
	(略)		
	ドイツ連邦共和国政府の発行するユーロ建債券	フランクフルト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95 (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の93 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の92 (4) 残存期間10年超20年以内のもの <u>100分の89</u> (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85
(略)			
(略)			

(注) 1.～4. (略)

2～7 (略)