

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

2019年7月8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
(略)							
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 95 (3) 残存期間 5 年超 10 年以内のもの 100 分の 94 (4) 残存期間 10 年超 20 年以内のもの 100 分の 92 (5) 残存期間 20 年超 30 年以内のもの 100 分の 90 (6) 残存期間 30 年超のもの 100 分の 90	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 95 (3) 残存期間 5 年超 10 年以内のもの 100 分の 93 (4) 残存期間 10 年超 20 年以内のもの 100 分の 91 (5) 残存期間 20 年超 30 年以内のもの 100 分の 89 (6) 残存期間 30 年超のもの 100 分の 89	
	グレートブリテンおよび北アイルランド連合王国政府が発行する英ポンド建債券	ロンドン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 91 (5) 残存期間 20 年超 30 年以内のもの 100 分の 90 (6) 残存期間 30 年超のもの 100 分の 88	グレートブリテンおよび北アイルランド連合王国政府が発行する英ポンド建債券	ロンドン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 87	
	ドイツ連邦共和国政府が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 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 93 (4) 残存期間 10 年超 20 年以内のもの 100 分の 91 (5) 残存期間 20 年超 30 年以内のもの 100 分の 89 (6) 残存期間 30 年超のもの 100 分の 89	ドイツ連邦共和国政府が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 94 (3) 残存期間 5 年超 10 年以内のもの 100 分の 93 (4) 残存期間 10 年超 20 年以内のもの 100 分の 91 (5) 残存期間 20 年超 30 年以内のもの 100 分の 89 (6) 残存期間 30 年超のもの 100 分の 89	
	フランス共和国政府が発行するユーロ建債券	パリ市場における前日の最	(1) 残存期間 1 年以内のもの	フランス共和国政府が発行するユーロ建債券	パリ市場における前日の最	(1) 残存期間 1 年以内のもの	

		終の気配相場	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89 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の85 (6) 残存期間30年超のもの 100分の85			終の気配相場	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89 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の85 (6) 残存期間30年超のもの 100分の86
(略)				(略)			
円貨建外国債券	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99 (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97 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の97 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の97 (6) 残存期間30年超のもの 100分の97	円貨建外国債券	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99 (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97 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の97 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の95 (6) 残存期間30年超のもの 100分の95
	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	金融商品取引所における最終価格	(1) 残存期間1年以内のもの 100分の99 (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97 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の97 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の95 (6) 残存期間30年超のもの 100分の95		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 金融商品取引所における最終価格		
(略)				(略)			
(注) 1.～6. (略)				(注) 1.～6. (略)			
3 (略)				3 (略)			
付 則				付 則			
この改正規定は、令和元年7月8日から施行する。				この改正規定は、令和元年7月8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	時価に乗すべき率	有価証券の種類		時価	時価に乗すべき率
(略)				(略)			
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95 (3) 残存期間5年超10年以内のもの <u>100分の94</u> (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の92 (5) 残存期間20年超30年以内のもの <u>100分の90</u> (6) 残存期間30年超のもの <u>100分の90</u>	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95 (3) 残存期間5年超10年以内のもの <u>100分の93</u> (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の91 (5) 残存期間20年超30年以内のもの <u>100分の89</u> (6) 残存期間30年超のもの <u>100分の89</u>
	グレートブリテンおよび北アイルランド連合王国政府が発行する英ポンド建債券	ロンドン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 <u>100分の94</u> (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91</u> (5) 残存期間20年超30年以内のもの <u>100分の90</u> (6) 残存期間30年超のもの <u>100分の88</u>		グレートブリテンおよび北アイルランド連合王国政府が発行する英ポンド建債券	ロンドン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 <u>100分の93</u> (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 <u>100分の88</u> (6) 残存期間30年超のもの <u>100分の87</u>
	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93 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の91 (5) 残存期間20年超30年以内のもの		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94 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の93 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の91 (5) 残存期間20年超30年以内のもの

			内のもの 100分の89 (6) 残存期間30年超のもの 100分の89				内のもの 100分の89 (6) 残存期間30年超のもの 100分の89
	フランス共和国政府の発行するユーロ建債券	パリ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89 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の85 (6) 残存期間30年超のもの 100分の85		フランス共和国政府の発行するユーロ建債券	パリ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89 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の85 (6) 残存期間30年超のもの 100分の86
(略)				(略)			
	日本証券業協会が発行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99 (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97 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の97 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の97 (6) 残存期間30年超のもの 100分の97		日本証券業協会が発行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99 (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97 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の97 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の95 (6) 残存期間30年超のもの 100分の95
円貨建外国債券	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	金融商品取引所における最終価格		円貨建外国債券	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	金融商品取引所における最終価格	
(略)				(略)			
(注) 1.～4. (略)				(注) 1.～4. (略)			
2～7 (略)				2～7 (略)			
付 則 この改正規定は、令和元年7月8日から施行する。							