

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

2020年1月14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																																																								
<p>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</p> <p>1 (略)</p> <p>2 前項の有価証券の種類、時価及び当社が定める率は以下のとおりとする。</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>有価証券の種類</th> <th>時価</th> <th>時価に乗すべき率</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td colspan="3" style="text-align: center;">(略)</td> </tr> <tr> <td rowspan="6">アメリカ合衆国財務省証券</td> <td rowspan="6">ニューヨーク市場における前日の最終の気配相場</td> <td>(1) 残存期間 1 年以内のもの <u>100 分の 97</u></td> </tr> <tr> <td>(2) 残存期間 1 年超 5 年以内のもの 100 分の 95</td> </tr> <tr> <td>(3) 残存期間 5 年超 10 年以内のもの 100 分の 94</td> </tr> <tr> <td>(4) 残存期間 10 年超 20 年以内のもの 100 分の 92</td> </tr> <tr> <td>(5) 残存期間 20 年超 30 年以内のもの 100 分の 90</td> </tr> <tr> <td>(6) 残存期間 30 年超のもの 100 分の 90</td> </tr> <tr> <td colspan="3" style="text-align: center;">(略)</td> </tr> <tr> <td rowspan="6">外国国債証券</td> <td rowspan="6">ドイツ連邦共和国政府の発行するユーロ建債券</td> <td>(1) 残存期間 1 年以内のもの 100 分の 96</td> </tr> <tr> <td>(2) 残存期間 1 年超 5 年以内のもの 100 分の 94</td> </tr> <tr> <td>(3) 残存期間 5 年超 10 年以内のもの 100 分の 93</td> </tr> <tr> <td>(4) 残存期間 10 年超 20 年以内のもの 100 分の 91</td> </tr> <tr> <td>(5) 残存期間 20 年超 30 年以内のもの 100 分の 89</td> </tr> <tr> <td>(6) 残存期間 30 年超のもの <u>100 分の 85</u></td> </tr> <tr> <td colspan="3" style="text-align: center;">(略)</td> </tr> </tbody> </table> <p>(注) 1.～6. (略)</p> <p>3 (略)</p> <p style="text-align: center;">付 則</p> <p>この改正規定は、令和 2 年 1 月 1 4 日から施行する。</p>	有価証券の種類	時価	時価に乗すべき率	(略)			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 97</u>	(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	(略)			外国国債証券	ドイツ連邦共和国政府の発行するユーロ建債券	(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 <u>100 分の 85</u>	(略)			<p>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</p> <p>1 (略)</p> <p>2 前項の有価証券の種類、時価及び当社が定める率は以下のとおりとする。</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>有価証券の種類</th> <th>時価</th> <th>時価に乗すべき率</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td colspan="3" style="text-align: center;">(略)</td> </tr> <tr> <td rowspan="6">アメリカ合衆国財務省証券</td> <td rowspan="6">ニューヨーク市場における前日の最終の気配相場</td> <td>(1) 残存期間 1 年以内のもの <u>100 分の 96</u></td> </tr> <tr> <td>(2) 残存期間 1 年超 5 年以内のもの 100 分の 95</td> </tr> <tr> <td>(3) 残存期間 5 年超 10 年以内のもの 100 分の 94</td> </tr> <tr> <td>(4) 残存期間 10 年超 20 年以内のもの 100 分の 92</td> </tr> <tr> <td>(5) 残存期間 20 年超 30 年以内のもの 100 分の 90</td> </tr> <tr> <td>(6) 残存期間 30 年超のもの 100 分の 90</td> </tr> <tr> <td colspan="3" style="text-align: center;">(略)</td> </tr> <tr> <td rowspan="6">外国国債証券</td> <td rowspan="6">ドイツ連邦共和国政府の発行するユーロ建債券</td> <td>(1) 残存期間 1 年以内のもの 100 分の 96</td> </tr> <tr> <td>(2) 残存期間 1 年超 5 年以内のもの 100 分の 94</td> </tr> <tr> <td>(3) 残存期間 5 年超 10 年以内のもの 100 分の 93</td> </tr> <tr> <td>(4) 残存期間 10 年超 20 年以内のもの 100 分の 91</td> </tr> <tr> <td>(5) 残存期間 20 年超 30 年以内のもの 100 分の 89</td> </tr> <tr> <td>(6) 残存期間 30 年超のもの <u>100 分の 89</u></td> </tr> <tr> <td colspan="3" style="text-align: center;">(略)</td> </tr> </tbody> </table> <p>(注) 1.～6. (略)</p> <p>3 (略)</p>	有価証券の種類	時価	時価に乗すべき率	(略)			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 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	(略)			外国国債証券	ドイツ連邦共和国政府の発行するユーロ建債券	(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 <u>100 分の 89</u>	(略)		
有価証券の種類	時価	時価に乗すべき率																																																							
(略)																																																									
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 97</u>																																																							
		(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																																																							
(略)																																																									
外国国債証券	ドイツ連邦共和国政府の発行するユーロ建債券	(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 <u>100 分の 85</u>																																																							
(略)																																																									
有価証券の種類	時価	時価に乗すべき率																																																							
(略)																																																									
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 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																																																							
(略)																																																									
外国国債証券	ドイツ連邦共和国政府の発行するユーロ建債券	(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 <u>100 分の 89</u>																																																							
(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97 (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	
	(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
(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2年1月14日から施行する。