

代用有価証券等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等について、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

○ 時価に乗すべき率等の見直し

- ・ 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等について、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 第6条の4第2項及び別表第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の取扱い 第2条の2第2項

III. 施行日

2020年7月13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
3. 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。)	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 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91 (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	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。)	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 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91 (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
	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) 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97 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98 e 残存期間20年超30年以内のもの 100分の98 f 残存期間30年超のもの 100分の98 (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年以内のもの 100分の97		金融商品取引所(注1)における最終価格(注2) (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97 f 残存期間30年超のもの 100分の97 (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年以内のもの 100分の97	

			d 残存期間 10 年超 20 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 96 e 残存期間 20 年超 30 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 94 f 残存期間 30 年超のもの $\frac{100}{100}$ 分の 90				d 残存期間 10 年超 20 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 96 e 残存期間 20 年超 30 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 94 f 残存期間 30 年超のもの $\frac{100}{100}$ 分の 90
(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 $\frac{100}{100}$ 分の 95 (2) 残存期間 1 年超 5 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 93 (3) 残存期間 5 年超 10 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 92 (4) 残存期間 10 年超 20 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 90 (5) 残存期間 20 年超 30 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 88 (6) 残存期間 30 年超のもの $\frac{100}{100}$ 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 $\frac{100}{100}$ 分の 97 (2) 残存期間 1 年超 5 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 95 (3) 残存期間 5 年超 10 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 94 (4) 残存期間 10 年超 20 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 92 (5) 残存期間 20 年超 30 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 90 (6) 残存期間 30 年超のもの $\frac{100}{100}$ 分の 90	
	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 $\frac{100}{100}$ 分の 91 (2) 残存期間 1 年超 5 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 89 (3) 残存期間 5 年超 10 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 88 (4) 残存期間 10 年超 20 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 87 (5) 残存期間 20 年超 30 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 85 (6) 残存期間 30 年超のもの $\frac{100}{100}$ 分の 84	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 $\frac{100}{100}$ 分の 95 (2) 残存期間 1 年超 5 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 94 (3) 残存期間 5 年超 10 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 93 (4) 残存期間 10 年超 20 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 91 (5) 残存期間 20 年超 30 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 90 (6) 残存期間 30 年超のもの $\frac{100}{100}$ 分の 89	
	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 $\frac{100}{100}$ 分の 93 (2) 残存期間 1 年超 5 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 91 (3) 残存期間 5 年超 10 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 90 (4) 残存期間 10 年超 20 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 88 (5) 残存期間 20 年超 30 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 85 (6) 残存期間 30 年超のもの $\frac{100}{100}$ 分の 82	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 $\frac{100}{100}$ 分の 96 (2) 残存期間 1 年超 5 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 94 (3) 残存期間 5 年超 10 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 93 (4) 残存期間 10 年超 20 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 91 (5) 残存期間 20 年超 30 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 89 (6) 残存期間 30 年超のもの $\frac{100}{100}$ 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 $\frac{100}{100}$ 分の 93 (2) 残存期間 1 年超 5 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 91 (3) 残存期間 5 年超 10 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 89 (4) 残存期間 10 年超 20 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 86 (5) 残存期間 20 年超 30 年以内のもの	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 $\frac{100}{100}$ 分の 96 (2) 残存期間 1 年超 5 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 94 (3) 残存期間 5 年超 10 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 92 (4) 残存期間 10 年超 20 年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の 89 (5) 残存期間 20 年超 30 年以内のもの	

			$\frac{100}{100}$ 分の82 (6) 残存期間30年超のもの $\frac{100}{100}$ 分の81				$\frac{100}{100}$ 分の85 (6) 残存期間30年超のもの $\frac{100}{100}$ 分の85
(略)				(略)			
(注) 1.～6. (略)				(注) 1.～6. (略)			
3 (略)				3 (略)			
付 則							
この改正規定は、令和2年7月13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		
(当社が指定する通貨) 第6条の4 (略) 2 業務方法書第15条の2第3項、第16条第4項、第52条第2項及び第70条第2項に規定する当社が定める率は、アメリカ合衆国通貨の場合は、 <u>100分の95</u> とする。			(当社が指定する通貨) 第6条の4 (略) 2 業務方法書第15条の2第3項、第16条第4項、第52条第2項及び第70条第2項に規定する当社が定める率は、アメリカ合衆国通貨の場合は、 <u>100分の97</u> とする。		
別表第1			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			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
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。)	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)	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。)	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)
	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) 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91 (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97 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			(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91 (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

			<p>のもの</p> <p><u>100分の98</u></p> <p>e 残存期間 20年超 30年以内のもの</p> <p><u>100分の98</u></p> <p>f 残存期間 30年超のもの</p> <p><u>100分の98</u></p> <p>(4) 分離元本振替国債及び分離利息振替国債</p> <p>a 残存期間 1年以内のもの</p> <p><u>100分の99</u></p> <p>b 残存期間 1年超 5年以内のもの</p> <p><u>100分の97</u></p> <p>c 残存期間 5年超 10年以内のもの</p> <p><u>100分の97</u></p> <p>d 残存期間 10年超 20年以内のもの</p> <p><u>100分の96</u></p> <p>e 残存期間 20年超 30年以内のもの</p> <p><u>100分の94</u></p> <p>f 残存期間 30年超のもの</p> <p><u>100分の90</u></p>			<p>のもの</p> <p><u>100分の97</u></p> <p>e 残存期間 20年超 30年以内のもの</p> <p><u>100分の97</u></p> <p>f 残存期間 30年超のもの</p> <p><u>100分の97</u></p> <p>(4) 分離元本振替国債及び分離利息振替国債</p> <p>a 残存期間 1年以内のもの</p> <p><u>100分の99</u></p> <p>b 残存期間 1年超 5年以内のもの</p> <p><u>100分の97</u></p> <p>c 残存期間 5年超 10年以内のもの</p> <p><u>100分の97</u></p> <p>d 残存期間 10年超 20年以内のもの</p> <p><u>100分の96</u></p> <p>e 残存期間 20年超 30年以内のもの</p> <p><u>100分の94</u></p> <p>f 残存期間 30年超のもの</p> <p><u>100分の90</u></p>
(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	<p>(1) 残存期間 1年以内のもの</p> <p><u>100分の95</u></p> <p>(2) 残存期間 1年超 5年以内のもの</p> <p><u>100分の93</u></p> <p>(3) 残存期間 5年超 10年以内のもの</p> <p><u>100分の92</u></p> <p>(4) 残存期間 10年超 20年以内のもの</p> <p><u>100分の90</u></p> <p>(5) 残存期間 20年超 30年以内のもの</p> <p><u>100分の88</u></p> <p>(6) 残存期間 30年超のもの</p> <p><u>100分の88</u></p>	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	<p>(1) 残存期間 1年以内のもの</p> <p><u>100分の97</u></p> <p>(2) 残存期間 1年超 5年以内のもの</p> <p><u>100分の95</u></p> <p>(3) 残存期間 5年超 10年以内のもの</p> <p><u>100分の94</u></p> <p>(4) 残存期間 10年超 20年以内のもの</p> <p><u>100分の92</u></p> <p>(5) 残存期間 20年超 30年以内のもの</p> <p><u>100分の90</u></p> <p>(6) 残存期間 30年超のもの</p> <p><u>100分の90</u></p>
	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	<p>(1) 残存期間 1年以内のもの</p> <p><u>100分の91</u></p> <p>(2) 残存期間 1年超 5年以内のもの</p> <p><u>100分の89</u></p> <p>(3) 残存期間 5年超 10年以内のもの</p> <p><u>100分の88</u></p> <p>(4) 残存期間 10年超 20年以内のもの</p> <p><u>100分の87</u></p> <p>(5) 残存期間 20年超 30年以内のもの</p> <p><u>100分の85</u></p> <p>(6) 残存期間 30年超のもの</p> <p><u>100分の84</u></p>	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	<p>(1) 残存期間 1年以内のもの</p> <p><u>100分の95</u></p> <p>(2) 残存期間 1年超 5年以内のもの</p> <p><u>100分の94</u></p> <p>(3) 残存期間 5年超 10年以内のもの</p> <p><u>100分の93</u></p> <p>(4) 残存期間 10年超 20年以内のもの</p> <p><u>100分の91</u></p> <p>(5) 残存期間 20年超 30年以内のもの</p> <p><u>100分の90</u></p> <p>(6) 残存期間 30年超のもの</p> <p><u>100分の89</u></p>
	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	<p>(1) 残存期間 1年以内のもの</p> <p><u>100分の93</u></p> <p>(2) 残存期間 1年超 5年以内のもの</p> <p><u>100分の91</u></p> <p>(3) 残存期間 5年超 10年以内のもの</p> <p><u>100分の90</u></p> <p>(4) 残存期間 10年超 20年以内のもの</p> <p><u>100分の88</u></p> <p>(5) 残存期間 20年超 30年以内のもの</p> <p><u>100分の85</u></p> <p>(6) 残存期間 30年超のもの</p> <p><u>100分の82</u></p>	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	<p>(1) 残存期間 1年以内のもの</p> <p><u>100分の96</u></p> <p>(2) 残存期間 1年超 5年以内のもの</p> <p><u>100分の94</u></p> <p>(3) 残存期間 5年超 10年以内のもの</p> <p><u>100分の93</u></p> <p>(4) 残存期間 10年超 20年以内のもの</p> <p><u>100分の91</u></p> <p>(5) 残存期間 20年超 30年以内のもの</p> <p><u>100分の89</u></p> <p>(6) 残存期間 30年超のもの</p> <p><u>100分の85</u></p>
	フランス共和国政府が発行する	パリ市場における	(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	パリ市場における	(1) 残存期間 1年以内のもの

	ユーロ建債券	前日の最終の気配相場	の		ユーロ建債券	前日の最終の気配相場	の
			100分の93				100分の96
			(2) 残存期間1年超5年以内のもの				(2) 残存期間1年超5年以内のもの
			100分の91				100分の94
			(3) 残存期間5年超10年以内のもの				(3) 残存期間5年超10年以内のもの
			100分の89				100分の92
			(4) 残存期間10年超20年以内のもの				(4) 残存期間10年超20年以内のもの
			100分の86				100分の89
			(5) 残存期間20年超30年以内のもの				(5) 残存期間20年超30年以内のもの
			100分の82				100分の85
			(6) 残存期間30年超のもの				(6) 残存期間30年超のもの
			100分の81				100分の85
(略)				(略)			

(注) 1.～4. (略)

2～7 (略)

付 則

この改正規定は、令和2年7月13日から施行する。

(注) 1.～4. (略)

2～7 (略)

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取扱いの一部改正新旧対照表

新	旧
<p>(外国通貨の取扱い) 第2条の2 (略) 2 取引証拠金規則第11条、第16条及び第20条の2で規定する当社が定める率は、アメリカ合衆国通貨の場合は、<u>100分の95</u>とする。</p> <p style="text-align: center;">付 則 (令和2年7月13日)</p> <p>この改正規定は、令和2年7月13日から施行する。</p>	<p>(外国通貨の取扱い) 第2条の2 (略) 2 取引証拠金規則第11条、第16条及び第20条の2で規定する当社が定める率は、アメリカ合衆国通貨の場合は、<u>100分の97</u>とする。</p>