

取引所株価指数証拠金取引における証拠金制度変更

新制度	現行制度
<p>取引所株価指数証拠金取引の1取引単位当たりの株価指数証拠金基準額は、取引所株価指数証拠金取引の種類ごとに、次に掲げる方法により算出する。</p> <p>① 週の最終取引日に係る付合せ時間帯の開始時が属する暦日を算定基準日とし、一の算定基準日の属する週から遡る <u>8週間及び104週間</u> (いずれも当該週を含む。) における各取引日について、一の取引日の株価指数清算価格を当該一の取引日の前取引日の株価指数清算価格で除した数値を算出する。なお、重複期間においては、リセット日までの残存期間が長い銘柄の株価指数清算価格を用いるものとする。</p> <p>② ①で求めた<u>当該8週間及び104週間の各数値</u>について、それぞれ自然対数をとる。</p> <p>③ ②で得られた<u>当該8週間及び104週間の数値の標準偏差</u>を算出する。</p> <p>④ ③で得られた<u>当該8週間及び104週間の各数値にそれぞれ2.33</u>を乗じる。</p> <p>⑤ ④で得られた<u>当該8週間及び104週間の各数値に算定基準日が属する取引日の株価指数清算価格を乗じ、100倍</u> (NYダウリセット付証拠金取引及びNASDAQ-100リセット付証拠金取引にあつては10倍) して端数金額を10円単位に切り上げる。</p> <p>⑥ ⑤で得られた<u>当該8週間及び104週間の額のうち、大きい方の額を株価指数証拠金基準額</u>とする。</p>	<p>取引所株価指数証拠金取引の1取引単位当たりの株価指数証拠金基準額は、取引所株価指数証拠金取引の種類ごとに、次に掲げる方法により算出する。</p> <p>① 週の最終取引日に係る付合せ時間帯の開始時が属する暦日を算定基準日とし、一の算定基準日の属する週から遡る <u>24週間</u> (当該週を含む。) における各取引日について、一の取引日の株価指数清算価格を当該一の取引日の前取引日の株価指数清算価格で除した数値を算出する。なお、重複期間においては、リセット日までの残存期間が長い銘柄の株価指数清算価格を用いるものとする。</p> <p>② ①で求めた数値について、それぞれ自然対数をとる。</p> <p>③ ②で得られた数値の標準偏差を算出する。</p> <p>④ ③で得られた数値に <u>2.58</u> を乗じる。</p> <p>⑤ ④で得られた数値に算定基準日が属する取引日の株価指数清算価格を乗じ、100倍 (NYダウリセット付証拠金取引及びNASDAQ-100リセット付証拠金取引にあつては10倍) して端数金額を10円単位に切り上げて<u>得られた額を、株価指数証拠金基準額</u>とする。</p>

※ マーケットメイカーに適用する証拠金基準額については、別途本取引所が定める。