

## 代用有価証券の掛目見直しについて(金利先物等取引)

・下表における網掛け部分が変更対象の掛目(代用有価証券の時価(注1)に乗じる率)となります。

項番	代用有価証券の種類(注2)	残存期間等	掛目	
			変更後	現行
1	日本国が発行する国債証券	(1) 国債(変動利付国債、分離元本振替国債及び分離利息振替国債を除く。)及び国庫短期証券(割引短期国債及び政府短期証券)		
		イ 残存期間1年以内のもの	99%	99%
		ロ 残存期間1年超5年以内のもの	98%	98%
		ハ 残存期間5年超10年以内のもの	97%	97%
		ニ 残存期間10年超20年以内のもの	95%	96%
		ホ 残存期間20年超30年以内のもの	93%	94%
		ヘ 残存期間30年超のもの	93%	93%
		(2) 変動利付国債		
		イ 残存期間1年以内のもの	99%	99%
		ロ 残存期間1年超5年以内のもの	98%	98%
		ハ 残存期間5年超10年以内のもの	95%	98%
		ニ 残存期間10年超20年以内のもの	96%	97%
		(3) 分離元本振替国債および分離利息振替国債		
		イ 残存期間1年以内のもの	99%	98%
		ロ 残存期間1年超5年以内のもの	98%	98%
		ハ 残存期間5年超10年以内のもの	97%	97%
		ニ 残存期間10年超20年以内のもの	94%	96%
		ホ 残存期間20年超30年以内のもの	91%	93%
ヘ 残存期間30年超のもの	89%	92%		
2	国内証券取引所に上場されている株券(新株予約権証券を除く。)(注3)		70%	70%

(注1) 代用有価証券の時価は、次のとおりとする。

(1) 第1項の有価証券は、次のとおりとする。

イ 日本証券業協会がその売買参考統計値を発表するものは、当該売買参考統計値のうち平均値

ロ 日本証券業協会がその売買参考統計値を発表しないものは、日本国内の取引所金融商品市場(複数の取引所金融商品市場に上場されている場合は、本取引所が定める取引所金融商品市場。以下この項において同じ。)における最終価格

ハ ロの場合において、最終価格が無いときは最終気配相場

(2) 第2項の有価証券については、次のいずれかの値

イ 日本国内の取引所金融商品市場における最終価格

ロ イの場合において、最終価格が無いときは最終気配相場

(注2) 注1に掲げるいずれかの方法により時価を取得できるものに限る。

(注3) 日本国内の取引所金融商品市場に上場されているものに限る。