

代用有価証券の掛け目の見直しについて(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け目(代用有価証券の時価(注5)に乗じる率)となります。

項番	代用有価証券の種類(注6)	残存期間等	掛け目	
			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	99%	99%
		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	97%	97%
		ホ 残存期間20年超30年以内のもの	95%	95%
		ヘ 残存期間30年超のもの	94%	95%
		(2) 変動利付国債		
		イ 残存期間1年以内のもの	98%	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%	96%
		ニ 残存期間10年超20年以内のもの	96%	96%
		(3) 分離元本振替国債及び分離利息振替国債		
		イ 残存期間1年以内のもの	98%	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	96%	96%
		ニ 残存期間10年超20年以内のもの	96%	96%
		ホ 残存期間20年超30年以内のもの	93%	93%
		ヘ 残存期間30年超のもの	90%	92%
2	日本の地方公共団体が発行する地方債証券(注1)	(1) 残存期間1年以内のもの	98%	98%
		(2) 残存期間1年超5年以内のもの	98%	98%
		(3) 残存期間5年超10年以内のもの	96%	96%
		(4) 残存期間10年超20年以内のもの	96%	96%
		(5) 残存期間20年超30年以内のもの	94%	94%
		(6) 残存期間30年超のもの	93%	94%
3	日本の特別の法律により日本法人が発行する債券	(1) 日本政府が元本の償還及び利息の支払いについて保証しているもの		
		イ 残存期間1年以内のもの	98%	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	96%	96%
		ニ 残存期間10年超20年以内のもの	96%	96%
		ホ 残存期間20年超30年以内のもの	94%	94%
		ヘ 残存期間30年超のもの	93%	94%
		(2) その他のもの(注2)		
		イ 残存期間1年以内のもの	97%	97%
		ロ 残存期間1年超5年以内のもの	97%	97%
		ハ 残存期間5年超10年以内のもの	95%	95%
		ニ 残存期間10年超20年以内のもの	95%	95%
		ホ 残存期間20年超30年以内のもの	93%	93%
		ヘ 残存期間30年超のもの	92%	93%

代用有価証券の掛け目の見直しについて(金利先物等取引)

項番	代用有価証券の種類(注6)	残存期間等	掛け目	
			変更後	現行
4	社債券(注1)	(1) 社債券(新株予約権付社債券及び交換社債券を除く。) (注2)		
		イ 残存期間1年以内のもの	97%	97%
		ロ 残存期間1年超5年以内のもの	97%	97%
		ハ 残存期間5年超10年以内のもの	95%	95%
		ニ 残存期間10年超20年以内のもの	95%	95%
		ホ 残存期間20年超30年以内のもの	93%	93%
		ヘ 残存期間30年超のもの	92%	93%
	(2) 転換社債型新株予約権付社債券及び交換社債券 (注3)	80%	80%	
5	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%
6	金融商品取引法施行令第2条の11に定める債券である円貨債券(注1)	(1) 残存期間1年以内のもの	98%	98%
		(2) 残存期間1年超5年以内のもの	98%	98%
		(3) 残存期間5年超10年以内のもの	96%	96%
		(4) 残存期間10年超20年以内のもの	96%	96%
		(5) 残存期間20年超30年以内のもの	94%	94%
		(6) 残存期間30年超のもの	93%	94%
7	外国法人の発行する円貨債券(金融商品取引法施行令第2条の11に定める債券である円貨債券、転換社債型新株予約権付社債券及び交換社債券を除く。)(注1)(注2)	(1) 残存期間1年以内のもの	84%	83%
		(2) 残存期間1年超5年以内のもの	84%	83%
		(3) 残存期間5年超10年以内のもの	82%	81%
		(4) 残存期間10年超20年以内のもの	82%	81%
		(5) 残存期間20年超30年以内のもの	80%	79%
		(6) 残存期間30年超のもの	79%	79%
8	アメリカ合衆国財務省証券	(1) 残存期間1年以内のもの	86%	85%
		(2) 残存期間1年超5年以内のもの	86%	85%
		(3) 残存期間5年超10年以内のもの	86%	85%
		(4) 残存期間10年超20年以内のもの	84%	84%
		(5) 残存期間20年超30年以内のもの	84%	83%
		(6) 残存期間30年超のもの	83%	83%
9	証券投資信託の受益証券(注4)(注7)	(1) 公社債投資信託の受益証券	85%	85%
		(2) その他の証券投資信託の受益証券	70%	70%
10	貸付信託の受益証券(預託を受ける者を信託契約の受託者とし、かつ、発行の日から1年以上経過したものに限る。)(注7)		90%	90%
11	定期預金契約、譲渡性預金契約及び通知預金契約に基づく債権(預託を受ける者を債務者とするものに限る。)(注7)		95%	95%

(注1) 元引受契約が金融商品取引業者により締結されたものに限る。

(注2) 適格格付機関から取得している格付が全てA格相当以上であること等、発行企業の信用力その他の事情を勘案して、本取引所が適当と認めるものに限る。

(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。

(注4) 社団法人投資信託協会が前日の基準価額を発表するものに限る。

(注5) 代用有価証券の時価は、次のとおりとする。

(1) 1から3まで、4(1)並びに6及び7の有価証券については、次のいずれかの値

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) 4(2)及び5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

(3) 8の有価証券については、預託日の前々営業日と同日付のニューヨーク市場(休業の場合は、順次繰り上げる。)における最終気配相場

(4) 9の有価証券については、社団法人投資信託協会が発表する当該有価証券の前日の基準価額

(注6) 注5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7) 委託証拠金の代用に限る。