

決済業務責任者 各位

株式会社日本証券クリアリング機構
常務取締役事務統括長 藤澤 廣一

本日以降の証拠金算出に用いる SPAN パラメーター（長期国債先物オプション取引におけるボラティリティ・スキャンレンジ）の取扱いについて

平素は弊社清算・決済業務の運営に格別の御高配を賜り、厚く御礼申し上げます。

さて、東証分の先物・オプション取引に係る取引証拠金算出につきましては、弊社が公表いたしました SPAN(R)パラメーターに基づき作成した SPAN リスク・パラメーター・ファイルを用いて証拠金所要額を算出して戴いておりますが、去る 11 月 9 日(月)に公表いたしました長期国債先物オプション取引におけるボラティリティ・スキャンレンジは、その数値(19.49%)が市況等の状況を勘案して適当でないと思われるものであると判断し、下記の通りボラティリティ・スキャンレンジを改め、本日のリスク・パラメーター・ファイル作成分(本日の証拠金所要額算出・弊社への 18 日(水)預託分)より適用することとしましたのでご通知申し上げます。

ご迷惑をおかけいたしますが、清算参加者の皆様におかれましては、何卒ご理解・ご協力いただけますようお願い申し上げます。

記

11月9日に公表したボラティリティ・スキャンレンジ	19.49%
本日分のリスク・パラメーター・ファイル作成時より適用するボラティリティ・スキャンレンジ()	1.33%

また、昨日(11月16日)に公表いたしました、11月24日~27日に適用する SPAN(R)パラメーターにつきましても同様に下記のとおり改めることと致します。

11月16日に公表したボラティリティ・スキャンレンジ	19.49%
11月24日~27日のリスク・パラメーター・ファイル作成時に適用するボラティリティ・スキャンレンジ()	1.33%

東証と協議のうえ、ボラティリティ・スキャンレンジの算出にあたり、10月30日に記録された長期国債先物オプションのボラティリティを変動幅の対象に含めないこととして算出した数値です。

以上