

件名

電子決済手段信用取引に係る電子決済手段リスク想定比率の算出方法を定める件

○金融庁告示第 号

電子決済手段等取引業者に関する内閣府令（令和五年内閣府令第 号）第三十二条第五項第二号の規定に基づき、金融庁長官が定める電子決済手段リスク想定比率を算出する方法を次のように定め、令和五年六月一日から適用する。

令和五年 月 日

金融庁長官 中島 淳一

（電子決済手段リスク想定比率の算出方法）

第一条 電子決済手段等取引業者に関する内閣府令（次条において「府令」という。）第三十二条第五項第二号に規定する金融庁長官が定める方法は、定量的計算モデルを用いる方法とする。

（定量的計算モデルの基準）

第二条 電子決済手段等取引業者（資金決済に関する法律（平成二十一年法律第五十九号）第二条第十二項に規定する電子決済手段等取引業者をいう。次条において同じ。）は、定量的計算モデルを用いる方法により電子決済手段リスク想定比率（府令第三十二条第五項第二号に規定する電子決済手段リスク想定比率

をいう。以下この条及び次条において同じ。）を算出する場合には、片側九十九パーセントの信頼区間を使用し、電子決済手段信用取引（府令第一条第二項第五号に規定する電子決済手段信用取引をいう。以下この条において同じ。）の保有期間（電子決済手段リスク想定比率を算出する際に、電子決済手段信用取引に係る資産を保有すると仮定する期間をいう。）を一日以上とするものとする。

（データの抽出要件）

第三条 電子決済手段等取引業者は、定量的計算モデルを用いる方法により電子決済手段リスク想定比率を算出する場合には、次に掲げる要件の全てを満たすヒストリカル・データ（過去に実際に発生した価格変動を表す数値をいう。）を使用するものとする。

- 一 直近二十六週の期間を対象とした数値又は直近百三十週の期間を対象とした数値のいずれか高いものを採用すること。
- 二 各数値に掛目を乗じて得た数値でないこと。
- 三 少なくとも毎週一回更新されること。