

○金融庁告示第 号

金融商品取引業等に関する内閣府令（平成十九年内閣府令第五十二号）第百十七条第二十七項第一号の規定に基づき、金融庁長官が定める為替リスク想定比率を算出する方法を次のように定め、平成 年 月 日から適用する。

平成二十八年 月 日

金融庁長官 森 信親

（為替リスク想定比率の算出方法）

第一条 金融商品取引業等に関する内閣府令（次条において「府令」という。）第百十七条第二十七項第一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 金融商品取引業者等（金融商品取引法（昭和二十三年法律第二十五号）第三十四条に規定する金融商品取引業者等をいう。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為替リスク想定比率（府令第百十七条第二十七項第一号に規定する為替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、特定通貨関連店頭デリバティブ取引(府令第百十七条第一項第三十九号に規定する特定通貨関連店頭デリバティブ取引をいう。以下この条において同じ。)の保有期間(為替リスク想定比率を算出する際に、特定通貨関連店頭デリバティブ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 金融商品取引業者等は、定量的計算モデルを用いる方法により為替リスク想定比率を算出する場合には、次に掲げる全ての要件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。