

件名

暗号資産信用取引に係る暗号資産リスク想定比率の算出方法を定める件の一部を改正する件

○金融庁告示第 号

安定的かつ効率的な資金決済制度の構築を図るための資金決済に関する法律等の一部を改正する法律（令和四年法律第六十一号）の施行に伴い、暗号資産信用取引に係る暗号資産リスク想定比率の算出方法を定める件（令和二年金融庁告示第十八号）の一部を次のように改正し、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

次の表により、改正前欄に掲げる規定の傍線を付した部分をこれに対応する改正後欄に掲げる規定の傍線を付した部分のように改める。

<p style="text-align: center;">改正後</p>	<p style="text-align: center;">(定量的計算モデルの基準)</p> <p>第二条 暗号資産交換業者（資金決済に関する法律（平成二十一年法律第五十九号）<u>第二条第十六項</u>に規定する暗号資産交換業者をいう。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暗号資産リスク想定比率（府令第二十五条第五項第二号に規定する暗号資産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、暗号資産信用取引（府令第一条第二項第六号に規定する暗号資産信用取引をいう。以下この条において同じ。）の保有期間（暗号資産リスク想定比率を算出する際に、暗号資産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。</p>
<p style="text-align: center;">改正前</p>	<p style="text-align: center;">(定量的計算モデルの基準)</p> <p>第二条 暗号資産交換業者（資金決済に関する法律（平成二十一年法律第五十九号）<u>第二条第八項</u>に規定する暗号資産交換業者をいう。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暗号資産リスク想定比率（府令第二十五条第五項第二号に規定する暗号資産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、暗号資産信用取引（府令第一条第二項第六号に規定する暗号資産信用取引をいう。以下この条において同じ。）の保有期間（暗号資産リスク想定比率を算出する際に、暗号資産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。</p>