

件名

特定暗号資産関連店頭デリバティブ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

前払式支払手段に関する内閣府令等の一部を改正する内閣府令（令和五年内閣府令第 号）の施行に伴い、特定暗号資産関連店頭デリバティブ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十九号）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順次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>(暗号資産等リスク想定比率の算出方法)</p> <p>第一条 「略」</p> <p>(定量的計算モデルの基準)</p> <p>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暗号資産等リスク想定比率（府令第一百七十五条第一号に規定する暗号資産等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、特定暗号資産等関連店頭デリバティブ取引（府令第一百七十五条第一号第四十九号に規定する特定暗号資産等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（暗号資産等リスク想定比率を算出する際に、特定暗号資産等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。</p> <p>(データの抽出要件)</p> <p>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暗号資産等リスク想定比率を算出する場合には、次に掲げる要件</p>
<p style="text-align: center;">改正前</p>	<p>(暗号資産リスク想定比率の算出方法)</p> <p>第一条 「同上」</p> <p>(定量的計算モデルの基準)</p> <p>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暗号資産リスク想定比率（府令第一百七十五条第一号に規定する暗号資産等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、特定暗号資産等関連店頭デリバティブ取引（府令第一百七十五条第一号第四十九号に規定する特定暗号資産等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（暗号資産リスク想定比率を算出する際に、特定暗号資産等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。</p> <p>(データの抽出要件)</p> <p>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暗号資産等リスク想定比率を算出する場合には、次に掲げる要件の</p>

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。  
「一〇三 略」

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。  
「一〇三 同上」

備考 表中の「」の記載は注記である。