



プレスリリース

平成23年9月15日

各位

株式会社 日本商品清算機構

弊社取締役会、臨時株主総会における決議事項について

本日開催の取締役会、臨時株主総会において、下記事項につきまして決議されました。引き続き皆様方のご理解とご協力を賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

記

1. 清算手数料額の改定に関する件（取締役会）

本年3月25日開催の取締役会において決定した中期経営計画及び平成23年度事業計画を実施するため、当社業務方法書運用要綱に定める清算手数料額を平成23年10月1日取引分（9月30日夜間取引分）から、売り買いそれぞれ1枚5円（現行3円）に改定することを決議いたしました。

2. 全部取得条項付種類株式の取得の件（臨時株主総会）

当社定款に基づき、以下のとおり、当社が優先株式に係る種類株式を全部取得するとともに当該種類株式を取得すると引換えに新たに発行する普通株式を交付することを決議いたしました。

I種優先株式1,625株と引換えに、普通株式1,083株を交付する。

II種優先株式1,625株と引換えに、普通株式493株を交付する。

III種優先株式1,250株と引換えに、普通株式246株を交付する。

VI種優先株式500株と引換えに、普通株式82株を交付する。

3. SPANパラメータの運用に係る見直し方針について（別紙）

以上

本件に関するお問合せ先
株式会社 日本商品清算機構
(問合せ先 03-5847-7521)

株式会社日本商品清算機構

SPAN パラメータの運用に係る見直し方針について

1. SPAN パラメータの変更方法について

- ① これまで実施してきた、月 1 回の定時変更を「上期」と「下期」の月 2 回に変更する。
(9 月 26 日発表予定の 10 月適用から月 2 回の定時変更を開始する)
- ② 適用期間は、原則として、「上期」は、毎月第 1 営業日から 15 日(15 日が営業日でない場合はその前営業日まで適用)まで、「下期」は 16 日(16 日が営業日でない場合はその翌営業日から適用)から毎月最終営業日までとする。
- ③ パラメータ適用日から起算し 6 営業日前を算出基準日とし、算出基準日の翌営業日をパラメータ発表日とする(現行同様)。
- ④ パラメータの臨時変更基準は、現行通りプライス・スキャンレンジ(以下 PSR)等でカバーした値の 1.5 倍を基準とする。

* なお、本年 5 月より毎月 15 日に当社ホームページにて発表していた翌月適用見込の PSR 暫定計算値は、上記見直しに伴い廃止する。

2. SPAN パラメータ変更時の切り上げ単位の設定について

- ① PSR、1 ネットデルタ当たりの商品内スプレッド割増額及び納会月割増額の切り上げ単位を現在の 1,000 円から 5,000 円に拡大する。
- ② 東京工業品取引所の金及び白金の PSR については、切り上げ単位を 6,000 円(現行 3,000 円)とする(標準取引とミニ取引のリスクを SPAN®計算上、同一グループで算出するため)。

3. 商品間スプレッド割引の取扱いについて

- ① 当社が割引を認める商品間については、原則として相関係数指標及びリスク相殺可能割合指標を元に定める。
* リスク相殺可能割合とは、ある商品間で実際の値動きから生じたリスク額・①と、商品間割引を行わない場合の証拠金額・②の比率から算出される割合。
- ② 上記 2 指標を利用し、当社が定める基準に応じて商品間スプレッド・クレジット・レート(以下、「クレジット・レート」)を定める。
- ③ クレジット・レート上限値を、当社が適当と認める場合、上限 50%(現行は 30%)まで設定できる扱いとする。

以上