

2023年11月1日

お客様各位

AIゴールド証券株式会社
業務管理部

VaR 証拠金制度における両建て証拠金の計算方法の訂正について

2023年11月6日より VaR 証拠金制度が導入されます。これに伴い、取引説明書を交付し新たな制度下における当社の証拠金所要額の計算方法をご案内いたしましたが、ご案内した計算式のうち、両建て証拠金の計算について変更が発生しましたのでお知らせします。

■ 変更前（契約締結前交付書面10ページ、補足資料25ページ）

両建て証拠金 = $\max[\text{売建玉、買建玉}] / (\text{売建玉} + \text{買建玉})$

×各建玉で算出した VaR 証拠金額の合計 × 当社が定める証拠金掛け目

■ 変更後

両建て証拠金 = (売り買い合算の VaR 証拠金 × $\max[\text{売建玉、買建玉}] / (\text{売建玉} + \text{買建玉})$

－当該建玉の VaR 証拠金) × 当社が定める証拠金掛け目

- この変更により必要証拠金の額は、従来のSPAN証拠金による額とほぼ同水準の金額となります。
- 両建て時に必要な証拠金所要額は、売り買いいずれが多いほうの建玉のみを保有していた時に必要となる証拠金所要額とおおむね同じ金額となります。
(売玉と買玉により証拠金が違う商品があるため異なる場合があります)
- 補足資料25ページの（ご注意）の内容はすべて削除となります。

以 上