

「銘柄後決め現先取引における国債バスケット」のコード設定について

2017年8月2日
証券コード協議会

株式会社日本証券クリアリング機構は、本年6月21日、「国債取引の決済期間の短縮化及び物価連動国債の清算対象化に伴う国債店頭取引清算業務に係る制度要綱」を公表しました。

同制度要綱によれば、2018年5月1日約定分から、「銘柄後決め現先取引」（GCレポ取引に関し、個別銘柄を特定せずバスケット（複数の銘柄の集合体）単位で約定し、スタート決済の直前に国債の渡方の在庫から個別銘柄の割当てを行う方式による取引）が導入されることとなります。

このため、当協議会では、銘柄後決め現先取引の導入に伴う対応として、「銘柄後決め現先取引における国債バスケット」について、別紙のとおり、新証券コード及び公社債銘柄コードを設定する方針です。新証券コード仕様及び公社債銘柄コードに係る取扱い要領の改定は後日実施いたしますが、実務上の必要性を考慮して予めご連絡申し上げます。

以上

本件問合せ先
証券コード協議会
050-3377-7830（直通）

銘柄後決め現先取引における国債バスケットに係る証券コード（案）

2017年8月2日
証券コード協議会

1. 新証券コード

- ・ 国債のコード体系を踏襲し、以下のとおりとする。

【体系】 JP 199 □□□ 900 □

↓

JP + 1（国債は1） + 99（国債名称コード：国債バスケットは99で固定）
 + 構成銘柄コード（3けた。バスケットの種類によって異なる。）
 + 900（証券種類コード：国債バスケットは900で固定）
 + チェック・ディジット（1けた）

【例】 国債バスケットの新証券コード

銘柄名称	新証券コード
国債バスケット（国庫短期証券）	JP 1 99 101 900 9
国債バスケット（利付国債残存10年以下・国庫短期証券）	JP 1 99 103 900 7
国債バスケット（利付・国庫短期証券）	JP 1 99 105 900 5
国債バスケット（変動利付・利付・国庫短期証券）	JP 1 99 107 900 3
国債バスケット（物価連動・変動利付・利付・国庫短期証券）	JP 1 99 109 900 1
国債バスケット（分離元本・分離利息）	JP 1 99 201 900 8

2. 公社債銘柄コード

- ・ 国債のコード体系を踏襲し、以下のとおりとする。

【体系】 0 □□□□ □□□□

↓

0 + 構成銘柄コード（4けた。バスケットの種類によって異なる。）
 + 0099（固有名コード：国債バスケットは0099で固定）

【例】 国債バスケットの公社債銘柄コード

銘柄名称	公社債銘柄コード
国債バスケット（国庫短期証券）	0 0101 0099
国債バスケット（利付国債残存 10 年以下・国庫短期証券）	0 0103 0099
国債バスケット（利付・国庫短期証券）	0 0105 0099
国債バスケット（変動利付・利付・国庫短期証券）	0 0107 0099
国債バスケット（物価連動・変動利付・利付・国庫短期証券）	0 0109 0099
国債バスケット（分離元本・分離利息）	0 0201 0099

3. 銘柄後決め現先取引の導入日等

銘柄後決め現先取引は、2018年5月1日約定分から導入される予定。詳細については、株式会社日本証券クリアリング機構が本年6月21日に公表した「国債取引の決済期間の短縮化及び物価連動国債の清算対象化に伴う国債店頭取引清算業務に係る制度要綱」を参照。

以 上