代用有価証券の掛目の変更に伴う
「ＣＤＳ清算業務に関する業務方法書の取扱い」等の一部改正について

Ⅰ．改正趣旨

代用有価証券の代用価格算出のために時価に乗ずべき率について、直近の市場実勢を踏まえた水準に見直しを行うこととし、ＣＤＳ取引に係る清算業務について規定する「ＣＤＳ清算業務に関する業務方法書の取扱い」、金利スワップ取引に係る清算業務について規定する「金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の取扱い」及び国債店頭取引に係る清算業務について規定する「国債店頭取引清算業務に関する業務方法書の取扱い」について、別紙のとおり所要の改正を行う。

Ⅱ．改正概要

○ 時価に乗ずべき率の見直し

・ 代用有価証券の代用価格算出のために時価に乗じる率について、直近の市場実勢を踏まえた水準に変更を行う。

（備　考）

・ＣＤＳ清算業務に関する業務方法書の取扱い　別表１
・金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の取扱い　別表１
・国債店頭取引清算業務に関する業務方法書の取扱い　第２４条第６項

Ⅲ．施行日

２０２２年１１月２１日から施行する。

以　上

別　紙

「ＣＤＳ清算業務に関する業務方法書の取扱い」等の一部改正新旧対照表

目　　次

１．　ＣＤＳ清算業務に関する業務方法書の取扱い

２．　金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の取扱い

３．　国債店頭取引清算業務に関する業務方法書の取扱い

ＣＤＳ清算業務に関する業務方法書の取扱いの一部改正新旧対照表

新

別表１　代用有価証券の代用価格等に関する表

代用有価証券の代用価格等に関する表

代用有価証券の種類		時価（注１）	時価に乗ずべき率（注２）
国債証券	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの	当該売買参考統計値のうち平均値	（１）国債証券（変動利付国債、分離元本振替国債及び分離利息振替国債を除く。） a　残存期間１年以内のもの １００　分の９９ b　残存期間１年超５年以内のもの １００　分の９８ c　残存期間５年超１０年以内のもの １００　分の９８ d　残存期間１０年超２０年以内のもの １００　分の９６ e　残存期間２０年超３０年以内のもの １００　分の９４ f　残存期間３０年超のもの １００　分の９２ （２）変動利付国債 a　残存期間１年以内のもの １００　分の９９ b　残存期間１年超５年以内のもの １００　分の９９ c　残存期間５年超１０年以内のもの １００　分の９９ d　残存期間１０年超２０年以内のもの １００　分の９９
	売買参考統計値が発表されていないものうち国内の金融商品取引所において上場されているもの	金融商品取引所（注３）における最終価格（注４）	（３）分離元本振替国債及び分離利息振替国債 a　残存期間１年以内のもの １００　分の９９ b　残存期間１年超５年以内のもの １００　分の９８ c　残存期間５年超１０年以内のもの １００　分の９８ d　残存期間１０年超２０年以内のもの １００　分の９６ e　残存期間２０年超３０年以内のもの １００　分の９３ f　残存期間３０年超のもの １００　分の９１
アメリカ合衆国財務省証券		ニューヨーク市場における前日の最終の気配相場における価格を前々日における東京外国為替市場の対顧客直物電信買相場の１米ドル当たりの円貨額により円貨に換算した額	（１）残存期間１年以内のもの １００　分の９４ （２）残存期間１年超５年以内のもの １００　分の９３ （３）残存期間５年超１０年以内のもの １００　分の９２ （４）残存期間１０年超２０年以内のもの １００　分の９０ （５）残存期間２０年超３０年以内のもの １００　分の８８ （６）残存期間３０年超のもの １００　分の８８

（注）１．～４．　（略）

付　則

この改正規定は、令和４年１１月２１日から施行する。

旧

別表１　代用有価証券の代用価格等に関する表

代用有価証券の代用価格等に関する表

代用有価証券の種類		時価（注１）	時価に乗ずべき率（注２）
国債証券	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの	当該売買参考統計値のうち平均値	（１）国債証券（変動利付国債、分離元本振替国債及び分離利息振替国債を除く。） a　残存期間１年以内のもの １００　分の９９ b　残存期間１年超５年以内のもの １００　分の９８ c　残存期間５年超１０年以内のもの １００　分の９７ d　残存期間１０年超２０年以内のもの １００　分の９６ e　残存期間２０年超３０年以内のもの １００　分の９３ f　残存期間３０年超のもの １００　分の９２ （２）変動利付国債 a　残存期間１年以内のもの １００　分の９９ b　残存期間１年超５年以内のもの １００　分の９９ c　残存期間５年超１０年以内のもの １００　分の９９ d　残存期間１０年超２０年以内のもの １００　分の９９
	売買参考統計値が発表されていないものうち国内の金融商品取引所において上場されているもの	金融商品取引所（注３）における最終価格（注４）	（３）分離元本振替国債及び分離利息振替国債 a　残存期間１年以内のもの １００　分の９９ b　残存期間１年超５年以内のもの １００　分の９８ c　残存期間５年超１０年以内のもの １００　分の９７ d　残存期間１０年超２０年以内のもの １００　分の９６ e　残存期間２０年超３０年以内のもの １００　分の９３ f　残存期間３０年超のもの １００　分の９１
アメリカ合衆国財務省証券		ニューヨーク市場における前日の最終の気配相場における価格を前々日における東京外国為替市場の対顧客直物電信買相場の１米ドル当たりの円貨額により円貨に換算した額	（１）残存期間１年以内のもの １００　分の９５ （２）残存期間１年超５年以内のもの １００　分の９４ （３）残存期間５年超１０年以内のもの １００　分の９２ （４）残存期間１０年超２０年以内のもの １００　分の９０ （５）残存期間２０年超３０年以内のもの １００　分の８８ （６）残存期間３０年超のもの １００　分の８８

（注）１．～４．　（略）

金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の取扱いの一部改正新旧対照表

新

別表１　代用有価証券の代用価格等に関する表

代用有価証券の代用価格等に関する表

代用有価証券の種類		時価（注１）	時価に乗ずべき率（注２）
国債証券	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの	当該売買参考統計値のうち平均値	（１）国債証券（変動利付国債、分離元本振替国債及び分離利息振替国債を除く。） a　残存期間１年以内のもの １００分の９９ b　残存期間１年超５年以内のもの １００分の９８ c　残存期間５年超１０年以内のもの １００分の９８ d　残存期間１０年超２０年以内のもの １００分の９６ e　残存期間２０年超３０年以内のもの １００分の９４ f　残存期間３０年超のもの １００分の９２ （２）変動利付国債 a　残存期間１年以内のもの １００分の９９ b　残存期間１年超５年以内のもの １００分の９９ c　残存期間５年超１０年以内のもの １００分の９９ d　残存期間１０年超２０年以内のもの １００分の９９
	売買参考統計値が発表されていないもののうち国内の金融商品取引所において上場されているもの	金融商品取引所（注３）における最終価格（注４）	（３）分離元本振替国債及び分離利息振替国債 a　残存期間１年以内のもの １００分の９９ b　残存期間１年超５年以内のもの １００分の９８ c　残存期間５年超１０年以内のもの １００分の９８ d　残存期間１０年超２０年以内のもの １００分の９６ e　残存期間２０年超３０年以内のもの １００分の９３ f　残存期間３０年超のもの １００分の９１
アメリカ合衆国財務省証券		ニューヨーク市場における前日の最終の気配相場における価格を前々日における東京外国為替市場の対顧客直物電信買相場の１米ドル当たりの円貨額により円貨に換算した額	（１）残存期間１年以内のもの １００分の９４ （２）残存期間１年超５年以内のもの １００分の９３ （３）残存期間５年超１０年以内のもの １００分の９２ （４）残存期間１０年超２０年以内のもの １００分の９０ （５）残存期間２０年超３０年以内のもの １００分の８８ （６）残存期間３０年超のもの １００分の８８

（注）１．～４．　（略）

付　則

この改正規定は、令和４年１１月２１日から施行する。

旧

別表１　代用有価証券の代用価格等に関する表

代用有価証券の代用価格等に関する表

代用有価証券の種類		時価（注１）	時価に乗ずべき率（注２）
国債証券	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの	当該売買参考統計値のうち平均値	（１）国債証券（変動利付国債、分離元本振替国債及び分離利息振替国債を除く。） a　残存期間１年以内のもの １００分の９９ b　残存期間１年超５年以内のもの １００分の９８ c　残存期間５年超１０年以内のもの １００分の９７ d　残存期間１０年超２０年以内のもの １００分の９６ e　残存期間２０年超３０年以内のもの １００分の９３ f　残存期間３０年超のもの １００分の９２ （２）変動利付国債 a　残存期間１年以内のもの １００分の９９ b　残存期間１年超５年以内のもの １００分の９９ c　残存期間５年超１０年以内のもの １００分の９９ d　残存期間１０年超２０年以内のもの １００分の９９
	売買参考統計値が発表されていないもののうち国内の金融商品取引所において上場されているもの	金融商品取引所（注３）における最終価格（注４）	（３）分離元本振替国債及び分離利息振替国債 a　残存期間１年以内のもの １００分の９９ b　残存期間１年超５年以内のもの １００分の９８ c　残存期間５年超１０年以内のもの １００分の９７ d　残存期間１０年超２０年以内のもの １００分の９６ e　残存期間２０年超３０年以内のもの １００分の９３ f　残存期間３０年超のもの １００分の９１
アメリカ合衆国財務省証券		ニューヨーク市場における前日の最終の気配相場における価格を前々日における東京外国為替市場の対顧客直物電信買相場の１米ドル当たりの円貨額により円貨に換算した額	（１）残存期間１年以内のもの １００分の９５ （２）残存期間１年超５年以内のもの １００分の９４ （３）残存期間５年超１０年以内のもの １００分の９２ （４）残存期間１０年超２０年以内のもの １００分の９０ （５）残存期間２０年超３０年以内のもの １００分の８８ （６）残存期間３０年超のもの １００分の８８

（注）１．～４．　（略）

国債店頭取引清算業務に関する業務方法書の取扱いの一部改正新旧対照表

新	旧
（代用国債証券の取扱い） 第２４条　（略） ２～５　（略） ６　業務方法書第７０条の８第２項に規定する当社が定める時価は、預託日の日付で日本証券業協会が発表する売買参考統計値のうち当該銘柄に係る価格の平均値とし、当社が定める率については、次の各号に掲げる国債証券の区分に従い、当該各号に定めるとおりとする。 （１）　利付国債及び割引国債（変動利付国債、物価連動国債、分離元本振替国債及び分離利息振替国債を除く。） ａ・ｂ　（略） ｃ　残存期間５年超１０年以内のもの １００分の９８ ｄ　（略） ｅ　残存期間２０年超３０年以内のもの １００分の９４ ｆ　（略） （２）・（３）　（略） （４）　分離元本振替国債及び分離利息振替国債 ａ・ｂ　（略） ｃ　残存期間５年超１０年以内のもの １００分の９８ ｄ～ｆ　（略） （５）　（略） ７・８　（略） 付　則 この改正規定は、令和４年１１月２１日から施行する。	（代用国債証券の取扱い） 第２４条　（略） ２～５　（略） ６　業務方法書第７０条の８第２項に規定する当社が定める時価は、預託日の日付で日本証券業協会が発表する売買参考統計値のうち当該銘柄に係る価格の平均値とし、当社が定める率については、次の各号に掲げる国債証券の区分に従い、当該各号に定めるとおりとする。 （１）　利付国債及び割引国債（変動利付国債、物価連動国債、分離元本振替国債及び分離利息振替国債を除く。） ａ・ｂ　（略） ｃ　残存期間５年超１０年以内のもの １００分の９７ ｄ　（略） ｅ　残存期間２０年超３０年以内のもの １００分の９３ ｆ　（略） （２）・（３）　（略） （４）　分離元本振替国債及び分離利息振替国債 ａ・ｂ　（略） ｃ　残存期間５年超１０年以内のもの １００分の９７ ｄ～ｆ　（略） （５）　（略） ７・８　（略）