

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すべき率について、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

(備 考)

○ 時価に乗すべき率の見直し

- ・ 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。

- ・ 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5項

III. 施行日

平成28年11月28日から施行する。

以 上

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の一部改正新旧対照表
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の一部改正新旧対照表
3. 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

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				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				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)	時価に乗すべき率(注2)	代用有価証券の種類		時価(注1)	時価に乗すべき率(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94 f 残存期間30年超のもの 100分の93	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99 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97 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93
	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)	(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97		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)	(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97
			(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98 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				(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98 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 <u>100分の87</u> (2) 残存期間1年超5年以内のもの <u>100分の87</u> (3) 残存期間5年超10年以内のもの <u>100分の87</u> (4) 残存期間10年超20年以内のもの <u>100分の87</u> (5) 残存期間20年超30年以内のもの <u>100分の87</u> (6) 残存期間30年超のもの 100分の87	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 <u>100分の88</u> (2) 残存期間1年超5年以内のもの <u>100分の88</u> (3) 残存期間5年超10年以内のもの <u>100分の88</u> (4) 残存期間10年超20年以内のもの <u>100分の88</u> (5) 残存期間20年超30年以内のもの <u>100分の88</u> (6) 残存期間30年超のもの 100分の87
--------------	--	--	--------------	--	--

(注) 1. ～ 4. (略)

付 則

この改正規定は、平成28年11月28日から施行する。

(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				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				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）	時価に乗すべき率（注2）	代用有価証券の種類		時価（注1）	時価に乗すべき率（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94 f 残存期間30年超のもの 100分の93	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99 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97 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93
	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）	(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97  (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98 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		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）	(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97  (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98 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 <u>100分の87</u> (2) 残存期間1年超5年以内のもの <u>100分の87</u> (3) 残存期間5年超10年以内のもの <u>100分の87</u> (4) 残存期間10年超20年以内のもの <u>100分の87</u> (5) 残存期間20年超30年以内のもの <u>100分の87</u> (6) 残存期間30年超のもの 100分の87	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 <u>100分の88</u> (2) 残存期間1年超5年以内のもの <u>100分の88</u> (3) 残存期間5年超10年以内のもの <u>100分の88</u> (4) 残存期間10年超20年以内のもの <u>100分の88</u> (5) 残存期間20年超30年以内のもの <u>100分の88</u> (6) 残存期間30年超のもの 100分の87
--------------	--	--	--------------	--	--

(注) 1. ～ 4. (略)

付 則

この改正規定は、平成28年11月28日から施行する。

(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
<p>(代用国債証券の取扱い)</p> <p>第24条 (略)</p> <p>2～4 (略)</p> <p>5 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利回りの平均値により、預託日を基準として算出する価格(当該銘柄が変動利付国債である場合にあっては、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。</p> <p>(1) 利付国債及び割引国債(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。)</p> <p>a (略)</p> <p>b 残存期間1年超5年以内のもの <u>100分の98</u></p> <p>c 残存期間5年超10年以内のもの <u>100分の97</u></p> <p>d 残存期間10年超20年以内のもの <u>100分の96</u></p> <p>e～f (略)</p> <p>(2) (略)</p> <p>(3) 分離元本振替国債及び分離利息振替国債</p> <p>a～e (略)</p> <p>f 残存期間30年超のもの <u>100分の92</u></p> <p>(4) (略)</p> <p>6・7 (略)</p> <p style="text-align: center;">付 則</p> <p>この改正規定は、平成28年11月28日から施行する。</p>	<p>(代用国債証券の取扱い)</p> <p>第24条 (略)</p> <p>2～4 (略)</p> <p>5 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利回りの平均値により、預託日を基準として算出する価格(当該銘柄が変動利付国債である場合にあっては、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。</p> <p>(1) 利付国債及び割引国債(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。)</p> <p>a (略)</p> <p>b 残存期間1年超5年以内のもの <u>100分の99</u></p> <p>c 残存期間5年超10年以内のもの <u>100分の98</u></p> <p>d 残存期間10年超20年以内のもの <u>100分の97</u></p> <p>e～f (略)</p> <p>(2) (略)</p> <p>(3) 分離元本振替国債及び分離利息振替国債</p> <p>a～e (略)</p> <p>f 残存期間30年超のもの <u>100分の91</u></p> <p>(4) (略)</p> <p>6・7 (略)</p>