

国債店頭取引清算業務に関する業務方法書等の一部改正について

平成26年前半に予定されている資産管理専門信託銀行の国債店頭取引清算業務への参加に向けた対応の一環として、国債店頭取引清算業務に関する業務方法書等について所要の改正を行う。

記

1. 改正概要

- ・ 決済日等を条件とする債務の引受けの申込みを行う場合の届出事項のうち事務処理上利用しない項目を削除する。
- ・ 当初証拠金グループの設定において、単一のネットティング口座と当初証拠金グループの組合せを可能とする。
- ・ 当初証拠金グループを口座管理手数料の計算対象に追加する。

(備考)

- ・ 国債店頭取引清算業務に関する業務方法書第42条第2項等
- ・ 国債店頭取引清算業務に関する業務方法書第90条第2項等
- ・ 国債店頭取引清算業務に関する手数料に関する規則第2条第2項等

2. 施行日

平成26年1月14日から施行する。

以上

国債店頭取引清算業務に関する業務方法書等の一部改正新旧対照表

目 次

1. 国債店頭取引清算業務に関する業務方法書の一部改正新旧対照表
2. 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
3. 国債店頭取引清算業務に関する手数料に関する規則の一部改正新旧対照表
4. 国債店頭取引に係る当初証拠金所要額に関する規則の一部改正新旧対照表

国債店頭取引清算業務に関する業務方法書の一部改正新旧対照表

新	旧
<p>(決済日等を条件とする債務の引受けの申込み) 第42条 (略)</p> <p>2 清算参加者は、前項に規定する債務の引受けの申込みをしようとするときは、当社の定めるところにより、次の各号に掲げる事項をあらかじめ届け出るものとする。この場合において、前項に規定する債務の引受けの申込みを行うことができる期間は、第3号に掲げる<u>債務引受申込開始日の前日</u>の午後6時30分(第40条第3項ただし書の規定により時限が変更された場合は当該時限)から第2号に掲げる<u>債務引受基準日の前日</u>の午後6時30分(第40条第3項ただし書の規定により時限が変更された場合は当該時限)までとする。</p> <p>(1)・(2) (略)</p> <p><u>(3) 債務引受申込開始日(前項に規定する申込みにより債務の引受けを行わせようとする期間の開始日をいう。以下同じ。)</u></p> <p>3～6 (略)</p>	<p>(決済日等を条件とする債務の引受けの申込み) 第42条 (略)</p> <p>2 清算参加者は、前項に規定する債務の引受けの申込みをしようとするときは、当社の定めるところにより、次の各号に掲げる事項をあらかじめ届け出るものとする。この場合において、前項に規定する債務の引受けの申込みを行うことができる期間は、第3号に掲げる<u>開始日前日</u>の午後6時30分(第40条第3項ただし書の規定により時限が変更された場合は当該時限)から<u>始まるもの</u>とする。</p> <p>(1)・(2) (略)</p> <p><u>(3) 前項に規定する債務の引受けの申込みを行うことができる期間の開始日及び終了日</u></p> <p>3～6 (略)</p>
<p>(決済日等を条件とする債務の引受け) 第45条 (略)</p> <p>2 当社は、第42条第2項に規定する届出が行われたときは、債務引受基準日の属する月の初日(休業日に当たるときは、順次繰り下げる。)から同項第3号に掲げる<u>債務引受申込開始日の前日</u>の午後6時30分(第40条第3項ただし書の規定により時限が変更された場合は当該時限)までに行われた同項第1号に規定する事項を内容として行われた債務の引受けの申込みについては、債務の引受けの対象外とす</p>	<p>(決済日等を条件とする債務の引受け) 第45条 (略)</p> <p>2 当社は、第42条第2項に規定する届出が行われたときは、債務引受基準日の属する月の初日(休業日に当たるときは、順次繰り下げる。)から同項第3号の定めるところにより<u>債務の引受けの申込みを行うことができる期間の開始日として特定した日</u>の前日の午後6時30分(第40条第3項ただし書の規定により時限が変更された場合は当該時限)までに行われた同項第1号に規定する事項を内容として行わ</p>

る。

3 (略)

(複数のネットィング口座を開設している清算参加者の特例)

第90条 (略)

2 信託口を開設している清算参加者は、当初証拠金グループを設定し、一の当初証拠金グループに一又は二以上の信託口を割り当てることができる。

3 清算参加者は、当初証拠金グループの設定又は設定の解除をしようとするときは、あらかじめ当社が定めるところにより、当社に届出を行わなければならない。

4 清算参加者が当初証拠金グループを設定している場合には、第70条、第73条、第78条及び第80条の規定は、一の当初証拠金グループを一のネットィング口座とみなして適用する。

付 則

この改正規定は、平成26年1月14日から施行する。

れた債務の引受けの申込みについては、債務の引受けの対象外とする。

3 (略)

(複数のネットィング口座を開設している清算参加者の特例)

第90条 (略)

2 複数の信託口を開設している清算参加者は、当初証拠金に関してポジションを通算する信託口の組合せ(以下「当初証拠金グループ」という。)を指定することができる。

3 清算参加者は、当初証拠金グループの指定又は指定の解除をしようとするときは、あらかじめ当社が定めるところにより、当社に届出を行わなければならない。

4 清算参加者が当初証拠金グループを指定している場合には、第70条、第73条、第78条及び第80条の規定は、一の当初証拠金グループを一のネットィング口座とみなして適用する。

国債店頭取引清算業務に関する業務方法書の取扱いの一部改正新旧対照表

新	旧
<p>(損失負担金の取扱い)</p> <p>第27条 (略)</p> <p>2 前項に規定する清算参加者に、業務方法書第82条第1項の規定により不履行損失を按分する場合には、前項に規定する清算対象取引について当社が業務方法書第44条第1項及び同第45条第1項の規定により引き受けた債務の額(現金担保付債券貸借取引等に係る利金相当額支払債務、現先取引等に係る利金相当額支払債務及び当初現先取引等の終了に係る利金相当額支払債務を除く。)の合計額で按分するものとする。</p> <p>3 (略)</p> <p>(当初証拠金グループに係る届出)</p> <p>第32条 業務方法書第90条第3項に規定する当初証拠金グループの<u>設定</u>及び<u>設定</u>の解除の届出は、所定の届出書に当社が必要と認める書類を添付して行うものとする。</p> <p>(当初証拠金グループを<u>設定</u>している清算参加者の特例)</p> <p>第33条 清算参加者が当初証拠金グループを<u>設定</u>している場合には、第9条及び第23条の規定は、一の当初証拠金グループを一のネットイング口座とみなして適用する。</p> <p style="text-align: center;">付 則</p> <p>この改正規定は、平成26年1月14日から施行する。</p>	<p>(損失負担金の取扱い)</p> <p>第27条 (略)</p> <p>2 前項に規定する清算参加者に、業務方法書第82条第1項の規定により不履行損失を按分する場合には、前項に規定する清算対象取引について当社が業務方法書第44条第1項及び同第45条第1項の規定により引き受けた債務の額(現金担保付貸借取引等に係る利金相当額支払債務、現先取引等に係る利金相当額支払債務及び当初現先取引等の終了に係る利金相当額支払債務を除く。)の合計額で按分するものとする。</p> <p>3 (略)</p> <p>(当初証拠金グループに係る届出)</p> <p>第32条 業務方法書第90条第3項に規定する当初証拠金グループの<u>指定</u>及び<u>指定</u>の解除の届出は、所定の届出書に当社が必要と認める書類を添付して行うものとする。</p> <p>(当初証拠金グループを<u>指定</u>している清算参加者の特例)</p> <p>第33条 清算参加者が当初証拠金グループを<u>指定</u>している場合には、第9条及び第23条の規定は、一の当初証拠金グループを一のネットイング口座とみなして適用する。</p>

国債店頭取引清算業務に関する手数料に関する規則の一部改正新旧対照表

新	旧
<p>(口座管理手数料)</p> <p>第2条 (略)</p> <p>2 前項に規定する口座管理手数料は、月額50万円とする。ただし、2以上のネットィング口座等(業務方法書第86条に規定するネットィング口座及び業務方法書第90条第2項に規定する当初証拠金グループをいう。以下この条において同じ。)を開設している清算参加者については、当該額に、当該清算参加者が開設するネットィング口座等の数から1を減じた数に20万円を乗じて得た額を加算した金額とする。</p> <p>3 前項の規定にかかわらず、<u>ネットィング口座等の開設日若しくは設定日が月の2日目(休業日を除外する。)以降の日となったとき、又は当該清算参加者がネットィング口座等の廃止の申請若しくは設定の解除の届出を行った場合において当該ネットィング口座等の廃止日若しくは設定の解除日が月の末日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。)の前日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。)以前となったときの当該口座管理手数料は、当該清算参加者が当該ネットィング口座等を開設又は設定していた期間に応じ、前項の金額について日割計算を行った金額とする。</u></p>	<p>(口座管理手数料)</p> <p>第2条 (略)</p> <p>2 前項に規定する口座管理手数料は、月額50万円とする。ただし、2以上のネットィング口座(業務方法書第86条に規定するネットィング口座をいう。以下この条において同じ。)を開設している清算参加者については、当該額に、当該清算参加者が開設するネットィング口座の数から1を減じた数に20万円を乗じて得た額を加算した金額とする。</p> <p>3 前項の規定にかかわらず、<u>口座の開設日が月の2日目(休業日を除外する。)以降の日となったとき、又は当該清算参加者がネットィング口座の廃止を申請した場合において当該口座の廃止日が月の末日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。)の前日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。)以前となったときの当該口座管理手数料は、当該清算参加者が当該ネットィング口座を開設していた期間に応じ、前項の金額について日割計算を行った金額とする。</u></p>
<p>(債務引受手数料)</p> <p>第3条 (略)</p> <p>2 前項に規定する債務引受手数料は、各清算参加者の次の各号に掲げる取引について、当該各号に定めるところによる。</p>	<p>(債務引受手数料)</p> <p>第3条 (略)</p> <p>2 前項に規定する債務引受手数料は、各清算参加者の次の各号に掲げる取引について、当該各号に定めるところによる。</p>

新	旧
<p>(1) (略)</p> <p>(2) <u>現金担保付債券貸借取引等</u> 当社が債務の引受けの申込みを受けた清算対象取引について、業務方法書第40条第2項第2号dに規定する取引決済日に授受する金銭の額に、次のa及びbに掲げる取引ごとに当該a及びbに定める率を乗じた金額 $a \cdot b$ (略)</p> <p>(3) (略)</p> <p style="text-align: center;">付 則</p> <p>この改正規定は、平成26年1月14日から施行する。</p>	<p>(1) (略)</p> <p>(2) <u>現金担保付貸借取引等</u> 当社が債務の引受けの申込みを受けた清算対象取引について、業務方法書第40条第2項第2号dに規定する取引決済日に授受する金銭の額に、次のa及びbに掲げる取引ごとに当該a及びbに定める率を乗じた金額 $a \cdot b$ (略)</p> <p>(3) (略)</p>

国債店頭取引に係る当初証拠金所要額に関する規則の一部改正新旧対照表

新	旧
<p>(複数のネットィング口座を開設している清算参加者の特例)</p> <p>第4条 (略)</p> <p>2・3 (略)</p> <p>4 清算参加者が当初証拠金グループを<u>設定</u>している場合には、前2条の規定は、一の当初証拠金グループを一のネットィング口座とみなして適用する。</p> <p style="text-align: center;">付 則</p> <p>この改正規定は、平成26年1月14日から施行する。</p>	<p>(複数のネットィング口座を開設している清算参加者の特例)</p> <p>第4条 (略)</p> <p>2・3 (略)</p> <p>4 清算参加者が当初証拠金グループを<u>指定</u>している場合には、前2条の規定は、一の当初証拠金グループを一のネットィング口座とみなして適用する。</p>