

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 5 月 23 日から施行する。

以 上

C D S 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. C D S 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

C D S 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）	時価に乘すべき率（注 2）	代用有価証券の種類		時価（注 1）	時価に乘すべき率（注 2）
国債証券	日本証券業協会が売買参考統計値を公表するもの	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 1 0 0 分の 9 9 b 残存期間 1 年超 5 年以内のもの 1 0 0 分の 9 9 c 残存期間 5 年超 1 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 8 d 残存期間 1 0 年超 2 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 7 e 残存期間 2 0 年超 3 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 4 f 残存期間 3 0 年超のもの 1 0 0 分の 9 3 （2）変動利付国債 a 残存期間 1 年以内のもの 1 0 0 分の 9 9 b 残存期間 1 年超 5 年以内のもの 1 0 0 分の 9 8 c 残存期間 5 年超 1 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 8 d 残存期間 1 0 年超 2 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 7 （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 1 0 0 分の 9 8 b 残存期間 1 年超 5 年以内のもの 1 0 0 分の 9 8 c 残存期間 5 年超 1 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 7 d 残存期間 1 0 年超 2 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 6 e 残存期間 2 0 年超 3 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 3 f 残存期間 3 0 年超のもの 1 0 0 分の 9 1	国債証券	日本証券業協会が売買参考統計値を公表するもの	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 1 0 0 分の 9 9 b 残存期間 1 年超 5 年以内のもの 1 0 0 分の 9 9 c 残存期間 5 年超 1 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 8 d 残存期間 1 0 年超 2 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 6 e 残存期間 2 0 年超 3 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 4 f 残存期間 3 0 年超のもの 1 0 0 分の 9 3 （2）変動利付国債 a 残存期間 1 年以内のもの 1 0 0 分の 9 9 b 残存期間 1 年超 5 年以内のもの 1 0 0 分の 9 9 c 残存期間 5 年超 1 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 8 d 残存期間 1 0 年超 2 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 7 （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 1 0 0 分の 9 8 b 残存期間 1 年超 5 年以内のもの 1 0 0 分の 9 8 c 残存期間 5 年超 1 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 7 d 残存期間 1 0 年超 2 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 6 e 残存期間 2 0 年超 3 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 3 f 残存期間 3 0 年超のもの 1 0 0 分の 9 1
	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）			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）	
（略）				（略）			
（注） 1. ～ 4. （略）				（注） 1. ～ 4. （略）			

付 則 この改正規定は、平成 28 年 5 月 23 日から施行する。	
---	--

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）	時価に乘すべき率（注 2）	代用有価証券の種類		時価（注 1）	時価に乘すべき率（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 1 0 0 分の 9 9 b 残存期間 1 年超 5 年以内のもの 1 0 0 分の 9 9 c 残存期間 5 年超 1 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 8 d 残存期間 1 0 年超 2 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 7 e 残存期間 2 0 年超 3 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 4 f 残存期間 3 0 年超のもの 1 0 0 分の 9 3 （２）変動利付国債 a 残存期間 1 年以内のもの 1 0 0 分の 9 9 b 残存期間 1 年超 5 年以内のもの 1 0 0 分の 9 8 c 残存期間 5 年超 1 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 8 d 残存期間 1 0 年超 2 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 7 （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 1 0 0 分の 9 8 b 残存期間 1 年超 5 年以内のもの 1 0 0 分の 9 8 c 残存期間 5 年超 1 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 7 d 残存期間 1 0 年超 2 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 6 e 残存期間 2 0 年超 3 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 3 f 残存期間 3 0 年超のもの 1 0 0 分の 9 1	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 1 0 0 分の 9 9 b 残存期間 1 年超 5 年以内のもの 1 0 0 分の 9 9 c 残存期間 5 年超 1 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 8 d 残存期間 1 0 年超 2 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 6 e 残存期間 2 0 年超 3 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 4 f 残存期間 3 0 年超のもの 1 0 0 分の 9 3 （２）変動利付国債 a 残存期間 1 年以内のもの 1 0 0 分の 9 9 b 残存期間 1 年超 5 年以内のもの 1 0 0 分の 9 9 c 残存期間 5 年超 1 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 8 d 残存期間 1 0 年超 2 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 7 （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 1 0 0 分の 9 8 b 残存期間 1 年超 5 年以内のもの 1 0 0 分の 9 8 c 残存期間 5 年超 1 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 7 d 残存期間 1 0 年超 2 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 6 e 残存期間 2 0 年超 3 0 年以内のもの 1 0 0 分の 9 3 f 残存期間 3 0 年超のもの 1 0 0 分の 9 1
	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）			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）	
（略）				（略）			
（注） 1. ～ 4. （略）				（注） 1. ～ 4. （略）			

付 則

この改正規定は、平成 2 8 年 5 月 2 3 日から施行する。

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
(代用国債証券の取扱い) 第 2 4 条 (略) 2 ～ 4 (略) 5 業務方法書第 7 0 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。 (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。) a ～ c (略) d 残存期間 1 0 年超 2 0 年以内のもの <u>1 0 0 分の 9 7</u> e ～ f (略) (2) 変動利付国債 a (略) b 残存期間 1 年超 5 年以内のもの <u>1 0 0 分の 9 8</u> c ～ d (略) (3) ～ (4) (略) 6 ・ 7 (略) 付 則 この改正規定は、平成 2 8 年 5 月 2 3 日から施行する。	(代用国債証券の取扱い) 第 2 4 条 (略) 2 ～ 4 (略) 5 業務方法書第 7 0 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。 (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。) a ～ c (略) d 残存期間 1 0 年超 2 0 年以内のもの <u>1 0 0 分の 9 6</u> e ～ f (略) (2) 変動利付国債 a (略) b 残存期間 1 年超 5 年以内のもの <u>1 0 0 分の 9 9</u> c ～ d (略) (3) ～ (4) (略) 6 ・ 7 (略)