

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」及び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」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

III. 施行日

2019年11月25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

## 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）
（略）			（略）		
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 $\frac{100}{100} \times 97$ (2) 残存期間1年超5年以内のもの $\frac{100}{100} \times 95$ (3) 残存期間5年超10年以内のもの $\frac{100}{100} \times 94$ (4) 残存期間10年超20年以内のもの $\frac{100}{100} \times 92$ (5) 残存期間20年超30年以内のもの $\frac{100}{100} \times 90$ (6) 残存期間30年超のもの $\frac{100}{100} \times 90$	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 $\frac{100}{100} \times 96$ (2) 残存期間1年超5年以内のもの $\frac{100}{100} \times 95$ (3) 残存期間5年超10年以内のもの $\frac{100}{100} \times 94$ (4) 残存期間10年超20年以内のもの $\frac{100}{100} \times 92$ (5) 残存期間20年超30年以内のもの $\frac{100}{100} \times 90$ (6) 残存期間30年超のもの $\frac{100}{100} \times 90$
(注) 1. ～ 4. (略)			(注) 1. ～ 4. (略)		
付 則					
この改正規定は、令和元年11月25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）
（略）			（略）		
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 $\frac{100}{100}$ 分の97 (2) 残存期間1年超5年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の95 (3) 残存期間5年超10年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の94 (4) 残存期間10年超20年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の92 (5) 残存期間20年超30年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の90 (6) 残存期間30年超のもの $\frac{100}{100}$ 分の90	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 $\frac{100}{100}$ 分の96 (2) 残存期間1年超5年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の95 (3) 残存期間5年超10年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の94 (4) 残存期間10年超20年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の92 (5) 残存期間20年超30年以内のもの $\frac{100}{100}$ 分の90 (6) 残存期間30年超のもの $\frac{100}{100}$ 分の90
(注) 1. ～ 4. (略)			(注) 1. ～ 4. (略)		
付 則					
この改正規定は、令和元年11月25日から施行する。					