

新	旧																
<p>第2章 算出方法</p> <p>5. 国庫短期証券 国庫短期証券（含むW I 銘柄）は、次の手順で算出します。</p> <p>(1) グループの分類</p> <p>① 償還日に応じて、下表のとおりグループを分類します。</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">グループ</th> <th style="text-align: center;">対象銘柄</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="text-align: center;">A</td> <td>3Mの最長期債の償還日以前に償還日を迎える銘柄</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">B</td> <td>3Mの最長期債の償還日より償還日が先であり、 6Mの最長期債の償還日以前に償還日を迎える銘柄</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">C</td> <td>6Mの最長期債の償還日より償還日が先である銘柄</td> </tr> </tbody> </table> <p>② グループAは、更に償還月毎にグループを分類します。</p> <p>③ <u>グループB又はグループCにおいて、償還日が四半期末をまたぐ銘柄間で著しい利回り格差が生じていると当社が認める場合、一時的に当該四半期末の前後でグループを分割することがあります。</u></p> <p>(2) (現行どおり)</p> <p>(3) 出来値及び気配がない銘柄の引値の決定 午後3時時点において出来値及び気配がない銘柄は、原則として以下の方法により引値を決定します。</p> <p>① (現行どおり)</p>	グループ	対象銘柄	A	3Mの最長期債の償還日以前に償還日を迎える銘柄	B	3Mの最長期債の償還日より償還日が先であり、 6Mの最長期債の償還日以前に償還日を迎える銘柄	C	6Mの最長期債の償還日より償還日が先である銘柄	<p>第2章 算出方法</p> <p>5. 国庫短期証券 国庫短期証券（含むW I 銘柄）は、次の手順で算出します。</p> <p>(1) グループの分類</p> <p>① 償還日に応じて、下表のとおりグループを分類します。</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">グループ</th> <th style="text-align: center;">対象銘柄</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="text-align: center;">A</td> <td>3Mの最長期債の償還日以前に償還日を迎える銘柄</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">B</td> <td>3Mの最長期債の償還日より償還日が先であり、 6Mの最長期債の償還日以前に償還日を迎える銘柄</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">C</td> <td>6Mの最長期債の償還日より償還日が先である銘柄</td> </tr> </tbody> </table> <p>② グループAは、更に償還月毎にグループを分類します。</p> <p style="text-align: right;">(新設)</p> <p>(2) (省略)</p> <p>(3) 出来値及び気配がない銘柄の引値の決定 午後3時時点において出来値及び気配がない銘柄は、原則として以下の方法により引値を決定します。</p> <p>① (省略)</p>	グループ	対象銘柄	A	3Mの最長期債の償還日以前に償還日を迎える銘柄	B	3Mの最長期債の償還日より償還日が先であり、 6Mの最長期債の償還日以前に償還日を迎える銘柄	C	6Mの最長期債の償還日より償還日が先である銘柄
グループ	対象銘柄																
A	3Mの最長期債の償還日以前に償還日を迎える銘柄																
B	3Mの最長期債の償還日より償還日が先であり、 6Mの最長期債の償還日以前に償還日を迎える銘柄																
C	6Mの最長期債の償還日より償還日が先である銘柄																
グループ	対象銘柄																
A	3Mの最長期債の償還日以前に償還日を迎える銘柄																
B	3Mの最長期債の償還日より償還日が先であり、 6Mの最長期債の償還日以前に償還日を迎える銘柄																
C	6Mの最長期債の償還日より償還日が先である銘柄																

新			旧		
② 同一グループ内に(2)の方法により引値を決定した銘柄が存在しない場合			② 同一グループ内に(2)の方法により引値を決定した銘柄が存在しない場合		
グループ	状態	引値	グループ	状態	引値
A	—	グループAのうち、隣接する残存の長いグループから参照し、最初に得られた銘柄の引値若しくは前日比を適用する、又はG Cレポレート等を参照して決定する	A	—	グループAのうち、隣接する残存の長いグループから参照(※)し、最初に得られた銘柄の引値若しくは前日比を適用する、又はG Cレポレート等を参照して決定する <u>※四半期末を越える隣接グループは参照しない</u>
B	グループCに出来値又は午後3時時点の気配あり	グループCの銘柄の引値又は前日比を適用する	B	グループCに出来値又は午後3時時点の気配あり	グループCの銘柄の引値又は前日比を適用する
	グループCに出来値又は午後3時時点の気配なし	グループAの3Mゾーン及び2年債等を参照して決定する		グループCに出来値又は午後3時時点の気配なし	グループAの3Mゾーン及び2年債等を参照して決定する
C	グループBに出来値又は午後3時時点の気配あり	グループB及び2年債等を参照して決定する	C	グループBに出来値又は午後3時時点の気配あり	グループB及び2年債等を参照して決定する
	グループBに出来値又は午後3時時点の気配なし	グループAの3Mゾーン及び2年債等を参照して決定する		グループBに出来値又は午後3時時点の気配なし	グループAの3Mゾーン及び2年債等を参照して決定する
※1：グループAにおいて四半期末を越える隣接グループは参照しません。 ※2：グループB又はグループCが複数のグループに分かれる場合、四半期末を超える当該グループ間の参照は行いません。			(新設)		
(以下、現行どおり)			(以下、省略)		

2019年12月2日実施

以上