

MMF等の運営に関する委員会決議

平成16年 3月19日制定
平成20年 9月11日改正

この委員会決議は、MMF等の運営に関する規則に基づき自主規制委員会に委任された事項について定める。

- 1 「MMF等の運営に関する規則」に関する細則第4条第3項に規定する平均残存期間の計算例は、次のとおりとする。

計算例（計算日平成9年10月1日）

1. 資産90億円

組入資産	金額（分母）	残存日数	（分子）
コール放出（オーバーナイト）	: 30億円	1日	30
コール放出（7日間）	: 20億円	7日	140
CP（満期日平成9年12月20日）	: 20億円	80日	1,600
変動利付債（次回金利適用日の前日平成10年1月4日）	: 20億円	95日	1,900
合計 90億円			3,670
平均残存日数		40.8日	

2. 10月2日に上記ポートフォリオに下記約定を追加

コール放出（オーバーナイト）分の資金の一部でCP（受渡日10月6日、満期日12月5日）を購入	20億円	60日	1,200
他の資産			
コール放出（オーバーナイト）	: 30億円	1日	30
コール放出（6日間）	: 20億円	6日	120
CP（満期日平成9年12月20日）	: 20億円	79日	1,580
変動利付債（次回金利適用日の前日平成10年1月4日）	: 20億円	94日	1,880
合計 110億円			4,810

ただし、上記コール放出（オーバーナイト）によるCP購入分20億円をマイナスし、分母は90億円とする。

平均残存日数 53.4日

附 則

この部会決議は、平成16年4月1日から実施する。

附 則

この改正は、平成20年10月1日から実施する。