

日 銀 市 第 1 6 4 号
2 0 1 8 年 8 月 1 5 日

オンライン担保差入先 御中

日 本 銀 行

「日本銀行金融ネットワークシステム利用細則（担保関係事務）」
の一部改正に関する件

本年5月1日に国債の決済期間短縮化が実施されたことから、日本銀行では、本年秋口に予定している年次の共通担保の担保掛目等の見直しと併せて、共通担保の時価反映タイミング等を短縮することとし^(注)、これに伴い、「日本銀行金融ネットワークシステム利用細則（担保関係事務）」を別紙のとおり一部改正することとしましたので、通知します。なお、本件改正の具体的な実施日については、10月上旬を目途に改めて通知します。

(注) 概要については、「日本銀行に差入れられている共通担保の時価反映タイミング等の短縮化について」（2017年9月26日付日銀市第155号）を、本件短縮化に向けたスケジュールと実務上の留意点については、「日本銀行に差入れられている共通担保の時価反映タイミング等の短縮化に向けた今後のスケジュール等について」（2018年3月30日付日銀市第52号）をご覧ください。

以 上

「日本銀行金融ネットワークシステム利用細則（担保関係事務）」
 中一部改正

○ 第1編 I. 5. (2) イ. を次のとおり改める（全面改正）。

イ. 担保価額の更新（IV. 3. から5. を参照）

日本銀行は、毎営業日の業務開始時に、当日に適用される時価および円貨換算率（外貨建証券貸付債権または外貨建外国債券の場合に限ります。）ならびに当日時点の残存年限に応じた掛目、連動係数（物価連動国債の場合に限ります。）およびファクター（定時償還債および一部繰上償還債の場合に限ります。）を用いて、担保差入金融機関等から受入れている担保（住宅ローン債権信託受益権を除きます。）の担保価額を自動的に更新します。

日本銀行は、時価または円貨換算率の値を変更する場合には、これらの変更日（以下「時価変更日」といいます。）の翌営業日の業務開始後遅滞なく、すべての担保差入金融機関等の担保出力指定店舗に対して「担保不足・余裕等通知」を送信します。なお、変更後の時価または円貨換算率は、変更日の3営業日後の日（以下「時価適用日」といいます。）から担保価額の算出に適用されます。

《外貨建外国債券以外の債券の時価変更等の日程の例》

1日 (月)	2日 (火)	3日 (水)	4日 (木)	5日 (金)	6日 (土)	7日 (日)	8日 (月)
基準となる 市場相場	時価変更日	担保価額 合計額 および 担保余裕額 の通知		時価適用日			
		3営業日後					
	基準となる 市場相場	時価変更日	担保価額 合計額 および 担保余裕額 の通知				時価適用日
			3営業日後				
		以下同様に推移					

また、日本銀行は、ファクターを変更し、定時償還債または一部繰上償還債である振替社債等の担保価額を減額する場合には、減額実行日の前営業日および減額実行日当日の業務開始後、減額対象の振替社債等を担保として差入れている担保差入金融機関等の担保出力指定店舗に対して「振替社債等担保価額減額実行日通知」を送信します。

○ 第1編IV. 2. (2) (注2) を横線のとおり改める。

(注2) 時価は、原則として市場相場にもとづき、銘柄毎に設定されます(円位未満第2位まで)。初めて時価が設定される場合には、国債のときは、原則として発行日(分離国債のときは元利分離前の国債の発行日。以下(注2)において同じです。)の前営業日(発行日の前営業日より前に市場相場が発表されるときは2営業日前)の市場相場にもとづき時価が設定され、発行日から~~5~~4営業日(発行日の前営業日より前に市場相場が発表されるときは~~4~~3営業日)の間、担保価額等の算出に適用されます。また、国債以外の債券のときは、日本銀行が適当と認める日の前営業日の市場相場にもとづき時価が設定され、当該日本銀行が適当と認める日の翌営業日から~~4~~3営業日の間、担保価額等の算出に適用されます。時価が設定されていない債券については、担保差入を行うことはできません。時価は、日本銀行が必要と判断した場合に変更されます。

○ 第1編IV. 3. (1) を次のとおり改める(全面改正)。

(1) 時価または円貨換算率の変更

日本銀行が、時価または円貨換算率を変更する日を時価変更日、変更後の時価または円貨換算率を用いて担保価額の算出を開始する日を時価適用日とし、時価適用日は時価変更日の3営業日後の日とします。

時価および円貨換算率の変更は、具体的には、次のとおり行われます。

① 外貨建外国債券以外の債券の場合

時価は毎営業日変更されます(毎営業日が時価変更日です。)

変更後の時価は、原則として、時価変更日の前営業日の市場相場にもとづいて定められ、時価適用日の業務開始時から適用されます。

《外貨建外国債券以外の債券の時価変更等の日程の例》

1日 (月)	2日 (火)	3日 (水)	4日 (木)	5日 (金)	6日 (土)	7日 (日)	8日 (月)
基準となる 市場相場	時価変更日	担保価額 合計額 および 担保余裕額 の通知		時価適用日			
			3営業日後				
	基準となる 市場相場	時価変更日	担保価額 合計額 および 担保余裕額 の通知				時価適用日
			3営業日後				
以下同様に推移							

② 外貨建外国債券および外貨建証書貸付債権の場合

時価または円貨換算率は、原則として、毎週最終営業日に市場相場にもとづいて変更される^(注)ほか、随時に変更することがあります。

変更後の時価または円貨換算率は、時価適用日の業務開始時から適用します。

(注) 外貨建外国債券の場合には、時価および円貨換算率が、外貨建証書貸付債権の場合には、円貨換算率が変更されます。

《外貨建外国債券および外貨建証書貸付債権の時価変更等の日程の例》

(定期の変更のうち標準的な例)

1日 (金)	2日 (土)	3日 (日)	4日 (月)	5日 (火)	6日 (水)
時価変更日			担保価額 合計額 および 担保余裕額 の連絡 [*]		時価適用日
	3営業日後				

※担保不足が見込まれる場合に限りです。

○ 第1編IV. 3. (2) を横線のとおり改める。

(2) 担保価額合計額および担保余裕額の通知

各時価適用日の~~3~~2営業日前の日（時価変更日の翌営業日）の業務開始時を基準時点として、次のとおり、担保価額合計額および担保余裕額を算出したうえで、担保差入金融機関等の担保出力指定店舗に「担保不足・余裕等通知」（5250-00500）を送信します。

以下略（不変）

○ 第1編IV. 4. を横線のとおり改める。

4. 掛目

掛目は、毎営業日、担保の残存期間に応じた値（ただし、邦貨手形、短期社債等、分割償還債のうち貸付債権担保住宅金融支援機構債券および住宅ローン債権信託受益権については、残存期間にかかわらず同一の値とします。）が設定され、業務開始時から適用されます^(注)。掛目の値については、日本銀行のホームページ（<http://www.boj.or.jp>）に掲載している「適格担保の担保価格」において具体的に定めています。担保出力指定店舗は、3. (2)「担保不足・余裕等通知」の内容を確認のうえ、当該担保差入金融機関等に属するすべての店舗において、掛目の適用日の~~3~~2営業日前から掛目の適用日までの間に予定される担保受払（期日担保返戻を含みます。）や与信取引等を考慮し、適用日の業務開始時点で担保不足とならないよう担保価額や所要担保価額の管理を厳格に行う必要があります。万一、適用日の業務開始時点で担保不足が生じることが見込まれる場合には、速やかに、担保管理店に連絡してください。また、日本銀行では、掛目の値等については、原則として年1回の頻度で、金融市場の情勢等を踏まえた検証を行い、その結果に基づいて必要な見直しを行うこととしており、掛目の値の変更を決定した場合等には、原則として日本銀行のホームページ（<http://www5.boj.or.jp>）への掲載の方法により、担保差入金融機関等に対して通知しますので、留意してください。

担保の残存期間（X年超X+1年以内）は、次のとおり計算されます。ただし、②証書貸付債権（外貨建証書貸付債権を含みます。以下4.において同じです。）の場合において、残存期間が10年超のときは「9年超10年以内」とします。

以下略（不変）

- 第2編の業務処理区分「適格担保管理 照会データファイル取得 時価・掛目一覧」（コード514201）のデータファイルの出力項目の注2を横線のとおり改める。

（注2）対象日に適用する時価が日銀ネットに登録されている場合（「対象日」が照会日からその3営業日後の日までである場合）にのみ表示されます。