

日 銀 業 第 9 9 2 号
平成29年12月26日

国債売買等関係事務についての

日銀ネット利用先

御中

日銀ネット利用金融機関等

日 本 銀 行

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

日本銀行では、国債条件付売買に関する事務の円滑な運用を図るため、または規程整備の観点から、標記規程の一部を別紙のとおり改正し、本日から実施することとしましたので、通知します。

—— 本件改正は、日本銀行の事務運用を変更するものであり、日銀ネット利用先および日銀ネット利用金融機関等の事務に変更はありません。なお、改正の内容は以下のとおりです。

[改正の内容]

1. 「再売却申込書」別紙における日本銀行記入欄の追加
2. [参考] における物価連動国債の買入代金等計算式の明確化
3. 事務フロー図の体裁の変更（落札日と取引実行日が同一である場合もあるため、区切り線を削除）

以 上

「日本銀行金融ネットワークシステム利用細則（国債
売買等関係事務）」中一部改正（案）

- 第1編Ⅰ. 1. (29) を横線のとおり改める。

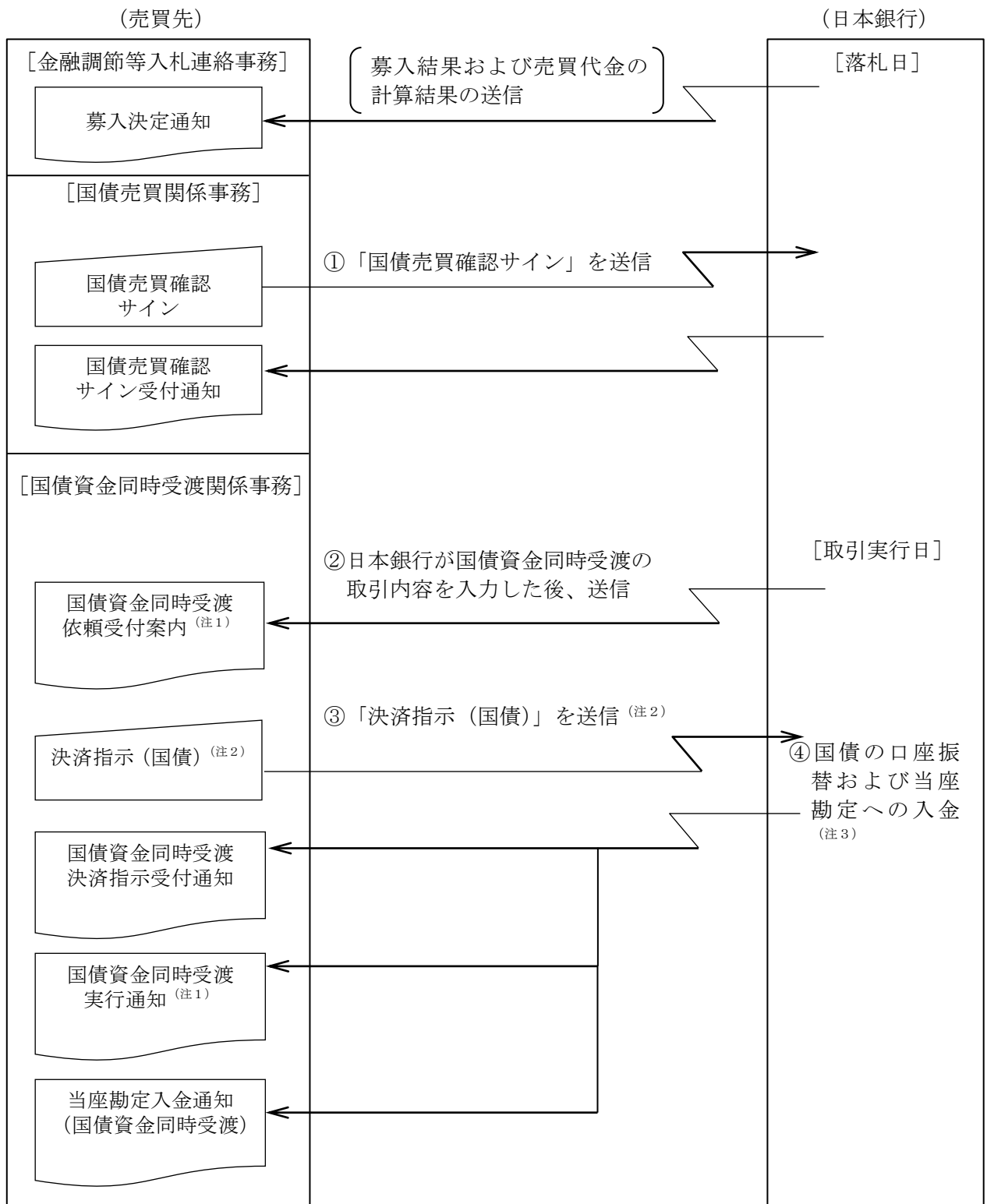
(29) 連動係数

物価連動国債の連動係数として財務省が公表する計算式により算出した
数値をいいます。

- 第1編Ⅱ. 1. (1) および (2) を次のとおり改める（全面改正）。

(1) 日銀国債買入または日銀国庫短期証券買入

イ. 売買先が決済代行先に国債の受払等にかかる事務を委託しない場合

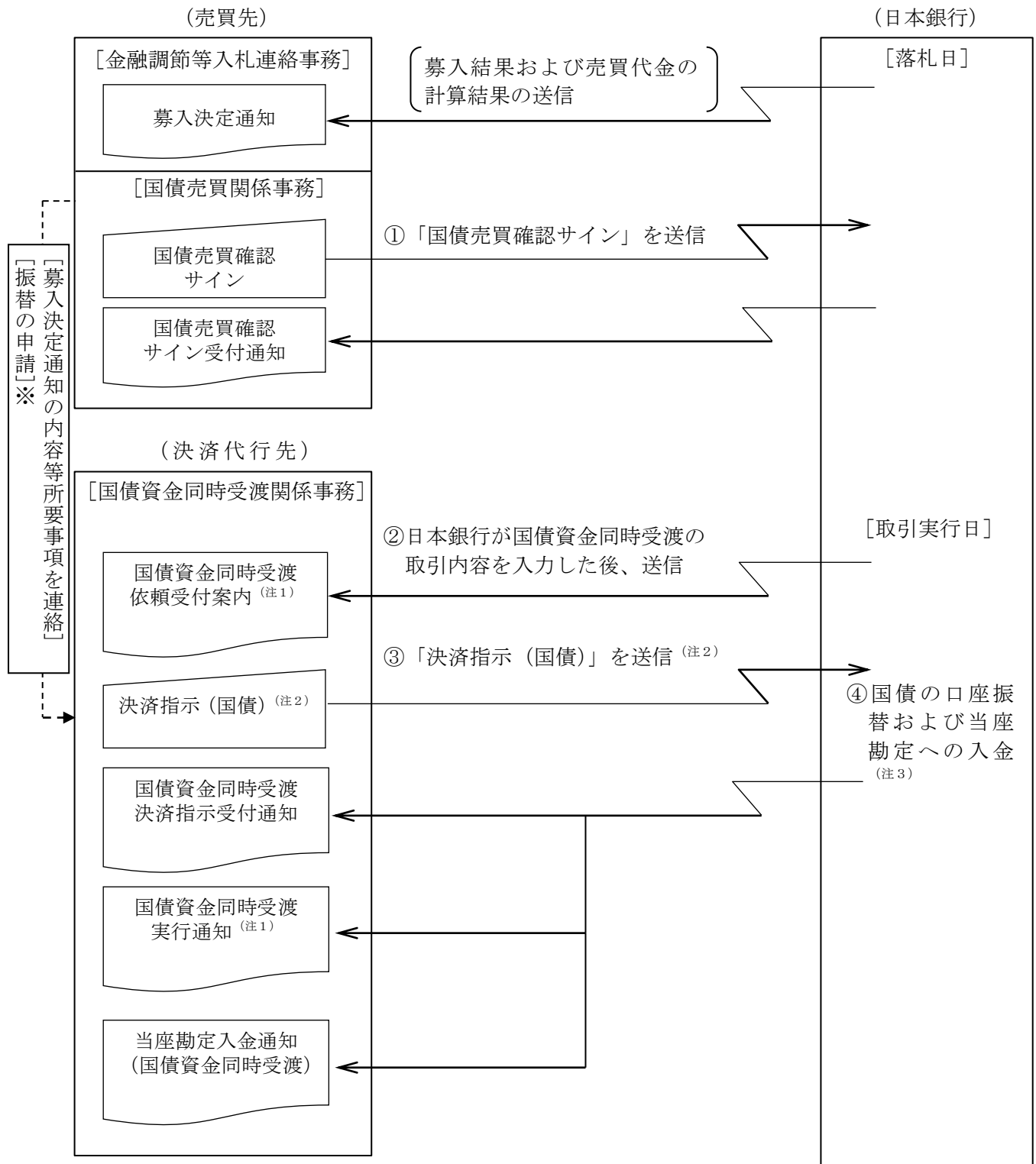


(注1) 日本銀行は、売買先の属する金融機関等の振決出力指定店舗に送信します。

(注2) 売買先は、国債資金同時受渡と同時に、同時担保受払を行う場合には、同時担保受払コードを入力します。

(注3) 日本銀行は、売買先から国債資金同時受渡と同時に同時担保受払の依頼を受けた場合には、担保の返戻および当座勘定への入金を行います。

ロ. 売買先が決済代行先に国債の受払等にかかる事務を委託する場合



(注1) 日本銀行は、決済代行先の属する金融機関等の振決出力指定店舗に送信します。

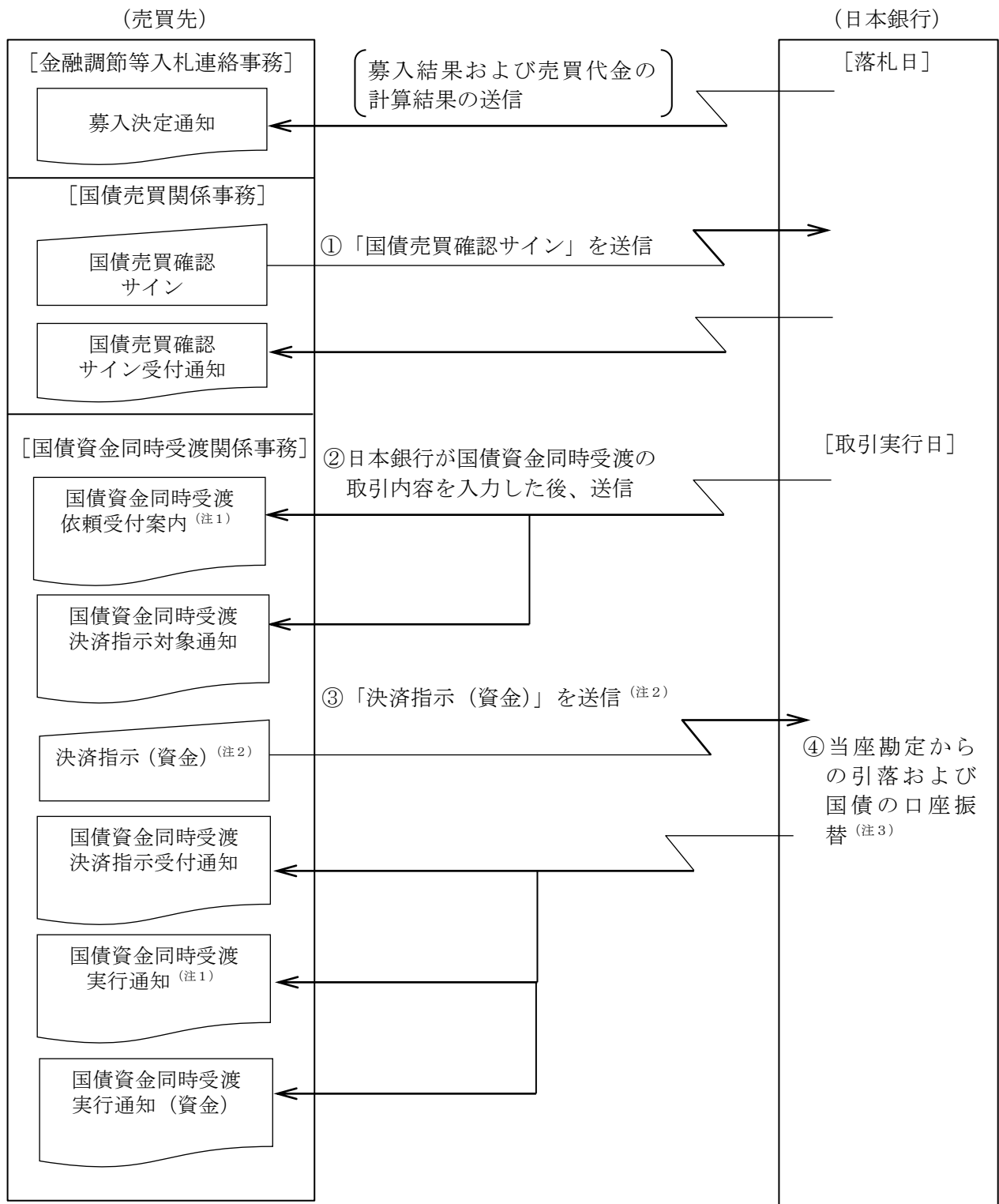
(注2) 決済代行先は、国債資金同時受渡と同時に、同時担保受払を行う場合には、同時担保受払コードを入力します。

(注3) 日本銀行は、決済代行先から国債資金同時受渡と同時に同時担保受払の依頼を受けた場合には、担保の返戻および当座勘定への入金を行います。

※ 国債の受払口座の代行決済口座区分として預り口を申出ている場合に行う必要があります。

(2) 日銀国債売却または日銀国庫短期証券売却

イ. 売買先が決済代行先に国債の受払等にかかる事務を委託しない場合

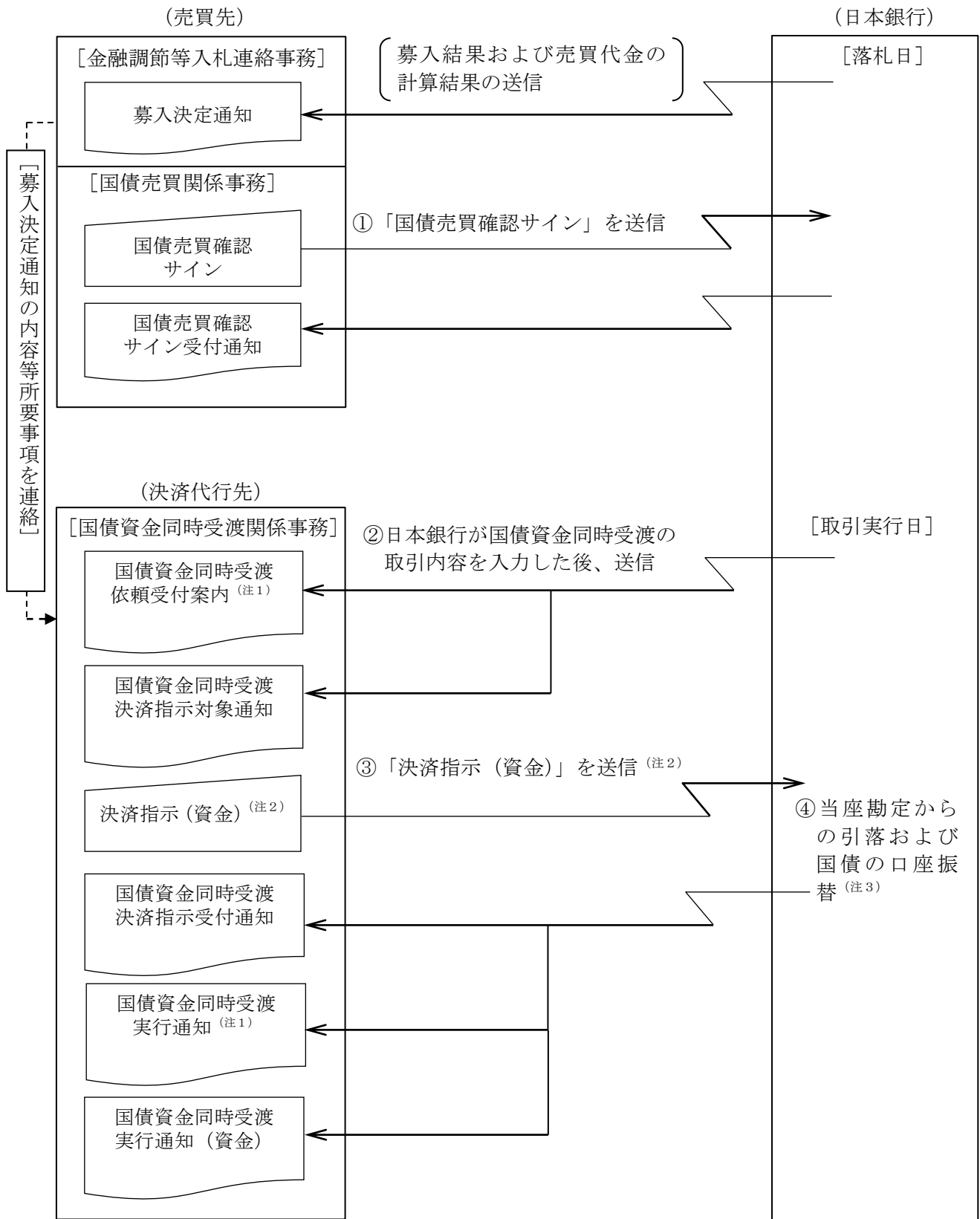


(注1) 日本銀行は、売買先の属する金融機関等の振決出力指定店舗に送信します。

(注2) 売買先は、国債資金同時受渡と同時に、同時担保受払を行う場合には、同時担保受払コードを入力します。

(注3) 日本銀行は、売買先から国債資金同時受渡と同時に同時担保受払の依頼を受けた場合には、担保の差入および当座勘定からの引落を行います。

ロ. 売買先が決済代行先に国債の受払等にかかる事務を委託する場合



(注1) 日本銀行は、決済代行先の属する金融機関等の振決出力指定店舗に送信します。

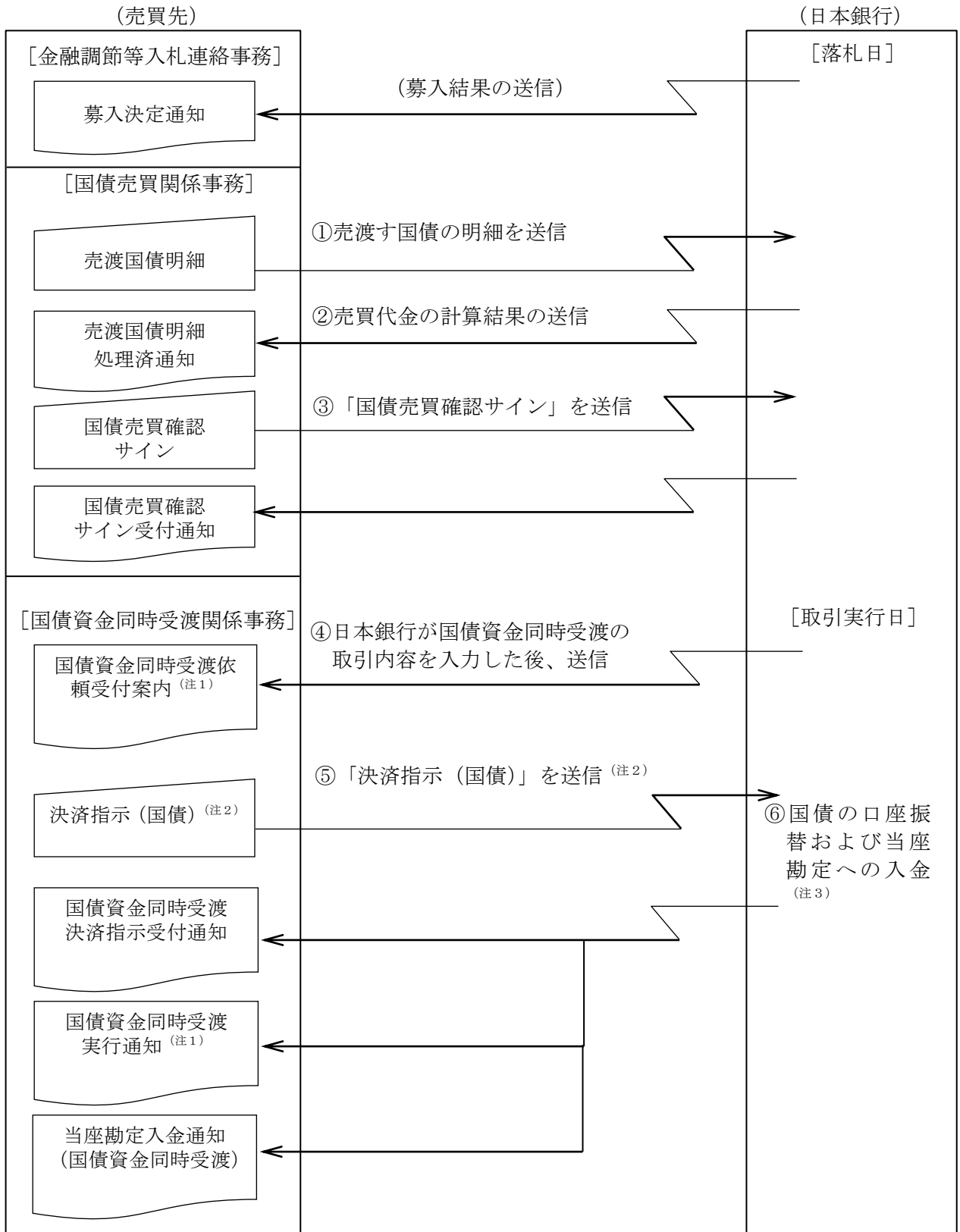
(注2) 決済代行先は、国債資金同時受渡と同時に、同時担保受払を行う場合には、同時担保受払コードを入力します。

(注3) 日本銀行は、決済代行先から国債資金同時受渡と同時に同時担保受払の依頼を受けた場合には、担保の差入および当座勘定からの引落を行います。

○ 第1編Ⅲ. 1. (1) イ. (イ) および (ロ) を次のとおり改める (全面改正)。

(イ) 日銀国債買現先

a. 売買先が決済代行先に国債の受払等にかかる事務を委託しない場合

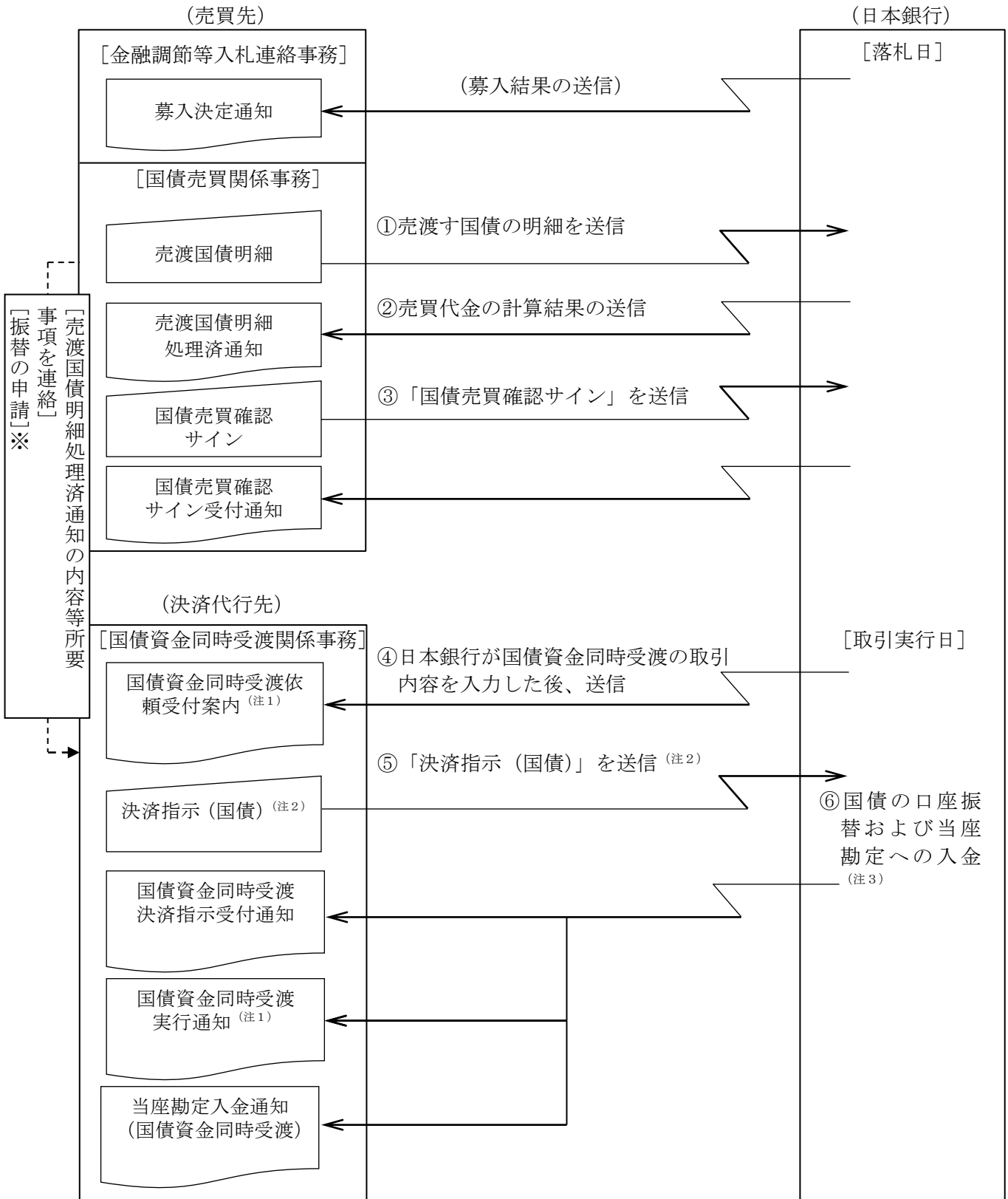


(注1) 日本銀行は、売買先の属する金融機関等の振決出力指定店舗に送信します。

(注2) 売買先は、国債資金同時受渡と同時に、同時担保受払を行う場合には、同時担保受払コードを入力します。

(注3) 日本銀行は、売買先から国債資金同時受渡と同時に同時担保受払の依頼を受けた場合には、担保の返戻および当座勘定への入金を行います。

b. 売買先が決済代行先に国債の受払等にかかる事務を委託する場合



(注1) 日本銀行は、決済代行先の属する金融機関等の振決出力指定店舗に送信します。

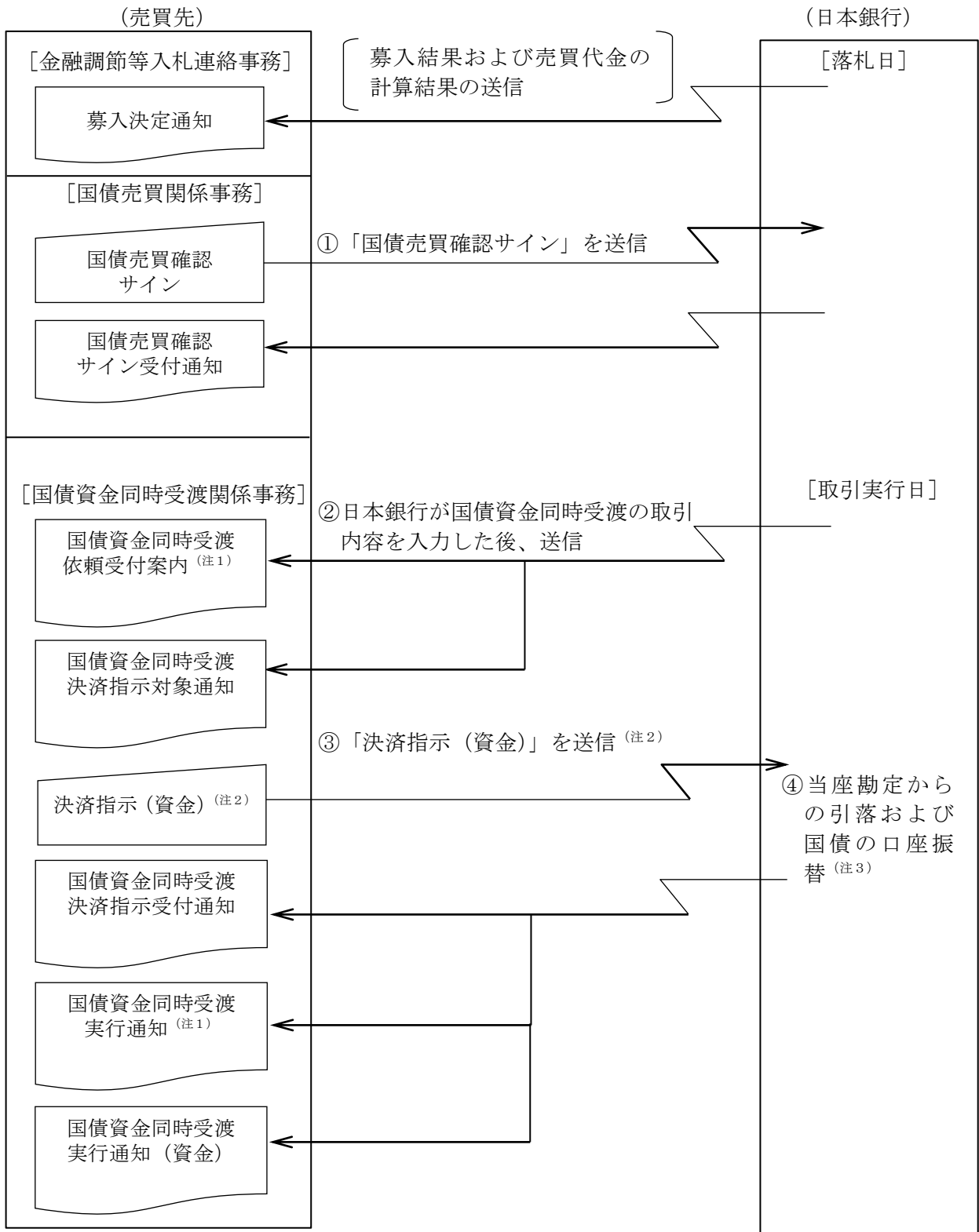
(注2) 決済代行先は、国債資金同時受渡と同時に、同時担保受払を行う場合には、同時担保受払コードを入力します。

(注3) 日本銀行は、決済代行先から国債資金同時受渡と同時に同時担保受払の依頼を受けた場合には、担保の返戻および当座勘定への入金を行います。

※ 国債の受払口座の代行決済口座区分として預り口を申出ている場合に行う必要があります。

(ロ) 日銀国債売現先

a. 売買先が決済代行先に国債の受払等にかかる事務を委託しない場合

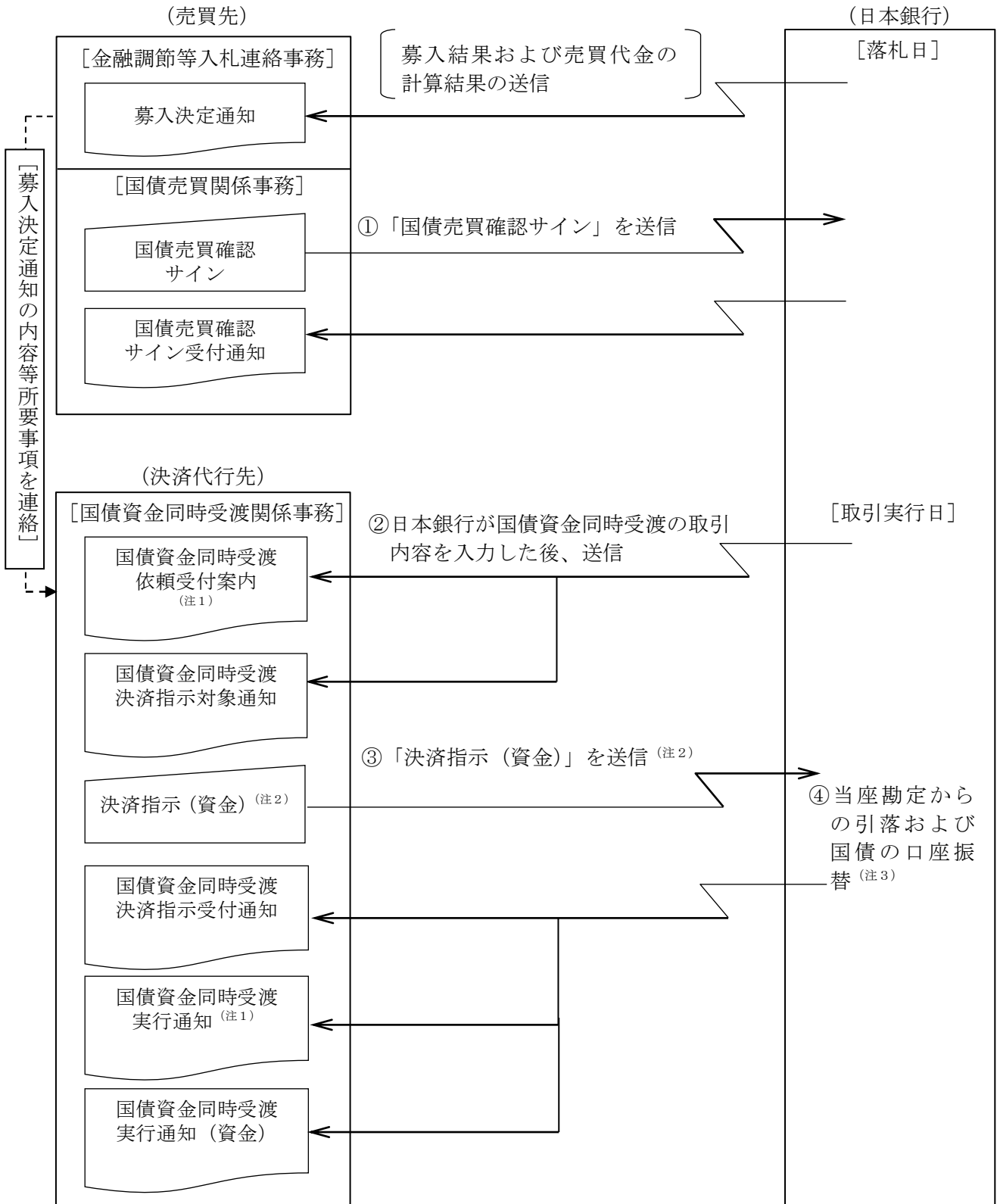


(注1) 日本銀行は、売買先の属する金融機関等の振決出力指定店舗に送信します。

(注2) 売買先は、国債資金同時受渡と同時に、同時担保受払を行う場合には、同時担保受払コードを入力します。

(注3) 日本銀行は、売買先から国債資金同時受渡と同時に同時担保受払の依頼を受けた場合には、担保の差入および当座勘定からの引落を行います。

b. 売買先が決済代行先に国債の受払等にかかる事務を委託する場合



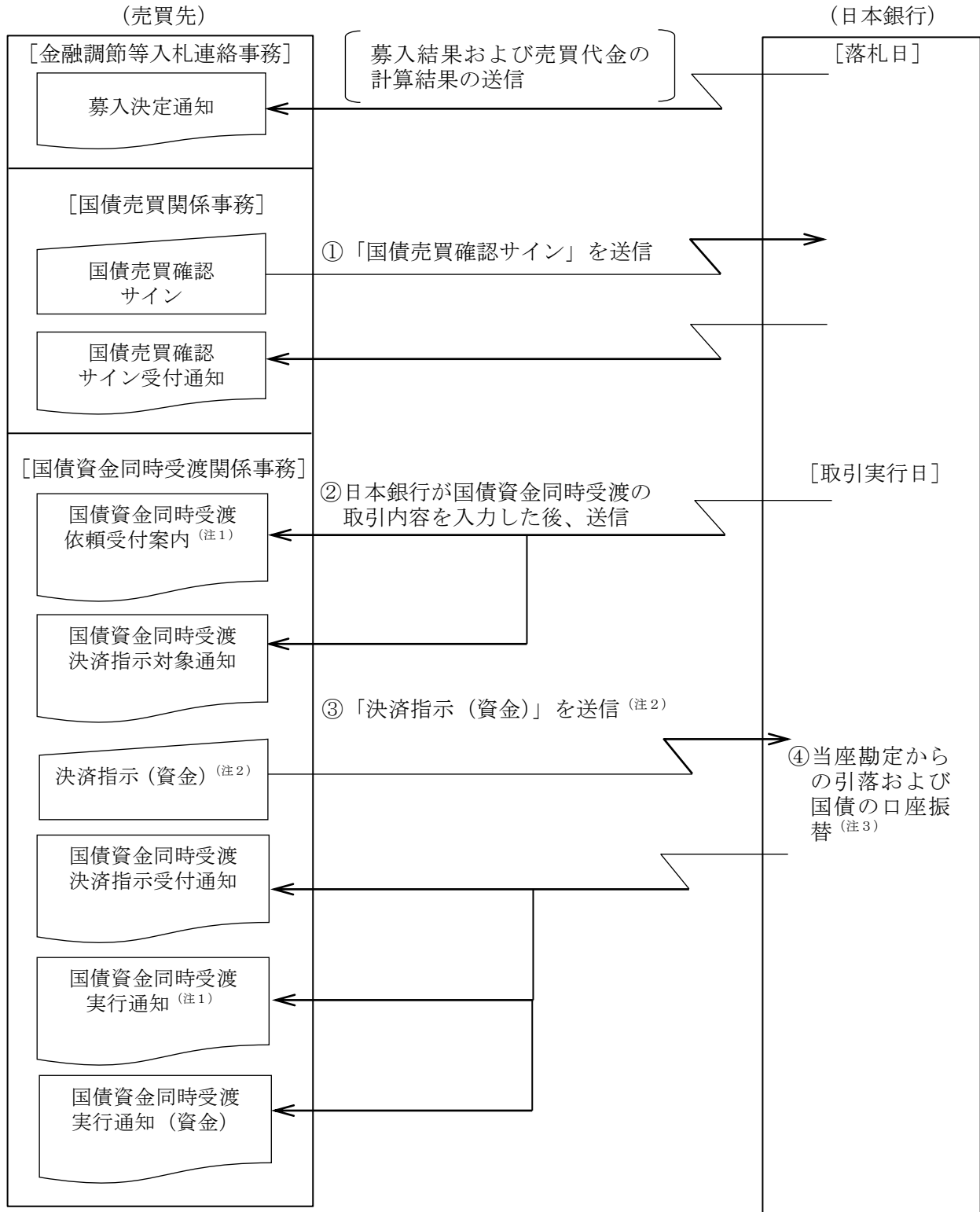
(注1) 日本銀行は、決済代行先の属する金融機関等の振決出力指定店舗に送信します。

(注2) 決済代行先は、国債資金同時受渡と同時に、同時担保受払を行う場合には、同時担保受払コードを入力します。

(注3) 日本銀行は、決済代行先から国債資金同時受渡と同時に同時担保受払の依頼を受けた場合には、担保の差入および当座勘定からの引落を行います。

○ 第1編IV. 1. (1) イ. (イ) および (ロ) を次のとおり改める (全面改正)。

(イ) 売買先が決済代行先に国債の受払等にかかる事務を委託しない場合

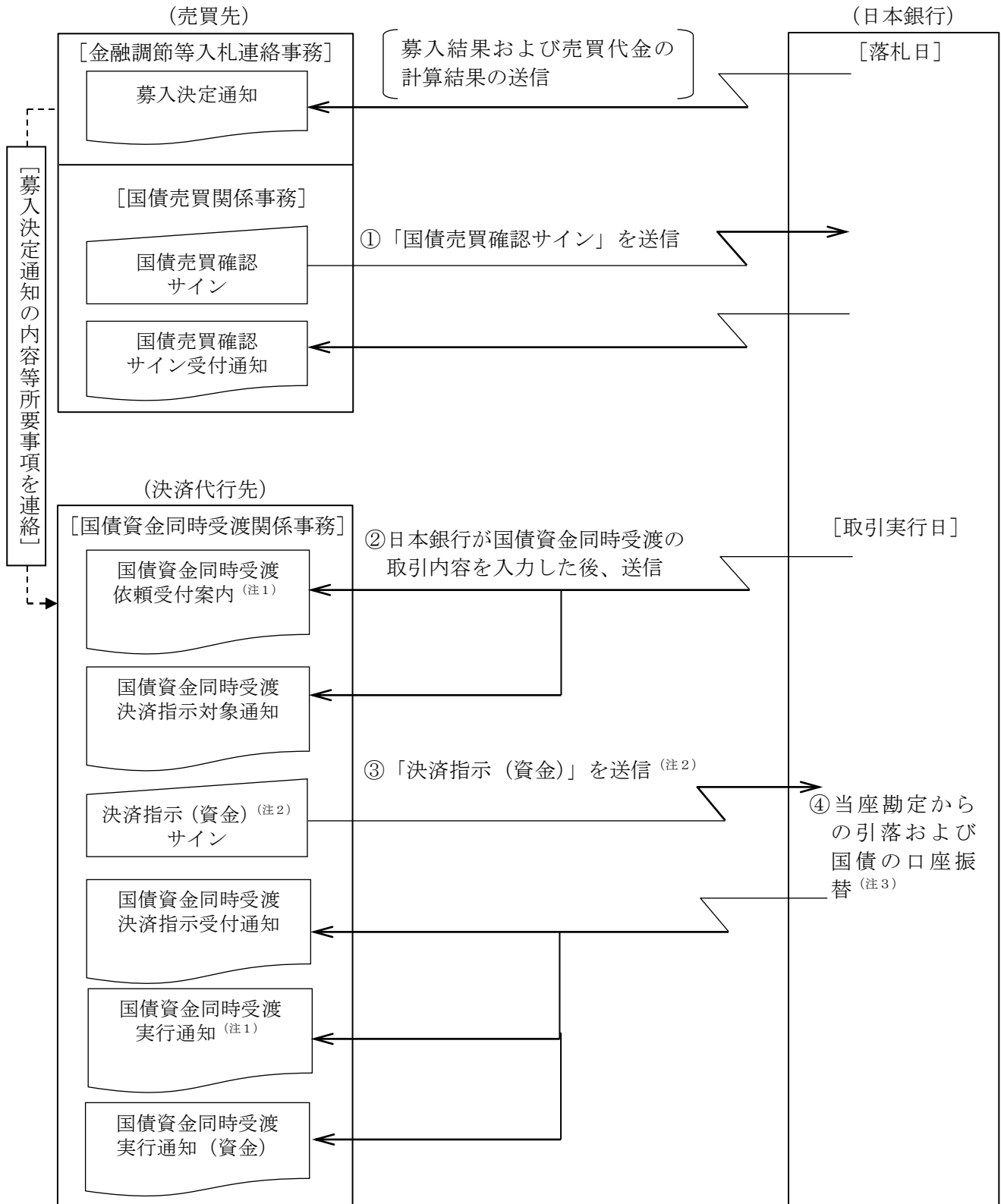


(注1) 日本銀行は、売買先の属する金融機関等の振決出力指定店舗に送信します。

(注2) 売買先は、国債資金同時受渡と同時に、同時担保受払を行う場合には、同時担保受払コードを入力します。

(注3) 日本銀行は、売買先から国債資金同時受渡と同時に同時担保受払の依頼を受けた場合には、担保の差入および当座勘定からの引落を行います。

(ロ) 売買先が決済代行先に国債の受払等にかかる事務を委託する場合



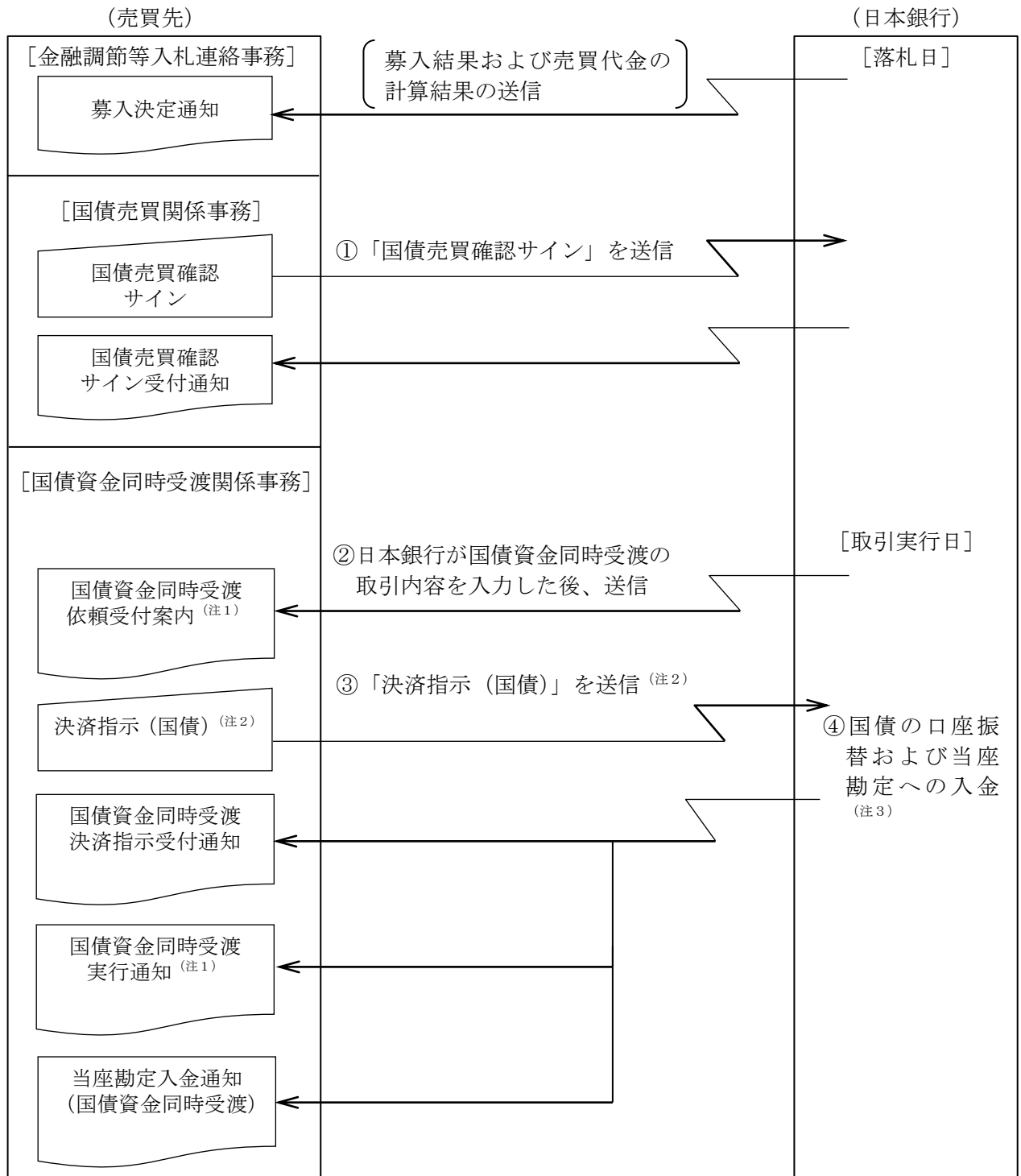
(注1) 日本銀行は、決済代行先の属する金融機関等の振決出力指定店舗に送信します。

(注2) 決済代行先は、国債資金同時受渡と同時に、同時担保受払を行う場合には、同時担保受払コードを入力します。

(注3) 日本銀行は、決済代行先から国債資金同時受渡と同時に同時担保受払の依頼を受けた場合には、担保の差入および当座勘定からの引落を行います。

○ 第1編V. 1. (1) および(2)を次のとおり改める(全面改正)。

(1) 売買先が決済代行先に国債の受払等にかかる事務を委託しない場合

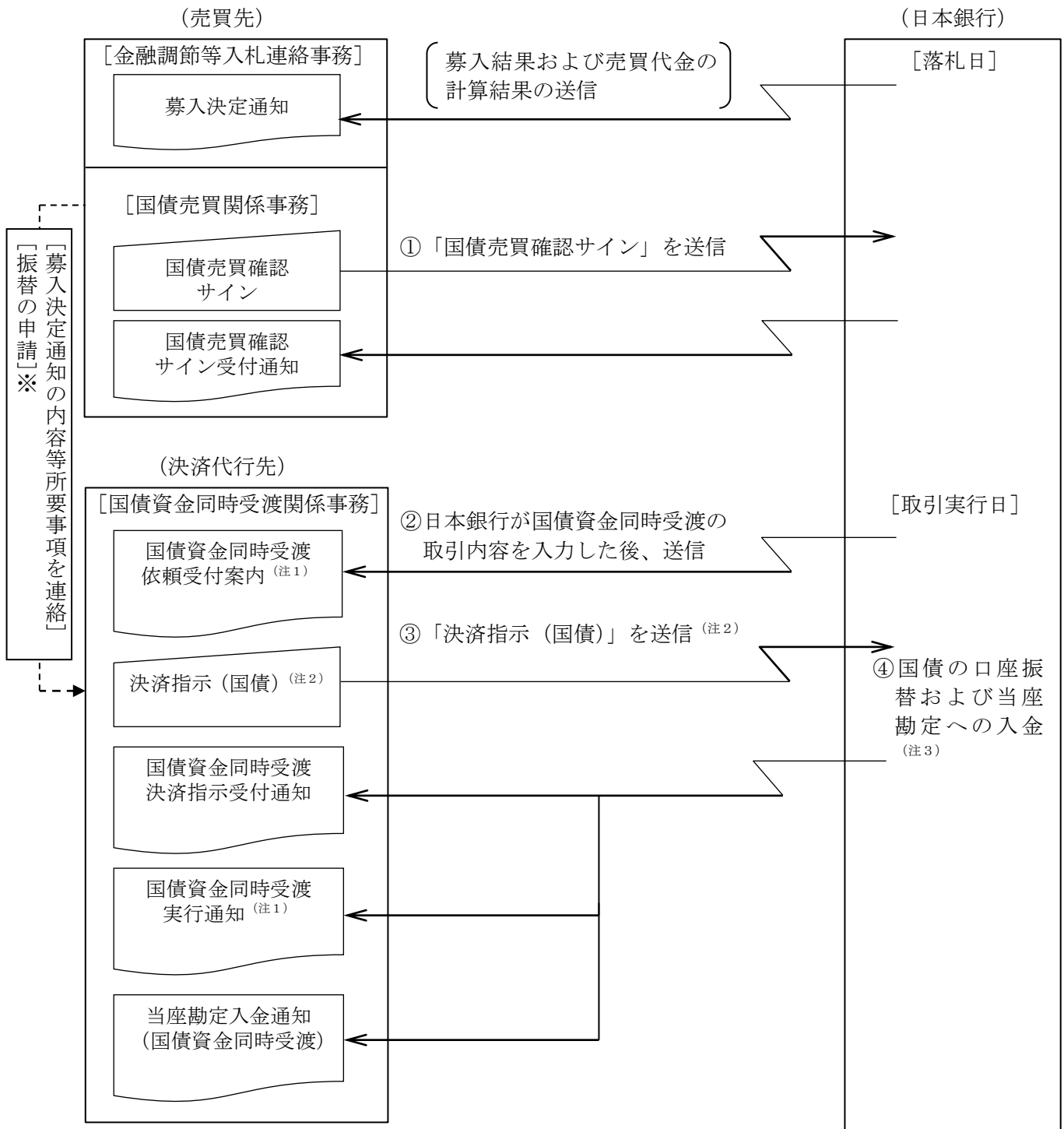


(注1) 日本銀行は、売買先の属する金融機関等の振決出力指定店舗に送信します。

(注2) 売買先は、国債資金同時受渡と同時に、同時担保受払を行う場合には、同時担保受払コードを入力します。

(注3) 日本銀行は、売買先から国債資金同時受渡と同時に同時担保受払の依頼を受けた場合には、担保の返戻および当座勘定への入金を行います。

(2) 売買先が決済代行先に国債の受払等にかかる事務を委託する場合



(注1) 日本銀行は、決済代行先の属する金融機関等の振決出力指定店舗に送信します。

(注2) 決済代行先は、国債資金同時受渡と同時に、同時担保受払を行う場合には、同時担保受払コードを入力します。

(注3) 日本銀行は、決済代行先から国債資金同時受渡と同時に同時担保受払の依頼を受けた場合には、担保の返戻および当座勘定への入金を行います。

※ 国債の受払口座の代行決済口座区分として預り口を申出ている場合に行う必要があります。

○ 第4編第2号書式の別紙を次のとおり改める(全面改正)。

※

2. 再売却(注2)

※業務処理区分	425207 (国債条件付売買明細)
① ※取引実行者	日本銀行: 1
② ※売買等種類	売却: 2
③ ※純与信額算入要否	否: 0
④ ※売買価格算出比率要否	要: 1
⑤ ※銘柄差替可否	否: 0
⑥ ※現先区分	対政府以外: 2
⑦ 売却日	
⑧ 買戻日	
⑨ 対象先(コード7桁)	
⑩ 決済先(コード7桁)	
⑪ 額面金額合計(百万円)	

(425207)

※作成者	※再発者	※責任者	※送信権限者
------	------	------	--------

※業務処理区分	215301(入金)
① ※摘要	120(国債売買)
② ※入金額合計	円
③ ※※入金先(コード7桁)	

(215301)

※作成者	※再発者	※責任者	※送信権限者
------	------	------	--------

※業務処理区分	215311(引落)
① ※摘要	120(国債売買)
② ※引落額合計	円
③ ※※引落先(コード7桁)	

(215311)

※作成者	※再発者	※責任者	※送信権限者
------	------	------	--------

3. 再売却代金差額

再売却番号	⑫ 期間利回り (%) (注3)	⑬⑮	⑭⑯	⑮ 額面金額 (百万円)	⑮ 運動係数 (注6)
		売却価格(円) 売却代金(円)c	買戻価格(円) 買戻代金(円)		
1					
2					
3					
4					
5					
6					
7					
8					
9					
10					

(425204)

※作成者	※再発者	※責任者	※送信権限者
------	------	------	--------

再売却番号	b-c (注4)
1	
2	
3	
4	
5	
6	
7	
8	
9	
10	
当座勘定入金・引落 (-)額 (注5)	

※当座勘定取引通番

※業務処理区分	425204 (国債売買実行(非連動))
① ※取引実行日	
② ※取引通番	
③ ※対象先(コード7桁)	

(注)

- 再売却の対象となる日銀国債売現先(国債補完供給)の明細を記入する。
- 再売却における売却対象銘柄は、再売却番号毎に、再売却の対象となる日銀国債売現先(国債補完供給)において買戻す国債の銘柄と同じものとする。
- 再売却番号毎に、誘導目標金利から3パーセントを差し引いた値または零のいずれか低い方の利回りを記入する。ただし、再売却の対象となる日銀国債売現先(国債補完供給)における期間利回りがこれらを下回る場合には、その期間利回りを記入する。
- 再売却番号毎に、再売却の対象となる日銀国債売現先(国債補完供給)における買戻代金と再売却における売却代金との差額を記入する。
- この場合において、再売却における売却代金の金額が再売却の対象となる日銀国債売現先(国債補完供給)における買戻代金の金額を上回る場合には、金額の冒頭に符号「-」を付す。
- 再売却番号毎に再売却の対象となる日銀国債売現先(国債補完供給)における買戻代金の金額から、再売却における売却代金の金額を差し引いた金額の合計額を記入する。
- 物価連動国債以外の場合には、記入不要。
- ※ 日本銀行記入欄
- ※※ 日本銀行記入欄(決済先が決済代先行である場合には、入金先または引落先は決済代先行とする。)

○ [参考] 2. (1) ハ. (ハ) を横線のとおり改める。

(ハ) 物価連動国債

$$\text{買入代金}^{(注1)} = \text{買入価額}^{(注2)} + \text{経過利子}$$

ただし経過利子については、以下のとおり計算を行う。

a. 利子経過日数^(注3) < (365 / 年間利払回数) の場合

$$\text{経過利子} = \left[\frac{\text{表面利率}^{(注4)} (\%) \times \text{利子経過日数}^{(注3)}}{365} \right] \times \frac{\text{額面金額}^{(注5)}}{100} \times \text{連動係数}^{(注6)}$$

b. 利子経過日数^(注3) ≥ (365 / 年間利払回数) の場合

$$\text{経過利子} = \text{表面利率}^{(注4)} (\%) \div \text{年間利払回数} \times \frac{\text{額面金額}}{100} \times \text{連動係数}^{(注6)}$$

(注1) }
∫ } 略 (不変)
(注5) }

(注6) 取引実行日における連動係数とします。

○ [参考] 2. (2) ハ. (ロ) を横線のとおり改める。

(ロ) 日銀国債売現先

a. 物価連動国債以外

$$\text{個別与信額}^{(注1)} = \left[\text{時価 (額面 100 円当り)}^{(注4)} \times \frac{\text{額面金額}}{100} \right]^{(注5)}$$

— 買戻代金^(注2) × 時価売買価格比率^(注3)

b. 物価連動国債

$$\text{個別与信額}^{(注1)} = \left[\text{時価 (額面 100 円当り)}^{(注4)} \times \frac{\text{額面金額}}{100} \times \text{連動係数}^{(注6)} \right]^{(注5)}$$

— 買戻代金^(注2) × 時価売買価格比率^(注3)

(注 1) }
∫ } 略 (不变)
(注 6) }