

日銀市第35号
平成30年3月15日

金融調節等入札連絡事務についての

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（金融調節等
入札連絡事務）」の一部改正に関する件

日本銀行では、国債売買等^(注)にかかる金融調節等入札連絡事務において用いる基準利回りまたは基準価格について、日本銀行が入札の通知を行う日の前営業日に、日本銀行が入札の通知を行う日付で日本証券業協会が発表する公社債店頭売買参考統計値表における平均値の単利利回りまたは単価（以下「売参値」といいます。）としています。

（注）国債売買、国庫短期証券売買、財融資金国債買入および国整基金国債買入をいいます。

今般、売参値が発表されない場合の取扱いを明確化する観点から、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。概要については（参考）をご確認ください。

(参考) 売参値が発表されない場合の対応

対象国債	発生事象	対応
利付国債 ^(注1) ・ 国庫短期証券	<u>全銘柄</u> の売参値が発表されない場合	入札日の <u>前営業日付</u> の売参値を用いる ^(注2)
	<u>一部銘柄</u> の売参値が発表されない場合	所定の方法により算出された <u>推計時価</u> を用いる ^(注3)
物価連動国債・ 変動利付国債	<u>全銘柄</u> または <u>一部銘柄</u> の売参値が発表されない場合	入札日の <u>前営業日付</u> の売参値を用いる ^(注2)

(注1) 物価連動国債および変動利付国債を除きます。

(注2) 入札日の前営業日付の売参値が発表されていない場合には、直近に発表された売参値を用います。

(注3) 詳細は、本件による改正後の「日本銀行金融ネットワークシステム利用細則（金融調節等入札連絡事務）」第1編6.(3)①ロ、をご参照ください。

以 上

「日本銀行金融ネットワークシステム利用細則（金融調節等入札連絡事務）」
中一部改正

○ 第1編6.（3）および（4）を横線のとおり改める。

（3）日銀国債買入（利回り入札）、日銀国債買入（固定利回り）、日銀国債売却、日銀国庫短期証券買入、日銀国庫短期証券売却、財融資金国債買入および国整基金国債買入（利回り入札）の基準利回り

① 一の営業日における一の銘柄の基準利回りは、日本銀行が入札の通知を行う日の前営業日に、日本証券業協会が日本銀行が入札の通知を行う日付で発表する公社債店頭売買参考統計値表におけるその銘柄の平均値の単利利回りとします。ただし、当該単利利回りが無い銘柄（以下①において「対象銘柄」といいます。）の基準利回りについては、次のとおりとします。

イ、日本銀行が入札の通知を行う日付の公社債店頭売買参考統計値表が、全銘柄の利付国債（変動利付国債および物価連動国債を除きます。以下①において同じです。）および国庫短期証券について発表されない場合

日本証券業協会が日本銀行が入札の通知を行う日の前営業日付で発表する公社債店頭売買参考統計値表における対象銘柄の平均値の単利利回り（当該単利利回りが無い場合には、日本証券業協会が直近の日付で発表する対象銘柄の平均値の単利利回り）を、当該銘柄の基準利回りとします。

ロ、日本銀行が入札の通知を行う日付の公社債店頭売買参考統計値表が、一部銘柄の利付国債または国庫短期証券について発表されない場合

日本証券業協会が日本銀行が入札の通知を行う日付で発表する公社債店頭売買参考統計値表における次の基準により選定した銘柄（以下「利回参照銘柄」といいます。）の平均値の単利利回りを、対象銘柄の基準利回りとします。

なお、利回参照銘柄は、利付国債または国庫短期証券の別にそれぞれ選定します。

（イ）償還期日が同じ銘柄（ただし、当該銘柄が複数存在する場合には、利回りが最も高い銘柄）

（ロ）（イ）の銘柄が存在しない場合には、償還期日が最も近い銘柄

（ハ）（ロ）の銘柄が複数存在する場合には、償還期日が遅く到来する銘柄（た

だし、当該銘柄が複数存在する場合には、利回りが最も高い銘柄)

② 日本銀行が①によることが適当でないと判断した場合には、日本銀行が別途通知する利回りを基準利回りとします。

(4) 日銀国債買入（価格入札）、国整基金国債買入（価格入札）および国整基金国債買入（追加入札）の基準価格

一の営業日における一の銘柄の基準価格は、日本銀行が入札の通知を行う日の前営業日に、日本証券業協会が日本銀行が入札の通知を行う日付で発表する公社債店頭売買参考統計値表におけるその銘柄の平均値の単価とします。ただし、当該単価がない銘柄の基準価格については、日本証券業協会が日本銀行が入札の通知を行う日の前営業日付で発表する公社債店頭売買参考統計値表における当該銘柄の平均値の単価（当該単価がない場合には、日本証券業協会が直近の日付で発表する当該銘柄の平均値の単価）とします。

なお、日本銀行がこれらによることが適当でないと判断した場合には、日本銀行が別途通知する価格を基準価格とします。

○ 第1編7.(1)の出力帳票を横線のとおり改める。

(取引種類が日銀国債買入(利回り入札)、日銀国債買入(固定利回り)、日銀国債買入(価格入札)、日銀国債売却、日銀国庫短期証券買入、日銀国庫短期証券売却、財融資金国債買入、国整基金国債買入(利回り入札)、国整基金国債買入(価格入札)または国整基金国債買入(追加入札)の場合)

(4111-00203、4111-00204)

日本銀行金融市場局

入札要項通知

以下のとおり入札要項を通知します。応募締切時刻までに応募額等を通知して下さい。

入札要項番号	—	
入札実施決定者	—	_____
取引種類	_____	_____
予定総額	_____	— (注1) (注2)
応募限度額	_____	(注3) — (注1)
応募締切時刻	本日 一時一分	
スタート日	_____	
備考	_____	

S

} (注4) (注5)

対象銘柄情報

入札要項番号：—	対象銘柄 (注5.6)	基準利回り等	予定額 — (注1)	限度額 — (注1)
	(注6.7)	(注5) (注7.8)	(注8.9)	(注8.9)
	S S	S	S	S

(注1) 略(不変)

(注2) 略(不変)

(注3) 略(不変)

(注4) 日本銀行からの連絡事項がある場合には、その連絡事項が表示されます。なお、取引種類が日銀国債買入(利回り入札)または日銀国債買入(固定利回り)の場合には、買入対象銘柄に関する残存期間による区分についての連絡事項が表示されます。取引種類が日銀国債買入(利回り入札)の場合において、日本銀行が希望利回較差の下限を設定するときには当該希望利回較差の下限が表示されます。取引種類が日銀国債買入(固

定利回り) の場合には、基準利回りに加える値が表示されます。

また、6. (3) ①ただし書もしくは②または(4)ただし書もしくはなお書きの場合には、基準利回りまたは基準価格として適用される単利利回りまたは単価についての連絡事項が表示されます。

(注5) 6. (3) ①ただし書もしくは②または(4)ただし書もしくはなお書きの場合には、「備考」欄または「基準利回り等」欄に、基準利回りまたは基準価格として適用される単利利回りまたは単価が表示されます。

(注~~5~~6) }
└ 略 (不変)
(注~~8~~9) }

以下略 (不変)

○ 第1編の2 1. (4) を横線のとおり改める。

(4) 入札の通知を行う日の前営業日に当該通知を行う日付で日本証券業協会が発表する公社債店頭売買参考統計値表に平均値の単利利回りが掲載されている銘柄のうち、当該入札の通知において日本銀行が通知すること。

○ 第1編の2 1の2. (4) を横線のとおり改める。

(4) 入札の通知を行う日の前営業日に当該通知を行う日付で日本証券業協会が発表する公社債店頭売買参考統計値表に平均値の単価が掲載されている銘柄のうち、当該入札の通知において日本銀行が通知すること。

○ 第1編の2 3. (3) を横線のとおり改める。

(3) 入札の通知を行う日の前営業日に当該通知を行う日付で日本証券業協会が発表する公社債店頭売買参考統計値表に平均値の単利利回りが掲載されている銘柄のうち、当該入札の通知において日本銀行が通知すること。

○ 第1編の2 5. を横線のとおり改める。

5. 日銀国債買現先

次に掲げる事項を総て充たす国債。

- (1) }
└ } 略(不変)
(5) }

~~(6) 利付国債である場合には、入札の通知を行う日の前営業日に当該通知を行う日付で日本証券業協会が発表する公社債店頭売買参考統計値表に平均値の単利利回りまたは単価が掲載されている銘柄のうち、当該通知において日本銀行が通知するものであること。~~

~~(7-6) 国庫短期証券である場合には、入札の通知において日本銀行が通知するものであること。~~

~~(8-7) 略(不変)~~

~~(9-8) 略(不変)~~

~~(10-9) 略(不変)~~

○ 第1編の2 10. (4) を横線のとおり改める。

~~(4) 入札の通知を行う日の前営業日に当該通知を行う日付で日本証券業協会が発表する公社債店頭売買参考統計値表に平均値の単利利回りが掲載されている銘柄のうち、当該入札の通知において日本銀行が通知するものであること。~~

○ 第1編の2 11. (4) を横線のとおり改める。

~~(4) 入札の通知を行う日の前営業日に当該通知を行う日付で日本証券業協会が発表する公社債店頭売買参考統計値表に平均値の単価が掲載されている銘柄のうち(ただし、変動利付国債の場合には、この条件を充たすことを要しない)、当該入札の通知において日本銀行が通知するものであること。~~

○ 第1編の2 13.(3)を横線のとおり改める。

~~(3) 入札の通知を行う日の前営業日に当該通知を行う日付で日本証券業協会が発表する公社債店頭売買参考統計値表に平均値の単利利回りが掲載されている銘柄のうち、当該入札の通知において日本銀行が通知するものであること。~~

○ 第1編の2 14.(3)を横線のとおり改める。

~~(3) 入札の通知を行う日の前営業日に当該通知を行う日付で日本証券業協会が発表する公社債店頭売買参考統計値表に平均値の単価が掲載されている銘柄のうち、当該入札の通知において日本銀行が通知するものであること。~~