

日 銀 市 第 1 8 8 号
2 0 1 8 年 1 0 月 5 日

担保差入金融機関等 御中

日 本 銀 行

適格担保の掛目の一部変更および
共通担保の時価反映タイミング等の短縮化に関する件

1. 適格担保の掛目の一部変更について

日本銀行では、適格担保^(注)の掛目の一部を2018年11月29日から変更することとしましたので、通知します。変更後の掛目は、変更日の業務開始時から適用します。詳細は、日本銀行のホームページ (<http://www.boj.or.jp>) に掲載している本日付の「適格担保の担保価格」の一部改正等についてをご参照ください。

(注) 「適格担保取扱基本要領」、「適格外国債券担保取扱要領」、「被災地企業等債務にかかる担保の適格性判定等に関する特則」、「平成二十八年熊本地震にかかる被災地企業等債務に関する担保の適格性判定等に関する特則」、「米ドル建の企業に対する証書貸付債権にかかる担保の適格性判定等に関する特則」および「適格住宅ローン債権信託受益権担保取扱要領」に基づく適格担保を指します。

2. 共通担保の時価反映タイミング等の短縮化について

先般、「担保に関する細則」の一部改正に関する件(2018年8月15日付日銀市第162号)でお知らせしました、共通担保の時価反映タイミング等の短縮化に伴う規程改正の実施日も2018年11月29日とします。今般、担保差入金融機関等において所要の準備や円滑な移行を行っていただく観点から、本件短縮化にかかる実務上の留意点を別紙のとおり取り纏めましたので、お知らせします。

以 上

共通担保の時価反映タイミング等の短縮化にかかる実務上の留意点

- 共通担保の時価反映タイミング等の短縮化に伴う規程改正の実施日は、本年 11/29 日（木）とし、同日以降に日本銀行が日本銀行金融ネットワークシステム（以下「日銀ネット」といいます。）に登録する時価について、その反映タイミングを短縮します。
- すなわち、現在は、「時価変更日」^(注1)の 4 営業日後が「時価適用日」^(注2)となっていますが、本年 11/29 日（木）以降は、「時価変更日」の 3 営業日後が「時価適用日」となります。

（注 1）日本銀行が基準となる市場相場に基づく時価を日銀ネットに登録する日をいいます。

（注 2）共通担保にかかる担保価額の算出において日銀ネットに登録された時価が適用される日をいいます。

- 担保差入金融機関等においては、本件短縮化の実施に際して、次の（1）から（3）までに記載する留意点を踏まえたうえで、適切に担保価額の管理を行ってください。

<本件に関する照会先>

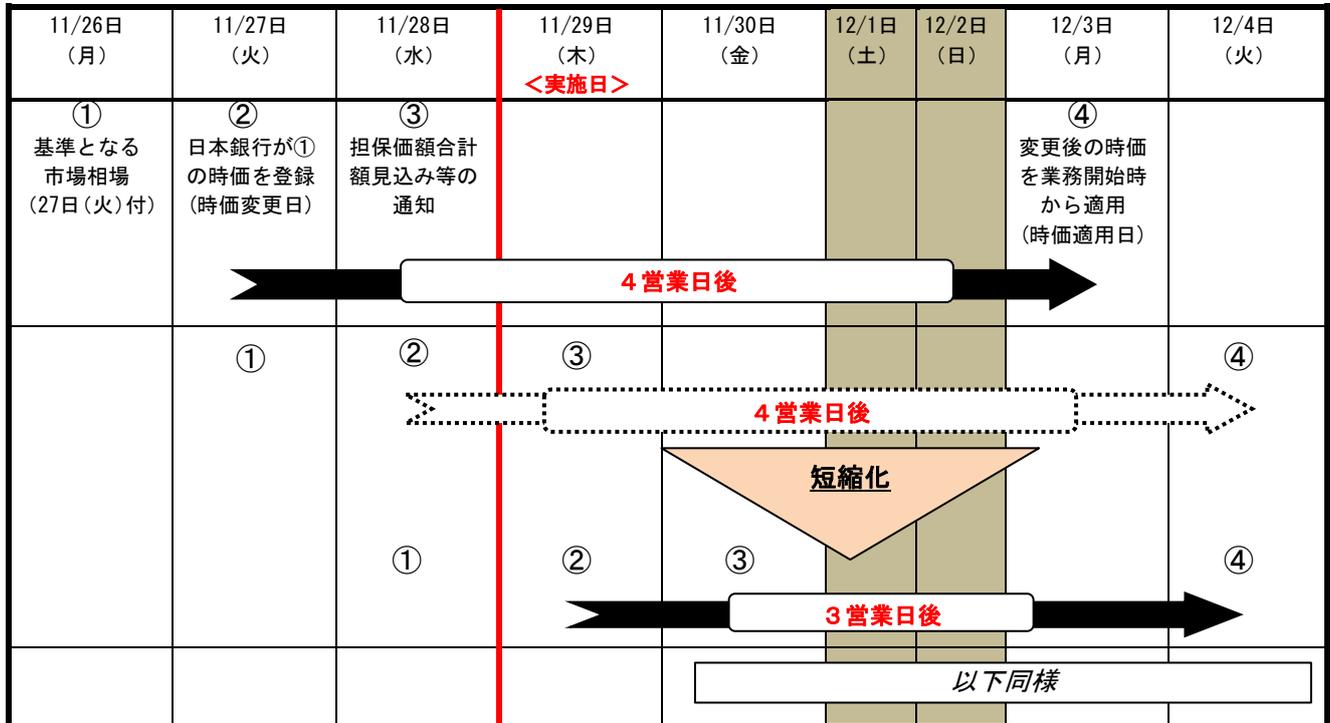
全般：日本銀行金融市場局（03-3277-0055）

担保価額管理事務関連：日本銀行業務局（03-3277-1307）

日銀ネットの機能・仕様関連：日本銀行システム情報局（042-351-1449）

(1) 11/29日(木)における担保価額合計額等の見込み通知の取扱い

▼ 図1：本件短縮化前後の時価の反映スケジュール



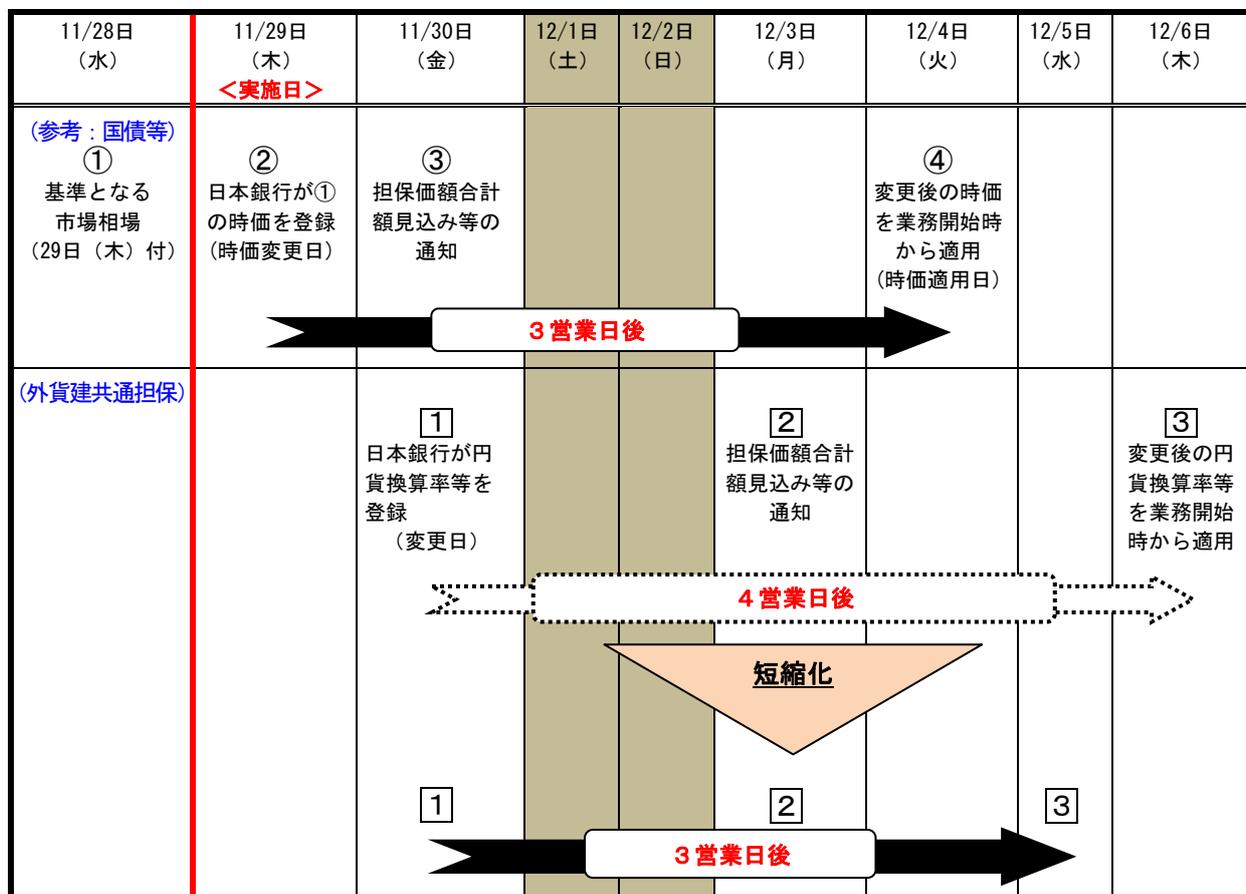
- 日本銀行では、時価変更日（図1のスケジュールの②）の翌営業日（同③）に、日銀ネットを利用している担保差入金融機関等の担保出力指定店舗に対して、時価適用日（同④）における当該金融機関等の担保価額合計額および担保余裕額の見込みを「担保不足・余裕等通知」（帳票コード：5250-00500）により通知しております（注3）。

（注3）日銀ネットを利用していない担保差入金融機関等に対しては、担保不足が生じることが見込まれる場合に限り、日本銀行から当該金融機関等の担保交付指定店舗に対して連絡する取扱いとしています。

- 本件短縮化にあたり、日銀ネットのシステム仕様上、11/29日(木)および11/30日(金)においては、いずれも12/4日(火)における担保価額合計額等の見込みが記載された通知が出力されますが、11/29日(木)に出力される通知は、本件短縮化を勘案しておらず、正当な計数が記載されません。
- 11/30日(金)に出力される通知が、12/4日(火)における担保価額合計額等の見込みが記載されたものとなりますので、担保価額の管理にあたっては、11/29日(木)に出力される通知は参照しないようにして下さい。

(2) 外貨建共通担保にかかる円貨換算率等の反映タイミングの取扱い

▼ 図2：本件短縮化前後の円貨換算率等の反映スケジュール



- ▶ 外貨建共通担保^(注4)にかかる担保価額については、原則として、毎週最終営業日の円貨換算率等^(注5)を使用して、1週間に1度変更しています。

(注4) 日本銀行に共通担保として差入れられている「外貨建外国債券」および「米ドル建の企業に対する証券貸付債権」をいいます。

(注5) 外貨建外国債券については円貨換算率および時価を指し、米ドル建の企業に対する証券貸付債権については円貨換算率を指します。

- ▶ 本件短縮化に伴い、11/30日(金)に登録された同日付の円貨換算率等は、12/5日(水)の担保価額合計額等の算出に反映されることになります。なお、12/5日(水)における担保価額合計額の見込みが記載された「担保不足・余裕等通知」が2回出力されることはありませんので、特段の留意は不要です。

(3) 日銀ネットによる時価等のデータファイル取得可能期間の短縮化

- 日銀ネットを利用している担保差入金融機関等は、日銀ネットの照会機能「時価・掛目一覧」(業務処理区分コード:514201)により、(a)時価、(b)物価連動国債の連動係数、(c)外貨建外国債券の円貨換算率、(d)担保掛目および(e)担保価額にかかるデータファイルを取得することができます。
- 11/29日(木)以降は、(a)から(e)までの項目にかかるデータファイルの取得可能期間は、これまでの「照会日当日からその3営業日後までの範囲内」から「照会日当日からその2営業日後までの範囲内」となります。

▼ 図3：本件短縮化前後の主要項目のデータファイル取得可能期間

照会日		11/28日(水)	11/29日(木) <実施日>	11/30日(金)	12/3日(月)
データファイルの取得可能期間		11/28日(水)～12/3日(月)	11/29日(木)～12/3日(月) ^(注)	11/30日(金)～12/4日(火)	12/3日(月)～12/5日(水)
出力項目の基準日等	担保価額	同上	同上	同上	同上
	適用時価	11/21日(水)付～11/27日(火)付	11/22日(木)付～11/27日(火)付	11/26日(月)・27日(火)・29日(木)付	11/27日(火)・29日(木)・30日(金)付
	適用円貨換算率	11/16日(金)・22日(木)付	11/22日(木)付	11/22日(木)付	11/22日(木)・30日(金)付
	担保掛目	11/28日(水)：見直し前 11/29日(木)～12/3日(月)：見直し後	見直し後	見直し後	見直し後

(注) 12/4日(火)のデータファイルを取得することは可能ですが、当該データは本件短縮化を勘案しておらず、正当な計数ではありませんので、担保価額の管理にあたって参照することのないようご注意ください。

以 上