

日 銀 市 第 7 2 号
2 0 1 9 年 5 月 2 3 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、国債補完供給の要件緩和措置を実施することに伴い、標記規程の一部を別紙のとおり改正し、本年6月10日から実施することとしましたので、通知します。

なお、とりわけ、上記実施日以後に国債補完供給の減額措置の申込が想定される先におかれては、「国債補完供給の取引権限者に関する証」（本改正後の本規程第3号書式）の提出のほか、所要の準備を実施日までに行って頂きますようお願い致します。

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

- 目次を横線のとおり改める。

目 次

略（不変）

第4編 書 式

第1号書式	確認サイン再入力許可請求書	4-1-1
第2号書式	再売却申込書	4-2-1
	別紙	
第3号書式	<u>国債補完供給の取引権限者に関する証</u>	<u>4-3-1</u>
第4号書式	<u>減額措置に関する願書</u>	<u>4-4-1</u>
	別紙	

- 第1編IV. 3. (1) イ. を横線のとおり改める。

イ. 減額措置の願出

①日本銀行への引渡が可能となるめどが立たない場合

売買先は、個別契約にかかる売却国債の全部または一部について国債残高不足により日本銀行への引渡が可能となるめどが立たない場合には、当該売却国債にかかる日本銀行による買戻額の全部または一部を減額する措置（以下「減額措置」といいます。）を願出することができます^(注1)。

減額措置を願出することが想定される売買先は、予め「国債補完供給の取引権限者に関する証」（第3号書式）を日本銀行金融市場局（市場調節課オペレーション企画グループ）に提出して下さい^(注2)。

(注1) 国庫短期証券を売却国債とする日銀国債売現先（国債補完

供給)については、2. (1)イ. (ロ)に定める再売却の上限回数まで再売却を受けている場合に限り、減額措置を願出することができます。

(注2) 減額措置を願出に当たっては、日本銀行金融市場オンライン(以下「市場オンライン」といいます。)におけるユーザーIDの登録等が必要となるため、余裕をもって手続を行って下さい。

売買先は、減額措置の願出を希望する日の前営業日の午後3時まで、日本銀行金融市場局(市場調節課オペレーション企画グループ)に電話により連絡し、その指示に従ってください。また、売買先は、減額措置の願出を行う日の原則として午前10時までに、願書(日本銀行が指定する書式に限ります。)を、予め日本銀行から通知を受けたパスワードを付したうえで、市場オンラインにより日本銀行金融市場局(市場調節課オペレーション企画グループ)に提出してください^(注)。市場オンラインの利用にあたっては、事前に日本銀行に提出した「国債補完供給の取引権限者に関する証」に記載の利用者に限定してください。

(注)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ている場合には、当該願書は申込人および決済代行者の連名で提出してください。

市場オンラインの障害その他の事情により、これが利用できない場合には、日本銀行金融市場局(市場調節課オペレーション企画グループ)の指示に従ってください。

②国債市場の流動性改善に資する場合

売買先は、個別契約にかかる売却国債(直近2限月の長期国債先物取引の受渡適格銘柄のうち最割安銘柄(チーペスト銘柄)または2番目に割安な銘柄(セカンド・チーペスト銘柄))であって、発行残高に占める日本銀行の保有割合が80%を超えるものに限り、)の全部について、当該売却国債にかかる日本銀行による買戻額の全部にかかる減額措置を願出することができます。

減額措置を願出することが想定される売買先は、予め「国債補完供給の取引権限者に関する証」を日本銀行金融市場局(市場調節課オペレーション企画グループ)に提出して下さい^(注)。

(注) 減額措置を願出に当たっては、市場オンラインにおけるユーザーIDの登録等が必要となるため、余裕をもって手続を行って下さい。

売買先は、減額措置の願出を行う日の午前10時までに、「減額措置に関する願書」(第4号書式)を、予め日本銀行から通知を受けたパスワードを付したうえで、市場オンラインにより日本銀行金融市場局(市場調節課オペレーション企画グループ)に提出してください。市場オンラインの利用にあたっては、事前に日本銀行金融市場局(市場調節課オペレーション企画グループ)に提出した「国債補完供給の取引権限者に関する証」に記載の利用者に限定してください。

これら①または②による減額措置の願出に当たっては、特に次の点に注意してください。

(イ) 減額措置の実行単位

略(不変)

(注) ①の場合に限ります。また、売買先は、売却国債の買戻額の一部について減額を認められた場合(以下「一部減額」といいます。)には、日本銀行の指示に従って、売却国債のうち日本銀行が買戻額の減額を認めた部分(以下「減額部分」といいます。)以外の部分にかかる売却国債(以下「減額後の売却国債」といいます。)の買戻にかかる処理を当日中に行う必要があります。

(ロ) 減額措置にかかる取引条件

a. 略(不変)

b. 減額措置手数料の支払

略(不変)

①日本銀行への引渡が可能となるめどが立たない場合

$$\begin{aligned} \text{減額措置手数料}^{(注1)} &= \text{売却国債にかかる売却代金}^{(注2)} \times \frac{\text{再売却の期間利回り}^{(注3)}}{100} \\ &\times \left[\frac{\text{再売却の上限回数}^{(注4)} \text{ まで再売却} \\ &\text{を受ける場合の再売却の利用日数} \quad \text{—再売却の利用日数}^{(注5)}}{365} \right] \end{aligned}$$

②国債市場の流動性改善に資する場合

$$\text{減額措置手数料}^{(注1)} = \text{売却国債にかかる売却代金}^{(注2)} \times \frac{\text{期間利回り}^{(注6)}}{100}$$

(注1) }
∫ } 略(不変)
(注5) }

(注6) 1か月物東京レポ・レート(日本証券業協会が作成および公表する東京レポ・レート(レファレンス先平均値)のうち、対象期間を1か月間とするものであり、減額措置の実施日午前11時時点のものをいう。)から0.25%を減じて12で除した数値(小数点以下第4位を四捨五入)と0%とのうち低い方の数値の絶対値を、期間利回りとします。ただし、当該1か月物東京レポ・レートについては、日本銀行は、予め売買先に連絡のうえ、金融市場の情勢等を勘案した別の数値とすることもあります。

~~e. その他~~

~~日本銀行は、相当の注意をもって願書の印影または署名と日本銀行に予め届出られている印鑑または署名鑑とが一致することを確認した場合には、当該願書の偽造、変造その他の事故があったために生じた損害について責任を負いません。~~

(ハ) 略(不変)

ロ. 減額措置の願出にかかる諾否の連絡

①日本銀行への引渡が可能となるめどが立たない場合

日本銀行は、イ. ①による減額措置の願出があった場合には、売買

先において売却国債の全部または一部について日本銀行への引渡が可能となるめどが立たないと認められること^(注)を確認し、その諾否（減額の範囲を含みます。）を決定します。日本銀行金融市場局（市場調節課オペレーション企画グループ）は、当該願出の諾否を決定した場合には、売買先に対し、市場オンラインにより速やかにその旨を連絡します。

日本銀行が願出を承諾した場合において、売買先が決済代行先に事務を委託しているときは、日本銀行の承諾の連絡後速やかに、当該決済代行先に対し、日本銀行が減額措置の願出を承諾したことおよびハ、に定める決済代行先の当座勘定への入金または引落が行われることを連絡して下さい。

（注）略（不変）

②国債市場の流動性改善に資する場合

日本銀行は、イ. ②による減額措置の願出があった場合には、当該願出がイ. ②に掲げる要件を満たす限りにおいて、原則として当該願出を承諾します。売買先は、日本銀行が午前 12 時までに当該願出について異議を申出ない限り、日本銀行がこれを承諾したものとみなして下さい。

日本銀行が午前 12 時までに異議を申出ない場合において、売買先が決済代行先に事務を委託しているときは、午前 12 時経過後速やかに、当該決済代行先に対し、日本銀行が減額措置の願出を承諾したことおよびハ、に定める決済代行先の当座勘定への入金または引落が行われることを連絡して下さい。

- 第 2 号書式の次に次の第 3 号書式を加える。

(第3号書式)

証

当方_____ ^(注1)において、国債買戻条件付売却（国債補完供給）にかかる減額措置についての日本銀行金融市場オンラインの利用にあたっては、下記に掲げる者に一切の行為を処理する権限を付与しました。

ついでには、当方はその利用を行うにあたっては、下記に掲げる者以外の者に電文を送信させません。

また、日本銀行が、電文を送信した利用先を識別するために利用先毎に予め指定された識別番号と、受信した電文の識別番号との一致を確認した場合には、当該電文に付された識別番号を指定された利用先が当該電文を送信したものとみなし、この場合において、電文の偽造または変造、利用先識別情報の不正使用その他の事故があったために生じた損害について、日本銀行が責任を負わないことについて、当方は異議を述べません。

記

(職名)

(氏名)

(職名)

(氏名)

年 月 日 ^(注2)

(登記印)



(金融機関等名)

(代表者) ^(注3)

日 本 銀 行 御 中

(注1) 金融機関等名を記載。

(注2) 提出日を記載。

(注3) 頭取、社長、理事長等の役職名を記載し、記名捺印または署名。

○ 第3号書式の次に次の第4号書式を加える。

(第4号書式)

日本銀行 御中

年 月 日

(注1)

(売買人)

減額措置に関する願書（国債市場の流動性改善に資する場合）

年 月 日に募入が決定し、年 月 日 を売却日、本日を買戻日、取引通番を _____ とする「日本銀行が補完供給を目的として行う国債の買戻条件付売却に関する基本約定」その他の日本銀行が定める規則等に基づく国債の買戻条件付売却（国債補完供給）において、下記に掲げるとおり、当方が貴行に売戻す国債（以下「売戻国債」といいます。）の全部について、別紙のとおり売戻額を減額して頂きたいと願います。

記

当方は、当該売戻国債が、直近2限月の長期国債先物取引の受渡適格銘柄のうち最割安銘柄（チーペスト銘柄）または2番目に割安な銘柄（セカンド・チーペスト銘柄）であって、発行残高に占める貴行の保有割合が80%を超えるものに該当することを確認しています。

この場合において、貴行が負う売戻額を減額した売戻国債の売戻代金の支払債務および当方が負う当該売戻国債の引渡債務の取扱いに関しては、「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）」第1編IV. 3. (1)に基づく支払債務に置き換えられたうえ、当該規定に従って、それぞれの支払債務を差引計算することに同意します。これにより差引計算された差額を当方^(注2)名義の当座勘定に入金または引落を願いますとともに、当該規定に基づき当方が負う減額措置手数料の金額を当方^(注2)名義の当座勘定から引落を願います。

当方が _____^(注3) と連名で提出した「日本銀行が補完供給を目的として行う国債の買戻条件付売却における代行決済に関する特約書」において決済代行先として指定した _____^(注4)（金融機関等店舗コード： _____^(注5)）を決済先としてお取扱い頂きたいと願います。^(注6)

本件につきましては、貴行の指示に一切従います。また、本件願出をご承諾頂いた場合に生じる損害については、これをすべて当方が負担し、決して貴行にご迷惑をおかけしません。

以 上

(注1) 代表者またはその者から国債買戻条件付売却（国債補完供給）に関する権限を付与された者の役職名を記載する。

(注2) 「日本銀行が補完供給を目的として行う国債の買戻条件付売却における代行決済に関する特約書」を提出している場合には、「決済先」に修正する。

(注3) 「日本銀行が補完供給を目的として行う国債の買戻条件付売却における代行決済に関する特約書」において決済代行者として指定した金融機関の名称を記載する。

(注4) 「日本銀行が補完供給を目的として行う国債の買戻条件付売却における代行決済に関する特約書」において決済代行先として指定した金融機関の店舗の名称を記載する。

(注5) (注4) で記載した金融機関の店舗の金融機関等店舗コードを記載する。

(注6) 「日本銀行が補完供給を目的として行う国債の買戻条件付売却における代行決済に関する特約書」を提出していない場合には、本段落を削除する。

(売買先) ※ _____ (決済代行先) ※ _____

(減額前売買国債明細)

取引種類	日銀国債売現先 (国債補完供給) (買戻)
------	-----------------------

業務処理区分	425205 (国債売買データ取消)
① ※取引実行日	
② ※取引通番	
③ ※対象先 (コード7桁)	
④ 額面金額 (千円) ^(注1)	

業務処理区分	755102 (国債資金同時受渡依頼取消)
--------	--------------------------

(自動入力)

② ◆ 受付番号 ^(注2)	④ ◆ 銘柄		◆ 期間利回り (%) b	◆ 売却価格 (円) f	◆ 買戻価格 (円) c	◆ 額面金額 (千円) e
	◆ 銘柄コード			◆ 売却代金 (円) a	◆ 買戻代金 (円) d	

(425205)

※ 作成者	※ 再鑑者	※ 責任者
-------	-------	-------

※ 送信権限者

(755102)

※ 作成者	※ 再鑑者	※ 責任者
-------	-------	-------

※ 送信権限者

(減額後売買国債明細)

業務処理区分	425207 (国債条件付売買明細)
① ※取引実行者	
② ※売買等種類	
③ ※純与信額算入要否	
④ ※売買価格算出比率要否	
⑤ ※銘柄差替可否	
⑥ ※現先区分	
⑦ ※買入日または売却日	
⑧ ※売戻日または買戻日	
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)	

業務処理区分	425202 (国債売買データ連動 (国債資金同時受渡))
① ※取引実行日	
② ※取引通番	
③ ※対象先 (コード7桁)	

⑫ (自動入力)	⑬ (自動入力)	⑭⑯ (fは自動入力)	⑰⑱ (cは自動入力)	⑲
銘柄	期間利回り	売却価格 (円) f	買戻価格 (円) c	額面金額
銘柄コード	(%) b	売却代金 (円) h	買戻代金 (円) i	(百万円) g

(自動計算)

国債買戻条件付売却費用・ 収益 (-) (円)
$j = i - h$

(425207)

※ 作成者	※ 再鑑者	※ 責任者
----------	----------	----------

※ 送信権限者

(425202)

※ 作成者	※ 再鑑者	※ 責任者
----------	----------	----------

※ 送信権限者

(減額部分)

(1) 国債買戻条件付売却勘定

業務処理区分	425207 (国債条件付売買明細)
① ※取引実行者	
② ※売買等種類	
③ ※純与信額算入要否	
④ ※売買価格算出比率要否	
⑤ ※銘柄差替可否	
⑥ ※現先区分	
⑦ ※買入日または売却日	
⑧ ※売戻日または買戻日	
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)	

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)	

⑫ (自動入力) ⑬ (自動入力) ⑭⑮ (自動計算) ⑯⑰ (自動計算) ⑱ (自動計算)

銘柄 銘柄コード	期間利回り (%) b	売却価格 (円) f	買戻価格 (円) e	額面金額 (百万円) e - g
		売却代金 (円) k = a - h	買戻代金 (円) l = d - i	

(自動計算)

国債買戻条件付売却費用・ 収益 (-) (円) m = l - k

(425207)

※ 作成者	※ 再鑑者	※ 責任者

※ 送信権限者

(425204)

※ 作成者	※ 再鑑者	※ 責任者

※ 送信権限者

(2) 国債

業務処理区分	425208 (国債充買代金計算)
① ※取引実行者	
② ※充買等種類	
③ ※対象先 (コード7桁)	
④ ※決済先 (コード7桁)	
⑤ ※額面金額合計 (千円)	

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

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

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

⑥ (自動入力)	⑦ (自動計算)	⑧			
銘柄	額面金額 (千円)	売却価格 (円)	売却価額 (円) (注3)	経過利子 (円) (注3)	売却代金 (評価額) (円) n
銘柄コード	e - g				
合計 (自動計算)		—			

(自動計算)	(自動計算)
当座勘定受払額 (代金詳細差額) (円) l - n	※ 当座勘定取引通番

(3) 減額措置手数料

(自動計算)	(自動計算)
当座勘定支払額 (減額措置手数料) (円)	※ 当座勘定取引通番
	—
	—
	—
(合計) (自動計算)	

(425208)

※ 作成者	※ 再鑑者	※ 責任者
-------	-------	-------

※ 送信権限者

(425204)

※ 作成者	※ 再鑑者	※ 責任者
-------	-------	-------

※ 送信権限者

(215301)

※ 作成者	※ 再鑑者	※ 責任者
-------	-------	-------

※ 送信権限者

- ◆ 国債補充供給の募入決定時に日本銀行金融ネットワークシステムから出力された「募入決定通知」から転記する。
- (注1) 残高不足のため未処理となっている売買国債の額面金額を記入する。
- (注2) 残高不足のため未処理となっている売買国債の「国債資金同時受渡依頼受付案内」に記載されている受付番号を記入する。
- (注3) 減額した国債が国庫短期証券である場合には、記入を要しない。
- (注4) 計算結果が正值のときは「入金」と、負値のときは「引落」と出力される。
- (注5) ※印は、日本銀行記入欄。
- (注6) ※※印は、日本銀行記入欄 (決済先が決済代行先である場合には、入金先または引落先は決済代行先とする。)

(215311)

※ 作成者	※ 再鑑者	※ 責任者
-------	-------	-------

※ 送信権限者
