

日銀シス第 41 号
2021 年 2 月 12 日

金利スワップ担保国債管理関係事務についての

日銀ネット利用先

日銀ネット利用金融機関等 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（金利スワップ担保国債管理関係事務）」の一部改正に関する件

日本銀行では、日本銀行金融ネットワークシステムにおいて、香港ドル即時クロス決済システムとのクロスボーダーDVPリンクに関する機能を追加することに伴い、標記規程の一部を別紙のとおり改正し、2021年4月1日から実施することとしましたので、通知します^(注)。

なお、当該機能を利用しない日銀ネット利用先等におかれましては、既存の事務に影響はありませんので、念のため申し添えます。

(注) 本件の概要は、「「日銀ネットの有効活用に向けた協議会」第20回会合の議事概要」別添2（日本銀行HP－業務上の事務連絡－日銀ネット関連－日銀ネットの有効活用に向けた協議会（<https://www5.boj.or.jp/bojnet/newbojnet/kyougikai.htm>））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（金利スワップ担保国債管理関係事務）」中一部改正

- 第1編2. (2) ② イ. を横線のとおり改める。

イ. 帳票出力先と担保受払先が同一である場合

担保受払先は、差入を行う担保国債の担保価額の合計が「NOTIFICATION OF THE DELIVERY AMOUNT」(4310-00100)に表示された「DELIVERY AMOUNT (AFTER ROUNDING UP)」の額以上になるように担保国債の銘柄を選定のうえ、当該銘柄の担保国債について、所定の端末操作手順（業務処理区分コード 431101）に従い、「受渡担保明細（スワップ）」を日本銀行に送信します。

日本銀行は、「受渡担保明細（スワップ）」を受信した場合には、直ちに指定された銘柄の担保国債を差入れるための処理を行います。この場合、担保受払先には、「受渡担保明細（スワップ）処理済通知」(4311-00100)が送信されます。

ただし、日本銀行は、担保取引区分で「差入」を指定した「受渡担保明細（スワップ）」を受信した時点で、当該明細にもとづき担保国債を差入れるための処理を行うと当該担保受払先の属する金融機関等の払出口座にの払出可能国債残高に不足が生じる場合には、上記の処理を行いません（当該「受渡担保明細（スワップ）」の送信はエラーとなり、エラーメッセージとして「額面金額：国債残高不足」の旨表示されます。）。

払出可能国債残高
利用細則（国債振
替決済関係事務）
第1編I. 参照

- 第1編2. (2) ② ロ. を横線のとおり改める。

ロ. 帳票出力先と担保受払先が異なる場合

帳票出力先は、「NOTIFICATION OF THE DELIVERY AMOUNT」(4310-00100)の受信後、直ちにその通知内容をスワップ取引先または担保受払先に連絡してください。

担保受払先は、差入を行う担保国債の担保価額の合計が「NOTIFICATION OF THE DELIVERY AMOUNT」(4310-00100)に表

示された「DELIVERY AMOUNT (AFTER ROUNDING UP)」の額以上になるように担保国債の銘柄を選定のうえ、当該銘柄の担保国債について、所定の端末操作手順（業務処理区分コード 431101）に従い、「受渡担保明細（スワップ）」を日本銀行に送信します^(注)。

(注) 略（不変）

日本銀行は、「受渡担保明細（スワップ）」を受信した場合には、直ちに指定された銘柄の担保国債を差入れるための処理を行います。この場合、担保受払先および帳票出力先には、「受渡担保明細（スワップ）処理済通知」（担保受払先 4311-00100、帳票出力先 4311-00101）が送信されます。

ただし、日本銀行は、担保取引区分で「差入」を指定した「受渡担保明細（スワップ）」を受信した時点で、当該明細にもとづき担保国債を差入れるための処理を行うと当該担保受払先の属する金融機関等の払出口座にの払出可能国債残高に不足が生じる場合には、上記の処理を行いません（当該「受渡担保明細（スワップ）」の送信はエラーとなり、エラーメッセージとして「額面金額：国債残高不足」の旨表示されます。）。

- 第2編の業務処理区分「スワップ（財務省） 担保受払 受渡担保明細（スワップ）」（コード431101）の 出力帳票 の（注16）を横線のとおり改める。

（注16） 払出可能国債残高が表示されます。

なお、「帳票出力先」に出力される場合には、項目名も含め、表示されません。