

日銀市第162号
2018年8月15日

担保差入金融機関等 御中

日 本 銀 行

「担保に関する細則」の一部改正に関する件

本年5月1日に国債の決済期間短縮化が実施されたことから、日本銀行では、本年秋口に予定している年次の共通担保の担保掛目等の見直しと併せて、共通担保の時価反映タイミング等を短縮することとし^(注)、これに伴い、「担保に関する細則」を別紙のとおり一部改正することとしましたので、通知します。なお、本件改正の具体的な実施日については、10月上旬を目途に改めて通知します。

(注) 概要については、「日本銀行に差入れられている共通担保の時価反映タイミング等の短縮化について」(2017年9月26日付日銀市第155号)を、本件短縮化に向けたスケジュールと実務上の留意点については、「日本銀行に差入れられている共通担保の時価反映タイミング等の短縮化に向けた今後のスケジュール等について」(2018年3月30日付日銀市第52号)をご覧ください。

以 上

「担保に関する細則」中一部改正

- 第5章2.(2)(注2)を横線のとおり改める。

(注2)時価は、原則として市場相場にもとづき、銘柄毎に設定されます(円位未満第2位まで)。初めて時価が設定される場合には、国債については、原則として発行日(分離国債のときは元利分離前の国債の発行日。以下(注2)において同じです。)の前営業日(発行日の前営業日よりも前に市場相場が発表されるときは2営業日前)の市場相場にもとづき時価が設定され、発行日から~~5~~4営業日(発行日の前営業日よりも前に市場相場が発表されるときは~~4~~3営業日)の間、担保価額等の算出に適用します。また、国債以外の債券については、日本銀行が適当と認める日の前営業日の市場相場にもとづき時価が設定され、当該日本銀行が適当と認める日の翌営業日から~~4~~3営業日の間、担保価額等の算出に適用します。時価が設定されていない債券については、担保差入を行うことはできません。時価は、日本銀行が必要と判断した場合に変更します。

- 第5章3.を次のとおり改める(全面改正)。

3.時価または円貨換算率の変更等

(1)時価または円貨換算率の変更

日本銀行が、時価または円貨換算率を変更する日を時価変更日、変更後の時価または円貨換算率を用いて担保価額の算出を開始する日を時価適用日とし、時価適用日は時価変更日の3営業日後の日とします。

時価および円貨換算率の変更は、具体的には、次のとおり行われます。

① 外貨建外国債券以外の債券の場合

時価は毎営業日変更します(毎営業日が時価変更日です。)

変更後の時価は、原則として、時価変更日の前営業日の市場相場にもとづいて定められ、時価適用日の業務開始時から適用します。

《外貨建外国債券以外の債券の時価変更等の日程の例》

1日 (月)	2日 (火)	3日 (水)	4日 (木)	5日 (金)	6日 (土)	7日 (日)	8日 (月)
基準となる 市場相場	時価変更日	担保価額 合計額 および 担保余裕額 の連絡※		時価適用日			
	基準となる 市場相場	時価変更日	担保価額 合計額 および 担保余裕額 の連絡※				時価適用日

以下同様に推移

※担保不足が見込まれる場合に限りです。

② 外貨建外国債券および外貨建証券貸付債権の場合

時価または円貨換算率は、原則として、毎週最終営業日に市場相場にもとづいて変更される^(注)ほか、随時に変更することがあります。

変更後の時価または円貨換算率は、時価適用日の業務開始時から適用します。

(注) 外貨建外国債券の場合には、時価および円貨換算率が、外貨建証券貸付債権の場合には、円貨換算率が変更されます。

《外貨建外国債券および外貨建証券貸付債権の時価変更等の日程の例》

(定期的変更のうち標準的な例)

1日 (金)	2日 (土)	3日 (日)	4日 (月)	5日 (火)	6日 (水)
時価変更日			担保価額 合計額 および 担保余裕額 の連絡※		時価適用日

3営業日後

※担保不足が見込まれる場合に限りです。

(2) 担保価額合計額および担保余裕額の連絡

日本銀行は、各時価適用日の2営業日前の日（時価変更日の翌営業日）の業務開始時を基準時点として、次のとおり、担保価額合計額および担保余裕額を算出したうえで、担保不足が生じることが見込まれる場合には、担保差入金融機関等の担保交付指定店舗に対して連絡します^(注)。

① 担保価額合計額

基準時点で差入済である担保（同日に期日担保返戻を行うものを含みます。）について、変更後の時価および円貨換算率ならびに時価適用日時点の残存期間に応じた掛目、連動係数およびファクターにもとづいて算出します。なお、基準時点から時価適用日までに予定されている担保受払、期日担保返戻または住宅ローン債権信託受益権の残存元本相当額等の変更に伴う担保価額合計額の増減は含まれません。

② 担保余裕額

①の担保価額合計額から、基準時点における与信取引の所要担保価額合計額の全店舗合計額を控除して算出します。なお、基準時点から時価適用日までに予定されている所要担保価額合計額の増減は含まれません。

(注) 担保交付指定店舗は、担保不足が生じることが見込まれない場合においても、必要に応じて、担保管理店の窓口において、「担保不足・余裕等通知」の交付を受けることができます。この場合、事前に担保管理店に連絡を行ってください。