

日銀業第152号  
2023年4月14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

日本銀行では、2023年7月1日以降、米ドルLIBOR（ICE Benchmark Administration Limitedが公表するLondon InterBank Offered Rateをいいます。以下同じです。）の翌日物、1か月物、3か月物、6か月物および12か月物の公表が停止されることを踏まえ、同日以降の貸付金利がこれらを参照する証書貸付債権について、適格担保としての受入れを停止することとしました。これに伴い、標記規程の一部を別紙のとおり改正し、2023年7月3日から実施することとしましたので、通知します。

また、本日以降2023年6月30日までの間についても、2023年7月1日以降の貸付金利が米ドルLIBORの翌日物、1か月物、3か月物、6か月物および12か月物を参照する証書貸付債権を日本銀行に担保差入することは極力控えていただきたく、よろしく申し上げます。

— なお、「担保に関する細則」の一部改正等に関する件（2021年9月24日付日銀業第483号）の別添「貸付金利がLIBORを参照する電子記録債権および証書貸付債権の日本銀行適格担保としての要件の見直しおよび担保差入事務について」でご連絡したとおり、2022年1月1日以降、米ドルLIBORの翌日物、1か月物、3か月物、6か月物および12か月物を参照した新規の貸出は行われていないものと想定しています。

＜本件に関する照会先＞

（改正後の細則に基づく具体的な事務取扱について）

日本銀行 業務局 総務課 営業・国債業務企画グループ  
(03-3277-3073、03-3277-3072)

（上記以外の事項）

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  
(03-3277-1296、03-3277-0055)

「担保に関する細則」中一部改正

○ 別表3を横線のとおり改める。

別表3

証書貸付債権に関する事前審査時の要件

○：満たしている必要がある要件

●：要件欄に記載する条件に該当する場合に満たしている必要がある要件

項番	項目	要件	証書貸付債権									
			相対					シンジケート・ローン				
			企業等	政府 通常適格		政府保証 通常適格		地公体	企業等	政府保証		地公体
				セカン ダリー 玉以外	セカン ダリー 玉	セカン ダリー 玉以外	セカン ダリー 玉			通常 適格	特別 適格	
1 J 25	略（不変）											
25 の2	貸金 ② 付利	貸付金利が日本円LIBOR（ICE Benchmark Administration Limitedが公表するLondon InterBank Offered Rateをいう。）を参照する金利でないこと（2021年12月31日以前に公表された日本円LIBORを参照する固定金利である場合を除く。）。ただし外貨建証書貸付債権にあっては、貸付金利が米ドルの1週間物または2か月物LIBORを参照する変動金利でないこと（2023年6月30日以前に公表された米ドルLIBORを参照する固定金利である場合を除く。）。）※3	○	●	●	●	○	○	●	○		
26	略（不変）											

(注) 略（不変）

(備考)

※1 略（不変）

※2 略（不変）

※3 事前審査依頼より前の時点においては貸付金利として日本円LIBOR（ただし、外貨建証書貸付債権にあっては、米ドルLIBORをいいます。以下※3において同じです。）を参照していたものの、契約変更等によって日本円LIBOR以外の金利を参照している場合は、「LIBORを参照する証書貸付債権の貸付金利に関する確認書」（第50号書式）および変更契約にかかる契約書等をご提出いただき、事前審査の依頼時点以降に適用される貸付金利が日本円LIBORでないことが確認できる必要があります。

○ 別表 6 を横線のとおり改める。

別表 6

証書貸付債権に関する差入時の要件

○：充たしている必要がある要件

●：要件欄に記載する条件に該当する場合に充たしている必要がある要件

項番	項目	要件	証書貸付債権																		
			相対								シンジケート・ローン										
			企業等	政府				政府保証				地公体	企業等	政府保証		地公体					
				通常適格		特別適格		通常適格		特別適格				通常適格	特別適格						
セカンダリー玉以外	セカンダリー玉	セカンダリー玉以外		セカンダリー玉	セカンダリー玉以外	セカンダリー玉	セカンダリー玉以外	セカンダリー玉													
1	}	略（不変）																			
∫																					
8の2																					
8の3	貸付金利	事前審査より前の時点においては貸付金利として日本円LIBOR（ICE Benchmark Administration Limitedが公表するLondon InterBank Offered Rateをいう。ただし外貨建証書貸付債権にあつては、貸付金利が米ドルの1週間物または2か月物LIBORをいう。以下、この項目において同じ。）を参照していたものの、契約変更等によって事前審査の依頼時点以降に適用される貸付金利が日本円LIBORを参照する金利以外の場合は、「LIBORを参照する証書貸付債権の貸付金利に関する確認書」（第50号書式）および変更契約にかかる契約書等を提出すること	●											●	●				●		
9	}	略（不変）																			
∫																					
14																					

(注) 略（不変）

(備考) 略（不変）

- 第50号書式を次のとおり改める（全面改正）。  
（第50号書式）

## LIBORを参照する証書貸付債権の貸付金利に関する確認書

年 月 日

日本銀行 御中

(担保差入先) (注1)

(届出印)

(電話番号、担当者名)

本書面とあわせて提出する「証書貸付債権証書スタンプ押なつ依頼書」等に基づきスタンプ押なつを依頼する下記証書貸付債権については、本確認書の提出日より前に適用される貸付金利は日本円LIBOR（ICE Benchmark Administration Limitedが公表するLondon InterBank Offered Rateをいう。以下同じ。）または米ドルLIBORを参照するものでしたが、別添の変更契約等(注2)の締結により本確認書の提出日以降に適用する貸付金利はこれらを参照するものではありません。

つきましては、別添の変更契約書等中、本確認書の提出日以降に適用する貸付金利が日本円LIBORまたは米ドルLIBOR（市場データを用いて算出する疑似的なLIBORを含む。以下記書き2. 柱書において同じ。）を参照するものでないことを示す箇所が以下の通りであることを表明します。

### 記

#### 1. 対象となる証書貸付債権

当初契約の締結日	年 月 日
変更契約の締結日	年 月 日
証書貸付債権番号	

2. 変更契約書等中、本確認書の提出日以降に適用する貸付金利が日本円LIBORまたは米ドルLIBORを参照するものでないことを示す箇所

規定内容	該当箇所 <sup>(注3)</sup>
(1) 本確認書の提出日以降に適用される貸付金利が指定されていること	
(2) (1) に該当する規定により指定された具体的な貸付金利(日本円LIBORまたは米ドルLIBORを参照する金利を除く。)に関する事項	

以 上

(注1) 代表者またはその者から権限を付与された者の役職名を記載し、記名なつ印または署名をする。役職名、氏名、印鑑または署名は、印鑑届等により日本銀行に届出たものを使用する。

(注2) 変更契約書等には変更の対象となる証書貸付債権の証書貸付債権番号を記すこと。

(注3) 「変更契約第〇条第〇項」のように、該当箇所を項番まで含めて具体的に記すこと。