

## 東京レポ・レート・レートのレファレンス先の 2011 年度公募について

日本銀行は、2011 年度の東京レポ・レート（レファレンス先平均値）（以下「東京レポ・レート」）のレファレンス先を以下のとおり公募します。

### 1. 東京レポ・レートおよび同レート・レートの作成・公表事務の概要

東京レポ・レートおよび同レート・レートの作成・公表事務の概要につきましては、「東京レポ・レート（レファレンス先平均値）作成・公表要領」

（<http://www.boj.or.jp/statistics/market/short/trp/extrp01.pdf>）を参照して下さい。

—— なお、「国債の決済期間の短縮化に関する検討ワーキング・グループ」において、2012 年 4 月 23 日よりアウトライトおよびレポ取引の決済期間を 1 営業日短縮することが合意されたことを受け、東京レポ・レート・レートの公表項目についても同日より一部見直しを行うことを検討しております。見直しの具体的な内容は、新年度のレファレンス先の皆様のご意見も参考にさせていただきつつ、本年末までを目途に方針を確定することを予定しております。

### 2. レファレンス先の選定

#### （1）レファレンス先数

レファレンス先となることを希望する先の中から、20 先前後（15～25 先程度）を選定します。

—— 最終的な先数は、レファレンス先全体が十分な市場カバレッジを有する形となるように、日本銀行が決定します。

#### （2）レファレンス先であるための基準

レファレンス先は、日本銀行が、以下の 3 つの基準を総合的に勘案して選定します。

- ① 本邦において債券現先取引および現金担保付債券貸借取引を活発に行っていること

- ② 信用力、レピュテーションに問題がないこと
- ③ レート呈示の実績に問題がないこと（既往先の継続の場合）

### （３）レファレンス先としての役割

東京レポ・レート of 適切な運営を確保する観点から、レファレンス先には以下の役割を遵守することを求めます。

- ① レファレンス先としての事務を正確かつ迅速に行うこと
- ② レートの適切性や取引の公正性を確保する観点から、他のレファレンス先との間で報告レートの水準について事前の情報交換・調整を行わないこと
- ③ 東京レポ・レート of 適切な運営や信頼性確保に積極的に協力すること

## 3. レファレンス先への応募

### （１）応募の方法

レファレンス先となることを希望する先は、「東京レポ・レート of レファレンス先選定依頼書」（別紙 1）および「東京レポ・レート of レファレンス先選定資料」（別紙 2）を、8 月 5 日（金）午後 4 時までに下記の提出先に提出して下さい。

—— 依頼書等の受付時には、日本銀行金融市場局の受付印を押した依頼書等のコピーをお渡しします。なお、下記の提出先に直接お越しいただくことが難しく郵送により依頼書等を提出する場合には、その旨下記の提出先に連絡するとともに、予め依頼書等を FAX 送信して下さい。

＜提出先＞

東京都中央区日本橋本石町 2-1-1

日本銀行金融市場局市場企画課市場整備グループ（本店新館 4F）

杉村（Tel:03-3277-3083、FAX:03-5203-7188）

### （２）応募に関する留意事項

公募締切日を過ぎた依頼書等の提出は原則認められません。また、（１）の依頼書等以外の資料を追加的にご提出いただく場合があります。

#### 4. レファレンス先の選定結果の通知および公表

日本銀行は、適宜の方法により、レファレンス先として選定された金融機関等に選定結果を通知するとともに、同金融機関等の名称を公表します。

以 上

## 東京レポ・レートへのレファレンス先選定依頼書

当方は、日本銀行が公表する東京レポ・レート（レファレンス先平均値）のレファレンス先となることを希望します。また、当方は、東京レポ・レートへのレファレンス先に選定された場合には、「東京レポ・レート（レファレンス先平均値）作成・公表要領」5.（3）に定めるレファレンス先としての役割を遵守します。

2011 年      月      日（注1）

（金融機関等名）  
（役職名・代表者）

印（注2）（注3）

日本銀行金融市場局長 殿

東京レポ・レートへのレファレンス先選定にかかる連絡先（優先順位を付け2名まで記入して下さい）				
部署・役職	氏名	電話番号	ファクシミリ番号	E-mail アドレス
1.				
2.				

（注1） 依頼書の提出日を記載して下さい。この記載がない場合には、日本銀行金融市場局の受付印の日付を提出日とみなします。

（注2） 頭取、社長、理事長等が記名なつ印または署名して下さい。

（注3） 代表者欄への支店長等の代理人名の記載は不可とします。印章は、日本銀行との当座勘定取引において業務局に届出済の代表者の印鑑届または署名鑑がある場合には、当該印鑑届または署名鑑に押なつしているものとして下さい。日本銀行との当座勘定取引において業務局に届出済の代表者の印鑑届または署名鑑がない場合には、代表者の印鑑証明書を添付して下さい。

## 東京レポ・レートのリファレンス先選定資料

金融機関等名	
担当部署	
担当者氏名	
電話番号	

当方が本邦内で約定した<sup>(注1)</sup> 2011 年 1 月から 2011 年 6 月の 6 ヶ月間分の債券現先取引および現金担保付債券貸借取引の残高（月末値）は、下表のとおりです。

（単位：億円＜単位未満四捨五入＞）

	2011 年 1 月末		2011 年 2 月末	
	資金運用	資金調達	資金運用	資金調達
現金担保付債券貸借・債券現先 <sup>(注2)</sup>				
うち G C 分 <sup>(注3)</sup>				
うち S C 分 <sup>(注4)</sup>				

	2011 年 3 月末		2011 年 4 月末	
	資金運用	資金調達	資金運用	資金調達
現金担保付債券貸借・債券現先 <sup>(注2)</sup>				
うち G C 分 <sup>(注3)</sup>				
うち S C 分 <sup>(注4)</sup>				

	2011 年 5 月末		2011 年 6 月末	
	資金運用	資金調達	資金運用	資金調達
現金担保付債券貸借・債券現先 <sup>(注2)</sup>				
うち G C 分 <sup>(注3)</sup>				
うち S C 分 <sup>(注4)</sup>				

（注 1） 本邦内で約定した取引であれば、残高を把握できる限りにおいて、本邦外で記帳管理されているものも集計対象に含めることができる。

（注 2） 額面ベース（円貨建の取引に限る）。短期社債（電子 C P）および外貨建債券の取引ならびに日本銀行の国債買現先オペ、国債売現先オペおよび国債補完供給オペの残高を除く。

（注 3） ①現金担保付債券貸借および②債券現先のうち特定銘柄の債券を融通する目的で行う取引ではなく円資金の運用・調達目的で行う取引の合計（額面ベース）。日本銀行の国債買現先オペおよび国債売現先オペの残高を除く。

（注 4） 「現金担保付債券貸借・債券現先」の残高から「うち G C 分」の残高を差し引いた額（額面ベース）。