

2009年5月22日  
日 本 銀 行

## 「適格外国債券担保取扱要領」の制定等について

日本銀行は、本日、政策委員会・金融政策決定会合において、金融市場の情勢に応じた金融調節の一層の円滑化を図るとともに、担保取扱いの適切かつ効率的な運営を確保する観点から、下記の諸措置を講ずるとともに、最近における国内外の金融市場の情勢等を踏まえ、金融調節の一層の円滑化を通じて金融市場の安定確保を図る観点から「適格外国債券担保取扱要領」の適用を同要領の実施日から開始することを決定しましたので、お知らせします。

### 記

1. 「適格外国債券担保取扱要領」を別紙1のとおり制定すること。
2. 「共通担保資金供給オペレーション基本要領」（平成18年4月11日決定）を別紙2のとおり一部改正すること。
3. 「補完貸付制度基本要領」（平成13年2月28日決定）を別紙3のとおり一部改正すること。
4. 「米ドル資金供給オペレーション基本要領」（平成20年9月18日決定）を別紙4のとおり一部改正すること。
5. 「企業金融支援特別オペレーション基本要領」（平成20年12月19日決定）を別紙5のとおり一部改正すること。

以 上

<本件照会先>

企 画 局 坂 本 (03-3277-2800)

浜 野 (03-3277-1634)

## 「適格外国債券担保取扱要領」

### 1. 趣旨

- (1) この要領は、本行が通貨および金融の調節として行う与信に関して、「適格担保取扱基本要領」（平成12年10月13日付政委第138号別紙1.）の定めにかかわらず適格担保とする外貨建外国債券（以下「適格外国債券」という。）の取扱いについて定める。
- (2) 「適格担保取扱基本要領」の規定は、この要領に特段の定めがある場合を除き、その性質が許す限り、適格外国債券に適用する。

### 2. 適用

- (1) この要領は、金融調節の一層の円滑化を通じて金融市場の安定確保を図る観点から必要と認められる場合その他国内外の金融市場の情勢等を勘案して適切な金融調節の実施のため必要と認められる場合に限り適用する。
- (2) この要領の適用を開始する場合および適用を停止する場合には、本行が適当と認める方法によりこれを公表する。

### 3. 適格外国債券の適格基準および担保価格

適格外国債券の適格基準および担保価格は、別表に定めるとおりとする。

### 4. 関係規程の読み替え

この要領を適用する場合には、関係規程について次の読み替えを行う。

- (1) 「適格担保取扱基本要領」4.（3）において、「国債（割引短期国債を除く。）、国庫短期証券（割引短期国債および政府短期証券をいう。）、政府保証付債券および公募地方債以外の担保」とあるのは「国

債（割引短期国債を除く。）、国庫短期証券（割引短期国債および政府短期証券をいう。）、政府保証付債券、公募地方債および適格外国債券以外の担保」と読み替える。

- (2) 「共通担保資金供給オペレーション基本要領」（平成18年4月11日付政委第31号別紙1.）8. (1)、 「米ドル資金供給オペレーション基本要領」（平成20年9月18日付政委第77号別紙1.）8. (1) および「企業金融支援特別オペレーション基本要領」（平成20年12月19日付政委第124号別紙1.）10. (1)において、「根担保」とあるのは、適格外国債券については、「担保」と読み替える。

## 5. 特例的取扱い

本行は、業務運営上特に必要と認める場合には、3. および4. に規定する取扱いと異なる取扱いをすることができる。

### (附則)

1. この要領は、適格外国債券の担保受入れにかかる実務上の準備が整い次第速やかに実施することとし、具体的な実施日は総裁が定める。
2. 適格外国債券の担保受入れの方法その他この要領の実施にあたり必要となる事項については、総裁が定める。
3. 3. に定める適格外国債券の適格基準および担保価格については、原則として年1回程度の頻度で、国内外の金融市場の情勢等を踏まえた検証を行い、その結果に基づいて必要な見直しを行うものとする。

## 別表

### 適格外国債券の適格基準および担保価格

#### 1. 適格基準

(1) および(2)を満たしている公募債であること(発行国が、本行が適当と認める格付機関の複数からAA格相当以上の格付を取得している場合に限る。)

(1) 以下のいずれかに該当する債券であること。

イ、アメリカ合衆国政府が発行する米ドル建債券のうち、**Treasury Bonds**、**Treasury Notes** または **Treasury Bills**

ロ、グレートブリテン及び北アイルランド連合王国政府が発行する英ポンド建債券のうち、**Conventional Gilts** または **Treasury Bills**

ハ、ドイツ連邦共和国政府の発行するユーロ建債券のうち、**Bunds (Bundesanleihen)**、**Bobls (Bundesobligationen)**、**Schätze (Bundesschatzanweisungen)** または **Bubills (Unverzinsliche Schatzanweisungen des Bundes)**

ニ、フランス共和国政府の発行するユーロ建債券のうち、**OAT(Obligations Assimilables du Trésor)**、**BTAN(Bons du Trésor à intérêts annuels)** または **BTF(Bons du Trésor à taux fixe et à intérêt précompté)**

(2) 本行の業務運営の円滑性の確保その他の事情を勘案して、本行が適格と認めるものであること。

## 2. 担保価格

残存期間 1 年以内のもの	時価（円貨換算後）の 8 4 %
残存期間 1 年超 5 年以内のもの	時価（円貨換算後）の 8 4 %
残存期間 5 年超 1 0 年以内のもの	時価（円貨換算後）の 8 4 %
残存期間 1 0 年超 2 0 年以内のもの	時価（円貨換算後）の 8 4 %
残存期間 2 0 年超 3 0 年以内のもの	時価（円貨換算後）の 8 3 %
残存期間 3 0 年超のもの	時価（円貨換算後）の 8 2 %

「共通担保資金供給オペレーション基本要領」中一部改正

○ 8. を横線のとおり改める。

8. 担保

(1) 略（不変）

(2) 担保の取扱いは、「適格担保取扱基本要領」（平成12年10月13日付政委第138号別紙1.）および「適格外国債券担保取扱要領」（平成21年5月22日付政委第63号別紙1.）の定めるところによる。

（附則）この一部改正は、「適格外国債券担保取扱要領」の実施日から実施する。

「補完貸付制度基本要領」中一部改正

○ 7. を横線のとおり改める。

7. 担保

(1) 略（不変）

(2) 担保の取扱いは、「適格担保取扱基本要領」（平成12年10月13日付政委第138号別紙1.）および「適格外国債券担保取扱要領」（平成21年5月22日付政委第63号別紙1.）の規定するところによる。

(附則) この一部改正は、「適格外国債券担保取扱要領」の実施日から実施する。



「米ドル資金供給オペレーション基本要領」 中一部改正

○ 8. を横線のとおり改める。

8. 担保

(1) 略 (不変)

(2) 担保の取扱いは、「適格担保取扱基本要領」(平成12年10月13日付政委第138号別紙1.) および「適格外国債券担保取扱要領」(平成21年5月22日付政委第63号別紙1.) の定めるところによる。

(3) 略 (不変)

(附則) この一部改正は、「適格外国債券担保取扱要領」の実施日から実施する。

「企業金融支援特別オペレーション基本要領」中一部改正

○ 10. を横線のとおり改める。

10. 担保

(1) 略（不変）

(2) 担保の取扱いは、「適格担保取扱基本要領」（平成12年10月13日付政委第138号別紙1.）および「適格外国債券担保取扱要領」（平成21年5月22日付政委第63号別紙1.）の定めるところによる。

（附則）この一部改正は、「適格外国債券担保取扱要領」の実施日から実施する。