

2019年10月18日
日 本 銀 行

「適格担保の担保価格」の一部改正等について

日本銀行では、次の1. および2. に掲げる諸規程を別紙1および別紙2のとおりそれぞれ一部改正し、2019年11月28日から実施することとしましたので、お知らせします。

本件は、金融市場の情勢等を踏まえて行った定例の検証の結果に基づき、本行資産の健全性および市場参加者の担保利用の効率性を確保する観点から、適格担保の担保価格等を見直すものです。

1. 「適格担保の担保価格」
(2017年1月31日決定) . . . 別紙1
2. 「国債の条件付売買にかかる時価売買価格比率」
(2017年1月31日決定) . . . 別紙2

以 上

<本件照会先>
金 融 市 場 局 市 場 調 節 課 (03-3277-1272)

「適格担保の担保価格」中一部改正

○ 1. を横線のとおり改める。

1. 「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.)に基づき適格とするもの

略(不変)

(イ)	(ロ)						(ハ)
	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超 20年以内	20年超 30年以内	30年超	
国債 ^(注2) 、 国庫短期証券 ^(注3)	略(不変)						略(不変)
変動利付国債							
分離元本振替国債、 分離利息振替国債							
物価連動国債	—	9698%	9594%	—	—	—	
政府保証付債券	略(不変)						
∫							
コマースヤル・ペーパー							

(イ)	(ロ)					(ハ)
	1年以内	1年超 3年以内	3年超 5年以内	5年超 7年以内	7年超 10年以内 ^(注6)	
企業を債務者とする電子記録債権	96%	9193%	8586%	7581%	7073%	略(不変)
不動産投資法人を債務者とする電子記録債権	96%	9193%	8586%	7581%	7073%	
政府 ^(注7) を債務者とする電子記録債権	97%	9597%	9093%	8590%	8086%	
政府保証付電子記録債権	97%	9597%	9093%	8590%	8086%	
地方公共団体を債務者とする電子記録債権	97%	9496%	9091%	8588%	8083%	
企業に対する証券貸付債権	96%	9193%	8586%	7581%	7073%	
不動産投資法人に対する証券貸付債権	96%	9193%	8586%	7581%	7073%	
政府 ^(注7) に対する証券貸付債権	97%	9597%	9093%	8590%	8086%	
政府保証付証券貸付債権	97%	9597%	9093%	8590%	8086%	
地方公共団体に対する証券貸付債権	97%	9496%	9091%	8588%	8083%	

以下略(不変)

○ 3. を横線のとおり改める。

3. 「企業および地方公共団体等債務にかかる担保の適格性判定等に関する特則」（令和元年6月20日付政委第36号別紙1.）に基づき適格とするもの
略（不変）

(イ)	(ロ)						(ハ)
	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超 20年以内	20年超 30年以内	30年超	
社債	略（不変）						略（不変）
企業が振出す手形	8183%	—	—	—	—	—	
地方債	略（不変）						

(イ)	(ロ)					(ハ)
	1年以内	1年超 3年以内	3年超 5年以内	5年超 7年以内	7年超 10年以内 ^(注)	
自己査定型電子記録債権	8183%	6770%	5557%	4548%	3036%	略（不変）
自己査定型電子記録債権以外の企業を債務者とする電子記録債権	9496%	8588%	7579%	6573%	5563%	
自己査定型証書貸付債権	8183%	6770%	5557%	4548%	3036%	
自己査定型証書貸付債権以外の企業に対する証書貸付債権	9496%	8588%	7579%	6573%	5563%	
地方公共団体を債務者とする電子記録債権	87%	8486%	8081%	7578%	7073%	

(イ)	(ロ)					(ハ)
	1年以内	1年超 3年以内	3年超 5年以内	5年超 7年以内	7年超 10年以内 ^(注)	
地方公共団体に対する証書貸付債権	87%	84 86%	80 81%	75 78%	70 73%	略(不変)

以下略(不変)

○ 4. を横線のとおり改める。

4. 「米ドル建の企業に対する証書貸付債権にかかる担保の適格性判定等に関する特則」(平成28年1月29日付政委第6号別紙.)に基づき適格とするもの

略(不変)

残存期間				
1年以内	1年超 3年以内	3年超 5年以内	5年超 7年以内	7年超 10年以内 ^(注)
87 88%	77 79%	65 68%	60%	50%

以下略(不変)

○ 5. を横線のとおり改める。

5. 「適格住宅ローン債権信託受益権担保取扱要領」(平成28年3月15日付政委第24号別紙1.)に基づき適格とするもの

担保価格については、信託財産となっている住宅ローン債権の残存元本相当額およびその返済元本相当額の合計額に~~5-5-6~~2%を乗じた値とする。

「国債の条件付売買にかかる時価売買価格比率」中一部改正

○ 1. を横線のとおり改める。

1. 「国債の条件付売買基本要領」（平成14年9月18日付政委第109号別紙1.）7.（2）に定める時価売買価格比率

（1）買入の場合

売買国債の種類	残存期間					
	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超 20年以内	20年超 30年以内	30年超
利付国債 ^(注1) 、 国庫短期証券 ^(注2)	1.002	1.004 <u>1.003</u>	1.009 <u>1.008</u>	1.016 <u>1.015</u>	1.028 <u>1.026</u>	1.043 <u>1.041</u>
変動利付国債	略（不変）					
物価連動国債	—	1.016 <u>1.007</u>	1.023 <u>1.025</u>	—	—	—

略（不変）

（2）売却の場合

売買国債の種類	残存期間					
	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超 20年以内	20年超 30年以内	30年超
利付国債、 国庫短期証券	0.999	0.997 <u>0.998</u>	0.992 <u>0.993</u>	0.985 <u>0.986</u>	0.973 <u>0.975</u>	0.960 <u>0.962</u>
変動利付国債	略（不変）					
物価連動国債	—	0.985 <u>0.994</u>	0.978 <u>0.976</u>	—	—	—

○ 2. を横線のとおり改める。

2. 「補完供給を目的として行う国債の買戻条件付売却基本要領」（平成16年4月9日付政委第37号別紙1.）8.（2）に定める時価売却価格比率

売却国債の種類	残存期間					
	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超 20年以内	20年超 30年以内	30年超
利付国債、 国庫短期証券	0.999	0.997 <u>0.998</u>	0.992 <u>0.993</u>	0.985 <u>0.986</u>	0.973 <u>0.975</u>	0.960 <u>0.962</u>
変動利付国債	略（不変）					
物価連動国債	—	0.985 <u>0.994</u>	0.978 <u>0.976</u>	—	—	—