

2017年7月18日

日本銀行金融市場局

CP等買現先オペの2017年度対象先公募について

1. はじめに

- 日本銀行では、次のスケジュールでCP等買現先オペの対象先を公募し、現在の対象先を見直すこととしました^(注)。

(注) CP等買現先オペの取引方法等については、日本銀行ホームページ(<http://www.boj.or.jp/>)に掲載している「CP等買現先オペの取引概要」をご覧ください。

▼公募スケジュール

| | |
|---------|----------------------|
| 公募開始日 | 2017年7月18日 |
| 公募締切日 | 2017年9月4日午後3時 |
| 選定結果の公表 | 2017年10月中旬以降の予定 |
| 選定先との取引 | 選定結果の公表後所要の準備が整い次第開始 |

- 本日現在対象先（既存先）であって、本年度も対象先となることを希望する先については、改めて応募して頂く必要はありません。本年度は対象先となることを希望しない場合には、2017年8月21日午後3時までに、金融機関等名、部署名、担当者の氏名、電話番号および電子メールアドレスを記載のうえ、その旨を後掲の照会先宛てに電子メールによりご連絡下さい。電子メールのタイトルは「金融市場調節取引の資格抹消の件（金融機関等名）」として下さい。

—— 既存先であって、上記の電子メールによる連絡を行わなかった先については、応募があったものとみなし、2. のとおり選定を行います。

2. 対象先の選定

- 対象先は、「CP等買現先オペの対象先選定基準・手続」（別紙）に基づき選定します。ただし、現段階では予見できない事情のために、別紙記載の基準等を適用することが不相当と判断される場合には、当該予見できない事情をも勘案して選定を行うこと、または選定された対象先の見直し等を行うことが極く例外的にあります。

以 上

<照会先>

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

田上 (03-3277-1277)

引馬 (03-3277-1272)

E-mail : post.fmd26@boj.or.jp

CP等買現先オペの対象先選定基準・手続

1. 対象先数

- 対象先となることを希望する先の中から、50先を選定します。

2. 対象先としての役割

- 金融調節を機動的・効率的に遂行する観点から、対象先には以下の役割を遵守することを求めます。
 - (1) CP等買現先オペに積極的に応札すること
 - (2) 正確かつ迅速に事務を処理すること
 - (3) 金融政策遂行に有益な市場情報または分析を提供すること
- 対象先が上記の役割に著しく背馳すると認められる場合には、当該先に対して理由を示したうえで、オファーの見送り、あるいは対象先からの除外といった措置を採ることがあります。

3. 対象先としての必須基準

- 対象先は、次の要件を満たしている必要があります。
 - (1) 日本銀行本店の当座預金取引先である金融機関、金融商品取引業者、証券金融会社または短資業者であること（ただし、整理回収機構、預金保険法（昭和46年法律第34号）第2条第13項に規定する承継銀行および同法第126条の34第3項第5号に規定する特定承継金融機関等を除きます。）^(注1)。
 - (注1) ・金融機関とは、日本銀行法（平成9年法律第89号）第37条第1項に規定する金融機関をいいます（以下同じです。）。
 - ・金融商品取引業者とは、日本銀行法施行令（平成9年政令第385号）第10条第1項第2号に規定する金融商品取引業者のうち、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます（以下同じです。）。
 - ・証券金融会社とは、日本銀行法施行令第10条第1項第3号に規定する証券金融会社をいいます（以下同じです。）。
 - ・短資業者とは、日本銀行法施行令第10条第1項第4号に規定する者をいいます（以下同じです。）。
 - (2) 当座勘定取引について日本銀行金融ネットワークシステムを利用していること。

(3) 公募開始日直前の決算期末（中間決算期末を含みます。以下同じです。）において、自己資本比率等が以下の要件を満たすこと、または、公募開始日直前の決算期末以降の増資等の事情により、自己資本比率等が以下の要件を満たすようになったと確認できること。

—— 公募開始日直前の決算期末の自己資本比率等が、公募締切日までに判明していない場合には、判明している直近の決算期末とします。

—— 公募締切日において初回の決算期末が到来していない先であっても、次の先は応募が可能です。

イ. 何れかのオペの対象先としての資格の移管が認められた先

ロ. 日本銀行に決算期末の自己資本比率等を報告していた他の金融機関等との合併、当該他の金融機関等からの事業の全部譲受けまたは当該他の金融機関等からの会社分割による事業の全部承継を受けた先

<自己資本比率等の要件>

金融機関：

- ① 国際統一基準適用先については連結および単体自己資本比率が、普通株式等 Tier1 比率 4.5%以上、Tier1 比率 6%以上および総自己資本比率 8%以上、国内基準適用先については同 4%以上であること。国際統一基準適用先または国内基準適用先の何れにも該当しない先（ただし、外国銀行を除きます。）については、業務内容等に照らし、自己資本の充実の状況が適当であると認められること。さらに、法令により資本バッファ規制が適用される場合には、資本バッファ比率が、法令により定められた水準を満たしていること。
- ② 金融機関の親会社が銀行持株会社である場合には、①に加え、銀行持株会社の連結自己資本比率が、国際統一基準適用先については普通株式等 Tier1 比率 4.5%以上、Tier1 比率 6%以上および総自己資本比率 8%以上、国内基準適用先については 4%以上であること。さらに、法令により資本バッファ規制が適用される場合には、資本バッファ比率が、法令により定められた水準を満たしていること。
- ③ 外国銀行にあつては、その母国において「バーゼル III：より強靱な銀行および銀行システムのための世界的な規制の枠組み」（2010 年 12 月バーゼル銀行監督委員会）に基づき定められた規制の適用を受ける先（以下「バーゼル III 適用先」といいます。）については、当該規制により算出された自己資本比率が、普通株式等 Tier1 比率 4.5%以上、Tier1 比率 6%以上および総自己資本比率 8%以上であること。その母国において「自己資本の測定と基準に関する国際的統一化」（1988 年 7 月バーゼル銀行監督委員会）または「自己資本の測定と基準に関する国際的統一化：改訂された枠組」（2004 年 6 月バーゼル銀行監督委員会）に基づき定められた規制の適用を受ける先については、当該外国銀行が現に適用を受ける規制により算出された自己資本比率が 8%以上であること。その母国において該当する規制が存在しない場合には、銀行法に準じて算出される当該外国銀行（以下「銀行法準用先」といいます。）にかかる自己資本比率が、普通株式等 Tier1 比率 4.5%以上、Tier1 比率 6%以上および総自己資本比率 8%以上であること。さらに、法令（バーゼル III 適用先については当該外国銀行の母国の法令をいい、銀行法準用先については当該外国銀行に準用される銀行法をいいます。以下同じです。）により資本バッファ規制が適用される場合には、資本バッファ比率が、法令により定められた水準を満たしていること。
- ④ ①、②または③において、資本バッファ比率が法令により定められた水準を満たさない場合であっても、その水準を満たすよう着実に改善すると認められるときは、①、

②または③に定める資本バッファ比率の要件を満たすものとみなします。

金融商品取引業者：

- ①自己資本規制比率が 200%以上（ただし、外国法人である金融商品取引業者（以下「外国金融商品取引業者」といいます。）で、当該外国金融商品取引業者を実質的に支配している会社の保証がある場合には、150%以上）であること。
- ②特別金融商品取引業者（金融商品取引法第 57 条の 2 第 2 項に規定する特別金融商品取引業者をいいます。以下同じです。）である場合には、①に加え、「特別金融商品取引業者及びその子法人等の保有する資産等に照らし当該特別金融商品取引業者及びその子法人等の自己資本の充実の状況が適当であるかどうかを判断するための基準を定める件」（平成 22 年金融庁告示第 128 号）に基づき算出された連結自己資本規制比率が 200%以上であること。
- ③特別金融商品取引業者であって、その親会社が最終指定親会社（金融商品取引法第 57 条の 12 第 3 項に規定する親会社をいいます。以下同じです。）である場合には、①および②に加え、「最終指定親会社及びその子法人等の保有する資産等に照らし当該最終指定親会社及びその子法人等の自己資本の充実の状況が適当であるかどうかを判断するための基準を定める件」（平成 22 年金融庁告示第 130 号。以下「川上連結告示」といいます。）第 2 条および第 3 条に基づき算出された連結自己資本規制比率が、普通株式等 Tier1 比率 4.5%以上、Tier1 比率 6%以上および総自己資本規制比率 8%以上であること。
- ④川上連結告示第 4 条に基づき算出された連結自己資本規制比率が 200%以上であるときは、③の要件を満たすものとみなします。
- ⑤川上連結金融商品取引業者である場合には、①、②および③に加え、連結資本バッファ比率が、法令により定められた水準を満たしていること。ただし、連結資本バッファ比率が法令により定められた水準を満たさない場合であっても、その水準を満たすよう着実に改善すると認められるときは、連結資本バッファ比率の要件を満たすものとみなします。

証券金融会社および短資業者：

自己資本比率（金融商品取引業者の自己資本規制比率に準じて算出します。）が 200%以上であること。

<流動性カバレッジ比率の要件>

金融機関：

- ①金融機関（ただし、外国銀行を除きます。）については、法令により流動性カバレッジ比率規制が適用される場合には、流動性カバレッジ比率が、法令により定められた水準を満たしていること。
- ②金融機関の親会社が銀行持株会社である場合において、当該銀行持株会社につき、法令により流動性カバレッジ比率規制が適用されるときは、①に加え、銀行持株会社に関する流動性カバレッジ比率が、法令により定められた水準を満たしていること。
- ③①または②において、流動性カバレッジ比率が法令により定められた水準を満たさない場合であっても、その水準を満たすよう着実に改善すると認められるときは、①または②に定める流動性カバレッジ比率の要件を満たすものとみなします。

金融商品取引業者：

川上連結金融商品取引業者である場合には、連結流動性カバレッジ比率が、法令により定められた水準を満たしていること。ただし、連結流動性カバレッジ比率が法令により定められた水準を満たさない場合であっても、その水準を満たすよう着実に改善すると認められるときは、連結流動性カバレッジ比率の要件を満たすものとみなします。

(4) 公募開始日直前の決算期末以降の経営の状況その他考査等から得られた情報に照らし、自己資本比率、資本バッファ比率もしくは流動性カバレッジ比率が実質的に(3)に定める水準を下回るとみられる事情、その他信用力が十分でないと認められる特段の事情または別表に掲げる事項の検証結果等を踏まえて流動性リスク管理が適切でないと認められる特段の事情がないこと。

- 対象先の選定後、対象先等(対象先および対象先として選定された先であって所要の約定を未締結の先をいいます。以下同じです。)に合併その他の事由が生じた場合において、以上の基準に鑑み日本銀行が必要と認めるときは、当該対象先等から自己資本比率、その算出根拠資料その他の資料の提出を求めることがあります。
また、上記の基準に鑑み必要と認められる場合には、対象先等から除外すること等があります。

4. 応募

(1) 応募の方法

- 新規先(公募開始日現在の対象先でない先をいいます。以下同じです。)のうち、対象先となることを希望する先は、別添1の申請書を、2017年9月4日午後3時までに、本店その他国内における営業の本拠である営業所等の所在地を業務区域とする日本銀行本支店(本店の場合には金融市場局オペレーション企画担当部署(本店新館4F)、支店の場合には営業課または総務課)に提出して下さい。

—— 申請書については、一金融機関一枚の申請書をご提出頂きます。複数のオペの対象先となることを希望する先で、オペ毎に担当部署が異なる場合には、各担当部署でご相談のうえ、ご対応下さい。

- 既存先(公募開始日現在の対象先をいいます。以下同じです。)は、本年度も対象先となることを希望する場合には、改めて応募して頂く必要はありませんので、申請書の提出は不要です。

本年度は対象先となることを希望しない場合には、2017年8月21日午後3時までに、金融機関等名、部署名、担当者の氏名、電話番号および電子メールアドレスを記載のうえ、その旨を後掲の連絡先宛てに電子メールによりご連絡下さい。電子メールのタイトルは「金融市場調節取引の資格抹消の件(金融機関等名)」として下さい。

—— 既存先であって、上記の電子メールによる連絡を行わなかった先については、応募があったものとみなし、選定を行います。

(連絡先) 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
TEL : 03-3277-1277、03-3277-1272
E-mail : post.fmd26@boj.or.jp
住所 : 〒103-8660
東京都中央区日本橋本石町 2-1-1

- 申請書提出と併せて、5. (2) ②イ. (イ) から (ニ) までの市場プレゼンスに関する計数等を提出して頂く必要はありません。公募締切日以降、5. (2) に該当する場合は、日本銀行から応募先（申請書を提出した新規先および本年度も対象先となることを希望した既存先をいいます。以下同じです。）に対して改めて当該計数等の提出を依頼します。

—— この場合に提出して頂く書類書式を参考までに添付しています（別添2）。

(2) 応募に関する留意事項

- 応募頂くにあたり、原則、自己資本比率およびその算出根拠資料をご提出頂く必要はありません。ただし、次の①から④までの何れかに該当する場合には、これらの資料その他の日本銀行が必要とする資料を提出して下さい。

—— 提出資料については、別添3の2. を参照して下さい。

- ① 公募締切日において初回の決算期末が到来していない先
- ② 公募開始日直前の決算期末以降、他の法人との合併、他の法人からの事業の全部もしくは一部譲受け、他の法人への事業の一部譲渡、他の法人からの会社分割による事業の全部もしくは一部承継または他の法人への会社分割による事業の一部承継があった先（既に日本銀行に自己資本比率、その算出根拠資料その他の日本銀行が必要とする資料を提出済である先を除きます。）
- ③ 公募開始日直前の決算期末の自己資本比率等を、日本銀行に提出後、変更した先（変更後の自己資本比率等を日本銀行に提出済の先を除きます。）
- ④ ①から③までの先のほか、日本銀行が自己資本比率、その算出根拠資料その他の資料の提出を求めた先（資料の提出を求める場合には、日本銀行から個別に取扱いをご連絡します。）

5. 選定方法

(1) 応募先数が50先以内の場合

- 3. の必須基準を満たし、かつ2. の役割の遵守を確約している応募先数が50先以内の場合には、すべての応募先を対象先として選定します。

(2) 応募先数が50先を超える場合

- 3. の必須基準を満たし、かつ2. の役割の遵守を確約している応募先数が50先を超える場合には、下表の応募区分の別に応じ、対象先を選定します。

なお、2016年6月13日から2017年6月9日までの間にCP等買現先オペを実施しなかった（オファーベース）ことから、今回の公募においては、本年度も対象先となることを希望した既存先は全て下表の新規先として扱うこととします。

| 応募区分 | 該当する先 |
|---------------------------|---|
| 新規先 | 公募開始日現在でCP等買現先オペの対象先でない先 |
| <該当先なし> 既存先 (シード先) | 公募開始日現在でCP等買現先オペの対象先である先のうち、落札シェア ^(注2) が上位の先から順に、当該シェアの合計値が90%に達するまでの範囲に属する先 |
| <該当先なし> 既存先 (非シード先) | 公募開始日現在でCP等買現先オペの対象先である先のうち、既存先（シード先）以外の先 |

(注2) 公募開始日現在の対象先毎に、次の算式で算出します。

$$\text{ある対象先の落札シェア} = \frac{\text{ある対象先の落札総額}^{(注3)}}{\text{全対象先の落札総額}^{(注4)}} \times 100$$

(注3) 2016年6月13日から2017年6月9日までの間にある対象先にオファーを行った場合におけるCP等買現先オペにおける当該先の落札総額

(注4) 2016年6月13日から2017年6月9日までの間にある対象先にオファーを行った場合におけるCP等買現先オペにおける全対象先の落札総額

- 具体的には、次の①および②により対象先を選定します。

① 応募区分が既存先（シード先）<該当先なし>である応募先

▶ すべての応募先を対象先として選定します。

② 応募区分が既存先（非シード先）<該当先なし>または新規先である応募先

イ. 次の（イ）から（ニ）までの計数等^(注5)を点数化します（計数等の定義等は、別添3の1.を参照して下さい。）。

（イ）CP等の流通市場における取引高

- (ロ) CP等の流通市場における取引平均残高
- (ハ) CP等の流通市場における取引先数
- (ニ) CP等の流通市場におけるレート情報の市場参加者への提供状況

(注5) 日本銀行が提出を依頼する場合に提出して頂きます。

ロ. イ. (イ) から (ハ) までの計数の点数化方法

- 計数毎に次の算式で点数化します(満点は、(イ) : 40点、(ロ) : 20点、(ハ) : 20点とします。)。計数がゼロである先の点数はゼロ点とします。

| |
|---|
| $\text{(満点)} \times \frac{\text{応募先の順位}}{\text{計数がゼロでない先の数}}$ |
|---|

—— 上記の算式中の「応募先の順位」とは、イ. (イ) から (ハ) までの計数毎に、計数の小さい先(ただし、計数がゼロである先を除きます。) から順位を付したものをいいます。

ハ. イ. (ニ) のレート情報の提供状況の点数化方法

- 次の項目に該当する数に応じ、次の算式で点数化します。該当する項目がない先の点数はゼロ点とします。

| |
|---|
| (項目) |
| <ul style="list-style-type: none"> a. 複数の残存期間別のアウトライトレートを複数の格付け別に毎営業日提供していること b. 複数のターム別の現先レートを複数の格付け別に毎営業日提供していること |
| (算式) |
| $20 \text{ 点} \times \frac{\text{該当項目数}}{\text{新規先数} + \text{既存先 (非シード先) 数}}$ |

—— レート情報は、情報ベンダー(国内の市場参加者から提供を受けたわが国の金融市場に関する情報を、電子情報として利用者に対して提供することを業務とする者をいいます。) を通じて、または自社のウェブサイト提供されているものを対象とします(電子メール送付により提供されているレート情報は含めません。) 。

—— レート情報を提供している場合には、提供内容を確認できる資料等(日付が明示された営業日毎の提供画面のプリントアウト)を公募開始日以降計数等提出締切日^(注6)までの間における連続した5営業日分添付して下さい。

また、提供しているレート情報を閲覧するために専用のID等が必

要となる場合には、日本銀行金融市場局に当該 I D 等を貸与して下さい。

資料の添付がない場合もしくは添付の資料から提供内容が確認できない場合または閲覧用の I D 等の貸与が行われない場合には、レート情報は提供されていないものとして取扱います。

(注 6) 具体的な日付は、日本銀行が提出を依頼する場合に指定します。

ニ. 応募区分が新規先である応募先のうち対象先とする先

- 応募区分が既存先（非シード先）または新規先である応募先を、ロ. およびハ. による点数の合計値（以下「市場プレゼンス評価点」といいます。）の高い先から順位を付し、その順位が、対象先数（50 先）から①により対象先として選定した先の数を引いて得られる数以内の新規先である応募先を対象先として選定します。

—— 市場プレゼンス評価点と同じ先については、イ. (イ) の点数の高い先から順位を付します。

ホ. 応募区分が既存先（非シード先）である応募先のうち対象先から外す先

- 応募区分が既存先（非シード先）である応募先のうち、ニ. により対象先として選定した新規先との入替えにより対象先から外す先は、市場プレゼンス評価点と落札実績評価点（80 点満点）の合計値が低い先から順に選びます。
- 落札実績評価点は、次の算式で点数化します。落札実績がゼロである先の落札実績評価点はゼロ点とします。

| |
|---|
| $80 \text{ 点 (満点)} \times \frac{\text{応募先の順位}}{\text{落札実績がゼロでない既存先 (非シード先) 数}}$ |
|---|

—— 上記の算式中の「応募先の順位」とは、落札実績^(注7)の小さい先（ただし、落札実績がゼロである先を除きます。）から順位を付したものをいいます。

(注 7) 2016 年 6 月 13 日から 2017 年 6 月 9 日（オファーベース）までの間のある既存先（非シード先）の C P 等買現先オペの落札総額を、同期間の当該先に対する同オペの総オファー回数で除して算出。

—— 市場プレゼンス評価点と落札実績評価点の合計値が同じ先については、落札実績評価点の低い先から順に選びます。

6. その他

(1) 約定書等の貸与

- CP等買現先オペに関する約定書等の借覧を希望される場合には、2017年7月19日から9月1日午後3時までの間、貸与します。貸与の手続等は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にご照会下さい。

(2) 対象先の選定結果の通知および公表

- 対象先の選定結果は応募先に個別に通知します（原則として、新たに対象先となることを希望した先には申請書にご記入頂いた連絡先の第1順位の方に通知します。既存先には日本銀行金融市場オンラインにより通知します。）。また、対象先として選定した先は公表します。

<日本銀行金融市場オンラインを利用していない皆様へ>

CP等買現先オペの対象先となった場合には、日本銀行金融市場オンラインを利用させていただく予定です。日本銀行金融市場オンラインの導入準備には一定の期間を要しますので、日本銀行金融市場局までお早めにご連絡いただくようお願い致します。

以 上

流動性リスク管理のチェック・ポイント

| | |
|-------------------------------|---|
| 1. リスク管理にかかるガバナンス体制の整備 | <ul style="list-style-type: none"> (1) 流動性リスク管理を経営上の重要な要素として位置付け、経営陣が管理体制の整備に十分コミットしているか。 (2) リスク管理方針の策定、リスク管理責任者の設置と権限付与、経営陣への報告体制の確立といったリスク管理体制を適切に確立しているか。 (3) 流動性リスク許容度の設定や危機時のコンティンジェンシー・プランの策定が、基本的な流動性リスク管理方針と整合的か。 |
| 2. 流動性リスク・プロファイルの把握とバランスシート運営 | <ul style="list-style-type: none"> (1) 自行・社・庫の業務展開、ビジネスモデルに応じた流動性リスク・プロファイルの把握が適切に行われているか。 (2) 預金という安定的な資金調達源を持たない金融機関は、その流動性リスク・プロファイルに見合った頑健なリスク管理体制の構築に努めているか。 (3) 流動性に影響を及ぼし得る潜在的な要因へのリスク管理面での目配りは十分か。 (4) 資金の運用・調達構造自体、すなわち、運用・調達のバランス、期間別のミスマッチ、市場性調達への依存度等は調達力に見合っているか。 (5) 偶発債務の規模が調達力対比で過大でないか。 (6) 先行きの運用・調達方針では、資金調達面での限界を考慮に入れない形で、市場流動性が低く、資金化やポジション解消が困難化しやすい資産の積み上げが容認されていないか。 |
| 3. 日々の資金繰りの安定性確保 | <ul style="list-style-type: none"> (1) 必要な資金を安定的に調達し、円滑に決済を行いえているか。 (2) 調達レートの急激な上昇など取引レートに特段の動きはないか。 (3) 日々の要調達額が資金調達力との対比で過大になっていないか。 (4) 日本銀行適格担保を含む担保繰りに問題はないか。 (5) 業務内容や主な資金調達手段の特性を勘案したうえで、資金調達先の大口集中を避け、資金調達手段の分散化・多様化を図っているか。 (6) 日中流動性の管理を適切に行っているか。 (7) 補完貸付の常態的な利用により、補完貸付以外の調達手段を確保する努力を怠るなど、自律的な流動性リスク管理がおろそかになっていないか。 |
| 4. ストレス局面での対応力の強化 | <ul style="list-style-type: none"> (1) 様々なシナリオのもとでのストレステストを実施しているか。 (2) ストレステスト等を通じて想定される資金流出に対応して、資金化可能な流動資産を十分に確保しているか。 (3) 資金の出し手金融機関のリスク認識などの定性的情報を含め、「必要なときに、必要な資金を調達できるか」という資金アベイラビリティを確認しているか。 |

5. 緊急時における対応

- (1) 資金の逼迫度に見合った管理体制に移行する仕組みや業務運営において、緊急時の流動性面への影響を勘案する仕組みの整備を含めた適切なコンティンジェンシー・プランが策定されているか。
- (2) 調達環境の変化を適切に認識し、逼迫度に見合った管理体制に移行しているか。
- (3) 流動性面での制約の強まりを業務運営上勘案する仕組みが有効に機能しているか。
- (4) 実務上の対応において、逼迫度に見合ったポジション運営等、適切な流動性管理が行われているか。また、調達先・調達手段の拡充や資産売却等を含めて、追加的な流動性確保策が講じられているか。

6. グローバルな流動性リスク管理体制の整備（国際的に活動する金融機関）

- (1) 取扱通貨毎、海外拠点毎の流動性リスク・プロファイルを的確に把握しているか。
- (2) グループ内におけるクロスボーダー資金の量や期間構造を平時より把握しているか。
- (3) グループ内の資金活用が国際金融市場の環境変化によって受ける影響を把握しているか。
- (4) 危機時における各拠点間の資金融通について、グループ全体として整合的なかたちでコンティンジェンシー・プランを整備しているか。
- (5) 海外主要拠点での代替的調達手段は十分に確保されているか。

金融市場調節取引の対象先選定に係る申請書（2017年度）

1. 当方は、公募開始日現在において対象先でない金融市場調節取引のうち、下表の取引の対象先となることを希望します。

—— 公募開始日現在において対象先である金融市場調節取引については、記載不要です。

- ※・希望する金融市場調節取引の右欄に○を記入。
 ・共通担保オペ（全店貸付）の対象先となることを希望する場合は、加えて、希望する貸付店、取引店舗を記入。

| 金融市場調節取引の種類 | 希望記入欄 |
|-----------------------|----------------------------------|
| 共通担保オペ（全店貸付） | ・貸付店：日本銀行_____ ・取引店舗： 当方_____ |
| 共通担保オペ（本店貸付） | |
| 国債売買オペ | |
| 国庫短期証券売買オペ・ 国債現先オペ | |
| 国債補完供給 | |
| CP等買現先オペ | |
| 手形売出オペ | |

（金融機関等名、金融機関コード・4桁）

2. 当方は、以下の諸点を確約します。

- (1) 当方は、希望する金融市場調節取引の対象先に選定された場合には、選定された金融市場調節取引について、各金融市場調節取引の対象先選定基準・手続に掲げる役割を遵守します。
- (2) 当方は、希望する金融市場調節取引について、各金融市場調節取引の対象先選定基準・手続に掲げる必須基準を満たしています。
- (3) 当方は、日本銀行が必要と認める場合には、各金融市場調節取引の対象先選定に係る各流通市場における取引高、取引平均残高、取引先数、レート情報の提供内容もしくは売出手形等保有平均残高等の計数等または当該計数等を確認できる資料を速やかに提出します。
- (4) 当方は、日本銀行が必要と認める場合には、自己資本比率、その算出根拠資料その他の日本銀行が必要とする資料を速やかに提出します。

平成 年 月 日 ^(注1)

(金融機関等コード・4桁) _____

(金融機関等名) ^(注2)

(役職名・代表者)

_____ ^(注3) 印 ^(注4)

日本銀行金融市場局長 殿

- (注1) 申請書の提出日を記載して下さい。この記載がない場合には、日本銀行の受付印の日付を提出日とみなします。
- (注2) 日本銀行との当座預金取引において業務局または支店に届出済の印鑑届における金融機関等名を記載して下さい。また、外国銀行および外国法人である金融商品取引業者の場合には、届出済の和文呼称を使用して下さい。
- (注3) 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4) 代表者欄への支店長等の代理人名の記載は不可。印章は、日本銀行との当座預金取引において業務局または支店に届出済の代表者の印鑑届に押なつしているもの(署名鑑届出者については届出済の署名)を使用して下さい。

■ 金融市場調節取引の対象先選定に係る申請書および選定結果の通知^(注)に関する連絡先（優先順位を付けて2名まで記入して下さい。）

(注) 既存先には、日本銀行金融市場オンラインにより通知します。

| | 第1順位 | 第2順位 |
|-------------|------|------|
| 部署・役職 | | |
| 氏名 | | |
| 電話番号 | | |
| ファクシミリ番号 | | |
| E-mail アドレス | | |
| 住所：〒 | | |

■ CP等買現先オペにおいて短期社債等の振替を行うための口座の開設状況

※CP等買現先オペの対象先となることを希望する先は、該当する区分にチェック☑を記入。

1. 株式会社証券保管振替機構に短期社債等の振替を行うための口座を開設している「機構加入者」です。
2. 1. には該当しませんが、口座管理機関に短期社債等の振替を行うための口座を開設しています。口座を開設している口座管理機関は、_____です。
3. 1. および2. のいずれにも該当しません。

(金融機関等名)

CP等買現先オペの対象先選定に係る計数等

金融機関等名(金融機関等コード・4桁): _____ ()

1. 市場プレゼンス計数

(1) 取引高、取引平均残高、取引先数

単位: 億円^(注)

| | 2016 年 7月 | 8月 | 9月 | 10月 | 11月 | 12月 | 2017 年 1月 | 2月 | 3月 | 4月 | 5月 | 6月 |
|--------|-----------------|----|----|-----|-----|-----|-----------------|----|----|----|----|----|
| 取引高 | | | | | | | | | | | | |
| 取引平均残高 | | | | | | | | | | | | |

(注) 億円未満も含めて合算し、合計値の億円未満を切捨て

| | 2016年7月～2017年6月 |
|------|-----------------|
| 取引先数 | |

(2) レート情報の市場参加者への提供状況

① 提供状況(該当区分に「○」)

イ. 複数の残存期間別のアウトライトレートを複数の格付け別に毎営業日提供している

ロ. 複数のターム別の現先レートを複数の格付け別に毎営業日提供している

② ①のイ. またはロ. に該当する場合には、その具体的な内容を以下に記入して下さい。

| 提供媒体 | パスワード・IDの可否、 情報ベンダーの画面コード等 | 提供内容の概要 |
|------|-------------------------------|---------|
| | | |

2. 本計数等に関する連絡先（優先順位を付けて2名まで記入して下さい。）

| | 第1順位 | 第2順位 |
|-------------|------|------|
| 部署・役職 | | |
| 氏名 | | |
| 電話番号 | | |
| ファクシミリ番号 | | |
| E-mail アドレス | | |

以上

金融機関等名

CP等買現先オペの対象先選定への応募にあたっての留意事項
(2017年度選定)

1. 「CP等買現先オペの対象先選定に係る計数等」の記入方法等

—— 日本銀行が提出を依頼する場合に提出して頂きます。

(1) CP等^(注)の流通市場における取引高(2016年7月～2017年6月)

(注) コマーシャル・ペーパー(資産担保コマーシャル・ペーパーおよび不動産投資法人コマーシャル・ペーパーを含みます。)、短期社債、保証付短期外債、政府保証付短期債券、資産担保短期債券および短期不動産投資法人債をいいます。以下同じです。

① CP等取引(次のイ. およびロ. の取引をいいます。以下同じです。)の新規成約高(額面・約定ベース)の月中合計として下さい。

イ. アウトライト取引(売戻条件を付さない買入および買戻条件を付さない売却をいいます。以下同じです。)

ロ. 現先取引(売戻条件付買入および買戻条件付売却をいいます。以下同じです。)

② 計数の算出に当たっては、次の点にご注意下さい。

イ. 現先取引については、スタート取引のみを含め、エンド取引は含めないこと(以下(2)においても同じです。)

ロ. 金融商品取引業者のうち所謂BBにおけるブローカー型の仲介取引は、片道ベースでの計数とすること(以下(2)においても同じです。)

ハ. CP等の発行時の引受額を除くこと。

ニ. 金融機関、金融商品取引業者、証券金融会社または短資業者が発行したCP等(政府保証付短期債券は除きます。)の取引を除くこと(以下(2)、(3)においても同じです。)

ホ. 媒介業務による取引を除くこと(以下(2)、(3)においても同じです。)

ヘ. 信託勘定で行った取引を除くこと(以下(2)、(3)においても同じです。)

- ト．日本銀行との取引を含めること（以下(2)、(3)においても同じです。）。
- ③ 2016年7月1日から公募締切日までの間に、応募先が次に該当する場合の取扱い（該当する場合には、その旨を明記して下さい。また、以下の取扱いは、(2)においても同じです。）
- イ．（イ）他の法人との合併、（ロ）他の法人からの事業の全部譲受けまたは（ハ）他の法人からの会社分割による事業の全部承継があった場合
- （イ）から（ハ）までに関係する各法人が、2016年7月1日から2017年6月30日までの間にCP等取引を行ったときは、当該各法人の取引高の合計として下さい（ただし、当該各法人間の取引は除いて下さい。）。
- ロ．（イ）他の法人からの事業の一部譲受けまたは（ロ）他の法人からの会社分割による事業の一部承継があった場合（一部譲受けまたは一部承継が行われた時点を「移管時点」といいます。以下同じです。）
- 譲渡会社または分割会社が、一部譲渡または一部承継に伴い応募先が移管を受けたCP等取引に関する取引先と、2016年7月1日から移管時点まで（移管時点が2017年6月30日より前のとき。）または2016年7月1日から2017年6月30日まで（移管時点が2017年6月30日以後のとき。）の間に行った取引高を加算して下さい。
- ハ．（イ）他の法人への事業の一部譲渡または（ロ）他の法人への会社分割による事業の一部承継を行った場合
- 一部譲渡または一部承継後にCP等取引を行った先と、2016年7月1日から2017年6月30日までの間に行った取引高のみとして下さい。
- ただし、当該先との取引を一部譲渡または一部承継を行った相手に引継ぐことが一部譲渡または一部承継の契約上定められている場合には、当該取引は算入しないで下さい。

(2) CP等の流通市場における取引平均残高（2016年7月～2017年6月）

- ① 現先取引の取引平均残高（額面・受渡ベース）として下さい。
- ② 取引平均残高とは、算出月の1日から算出月の末日までの日々の現先取引の残高を合計し、これを暦日数で除した値（円位未満切捨て）をいいます。なお、営業日以外の日（土曜日、日曜日および祝日）の残高は、その直前の営業日の残高として下さい。

(3) CP等の流通市場における取引先数(2016年7月~2017年6月)

- ① アウトライト取引および現先取引の取引先の数として下さい。
- ② 取引先数の算出に当っては、次の点にご注意下さい。
 - イ. 同一先との複数回の取引は1つとして数えること(名寄せベース)。
 - ロ. CP等発行引受時の発行先を除くこと。
 - ハ. 法人単位・約定ベースとし、個人との取引は除くこと。
 - ニ. 信託勘定を有する金融機関の信託勘定および銀行勘定の双方との取引がある場合には、取引先数は1先として数えること。
なお、信託勘定を通じた投信等との取引も、当該信託勘定を有する金融機関との取引として数えます。
 - ホ. 業務を停止した取引先についても、2016年7月1日から2017年6月30日までの間にCP等取引があれば取引先として数えること。
- ③ 2016年7月1日から2017年6月30日までに、応募先の取引先が次に該当する場合の取扱い
 - イ. 応募先の取引先が、上記期間中に新設合併または新設分割により事業の全部を承継した場合において、応募先が、合併・分割元の法人および合併・分割後の法人と上記期間中にCP等取引を行ったとき
 - 合併・分割元の法人数と合併・分割後の法人数を取引先数として下さい(例えば、2社が新設合併して1社が設立される場合において、そのすべてとCP等取引があるときは、取引先数は3先となります。)
 - ロ. 応募先の取引先が、上記期間中に(イ)他の法人に吸収合併された場合、(ロ)他の法人を吸収合併した場合、(ハ)他の法人に事業の全部を譲渡した場合、(ニ)他の法人の事業の全部を譲受けた場合、(ホ)他の法人に会社分割により事業の全部を承継させた場合または(ヘ)他の法人から会社分割により事業の全部を承継した場合において、応募先が、(イ)から(ヘ)までに関係する各法人の何れとも同期間中にCP等取引を行ったとき
 - (イ)から(ヘ)までが行われる前の取引先の数を取引先数として下さい(例えば、合併元2社のうち1社を存続会社とする吸収合併の場合において、当該合併元2社何れともCP等取引を行ったときは、取引先数は2先となります。)
- ④ 2016年7月1日から公募締切日までの間において、応募先が次に該当する場合の取扱い(該当する場合には、その旨を明記して下さい。関係する各法人の取引先は名寄せして下さい。)

イ. (イ) 他の法人との合併、(ロ) 他の法人からの事業の全部譲受けまたは(ハ) 他の法人からの会社分割による事業の全部承継があった場合

→ (イ) から(ハ) までに関係する各法人が、2016年7月1日から2017年6月30日までの間にCP等取引を行ったときは、当該各法人の取引先数の合計として下さい(ただし、当該各法人間で取引を行ったときは、当該各法人は除いて下さい。)

ロ. (イ) 他の法人からの事業の一部譲受けまたは(ロ) 他の法人からの会社分割による事業の一部承継があった場合

→ 一部譲渡または一部承継に伴い応募先が移管を受けたCP等取引に関する取引先のうち、譲渡会社または分割会社が2016年7月1日から移管時点まで(移管時点が2017年6月30日より前のとき。)または2016年7月1日から2017年6月30日まで(移管時点が2017年6月30日以後のとき。)の間に取引を行った取引先数を加算して下さい。

ハ. (イ) 他の法人への事業の一部譲渡または(ロ) 他の法人への会社分割による事業の一部承継を行った場合

→ 一部譲渡または一部承継後にCP等取引を行った取引先数として下さい。
ただし、一部譲渡または一部承継後にCP等取引を行った先であっても、当該取引先を一部譲渡または一部承継を行った相手に引継ぐことが一部譲渡または一部承継の契約上定められているときは、当該先は算入しないで下さい。

(4) CP等の流通市場におけるレート情報の市場参加者への提供状況

○ レート情報は、情報ベンダー(国内の市場参加者から提供を受けたわが国の金融市場に関する情報を、電子情報として利用者に対して提供することを業務とする者をいいます。)を通じて、または自社のウェブサイト提供されているものを対象とします(電子メール送付により提供されているレート情報は含めません。)

2. 自己資本比率等

○ 「CP等買現先オペの対象先選定基準・手続」4.(2)により、自己資本比率、その算出根拠資料その他の日本銀行が必要とする資料を提出する場合には、同4.(2)の①から④までの何れに該当するかを記した適宜の書面とともに、次の資料を提出して下さい。

(1) 日本銀行が指定する時点の自己資本比率等(実績値がない場合には、見込み

値または監督官庁に見込み値を提出済であるときはその数値。)、その算出根拠資料その他の日本銀行が必要とする資料

(2) 監督官庁に提出済の見込み値を提出する場合には、監督官庁への提出を証する書面

3. 対象先が合併、事業譲渡または会社分割を行う場合の取扱い

- 今回選定した対象先が、合併、事業譲渡または会社分割による事業の承継を行う場合において、合併後の存続会社、譲受会社または承継先（以下「新会社」といいます。）に対象先としての資格を移管することを希望するときは、新会社に対象先としての必須基準（「CP等買現先オペの対象先選定基準・手続」の3.（1）から（4）まで。）を満たしていること等を確認のうえ、次のとおり取扱います。
 - (1) 対象先が合併、事業（対象先が外国銀行または外国法人である金融商品取引業者である場合には、日本における事業をいいます。以下同じです。）の全部譲渡または会社分割による事業の全部承継を行う場合には、特段の問題がない限り、新会社に対象先としての資格を移管することを承認します。
 - (2) 対象先が、事業の一部譲渡または会社分割による事業の一部承継を行う場合において、CP等買現先オペに関する事業がその対象となるときは、その内容に様々な態様が考えられるため、一部譲渡または一部承継の内容を確認したうえで、新会社に対象先としての資格を移管することを承認するか否かを判断します。
- また、対象先が合併により非存続会社となる場合、事業譲渡において譲渡会社となる場合または会社分割において分割会社となる場合には、当該対象先とのCP等買現先オペについて、日本銀行および当該対象先における実務上のフィージビリティを確認する必要があります。また、確認の結果、オファーを見送ることがありますので、予めご承知おき下さい。
- 上記の場合を含め、対象先として選定した先が合併、事業譲渡または会社分割による事業の承継を行う場合には、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に前広にご連絡下さい。

以 上