2024年8月2日

日本銀行金融市場局

金融市場調節取引の2024年度対象先公募（定例選定）等について

目　　次

[第１章　定例選定の概要 2](#_Toc141267992)

[第２章　共通担保オペ（全店貸付）の対象先選定基準・手続等 8](#_Toc141267993)

[第３章　共通担保オペ（本店貸付）の対象先選定基準・手続等 10](#_Toc141267994)

[第４章　国債系オペ（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）の対象先選定基準・手続等 14](#_Toc141267995)

[第５章　ＣＰ等買現先オペの対象先選定基準・手続等 17](#_Toc141267996)

[第６章　手形売出オペの対象先選定基準・手続等 24](#_Toc141267997)

[第７章　ＥＴＦ貸付けの対象先選定基準・手続等 28](#_Toc141267998)

[第８章　国債系オペにおける決済代行者の定例承認 34](#_Toc141267999)

[第８章の２　国債系オペにおける決済代行者の定例承認基準・手続等 36](#_Toc141268000)

（別添）書式

# 第１章　定例選定の概要

## １．はじめに

* 日本銀行では、次のスケジュールで、下記の金融市場調節取引の対象先を公募し、現在の対象先を見直すこととしました（以下「定例選定」といいます。）（注１）（注２）。

**▼公募スケジュール**

|  |  |
| --- | --- |
| 公募開始日 | 2024年8月2日 |
| 資格抹消申出期限 | 2024年9月13日午後3時 |
| 公募締切日 | 2024年10月1日午後3時 |
| 選定結果の公表 | 2024年10月下旬以降の予定 |
| 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 |

**▼対象となる金融市場調節取引の種類**

|  |
| --- |
| 共通担保オペ（全店貸付・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 |
| 補完供給を目的として行う国債の買戻条件付売却（以下「国債補完供給」といいます。） |
| ＣＰ等買現先オペ |
| 手形売出オペ |
| 指数連動型上場投資信託受益権の貸付け（以下「ＥＴＦ貸付け」といいます。） |

（注１）各金融市場調節取引の取引方法等については、日本銀行ホームページ（https://www.boj.or.jp/）に掲載している次の資料をご覧下さい。

・「共通担保オペ（全店貸付）および共通担保オペ（本店貸付）の取引概要」

・「国債買入オペの取引概要」

・「国庫短期証券売買オペの取引概要」

・「国債現先オペの取引概要」

・「国債補完供給の取引概要」

・「ＣＰ等買現先オペの取引概要」

・「手形売出オペの取引概要」

・「ＥＴＦ貸付けの取引概要」

・「金融市場調節取引におけるオファー停止、対象先除外等の措置について」

（注２）国債売買オペ、国庫短期証券売買オペ・国債現先オペおよび国債補完供給（以下これらを「国債系オペ」と総称します。）における決済代行者の定例承認については、第８章および第８章の２をご覧下さい。

## ２．対象先の選定

各金融市場調節取引の対象先は、共通事項である本章および、それぞれ第２章から第７章までに記載の選定基準・手続等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、各章に記載の選定基準・手続等を適用することが不適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ごく例外的にあります。

### （１）各金融市場調節取引の対象先数

各金融市場調節取引について、対象先となることを希望する先の中から下表の対象先数を選定します。

|  |  |
| --- | --- |
| 対象先数 | 該当する金融市場調節取引 |
| 定め無し | 共通担保オペ（全店貸付）（注３）、国債系オペ |
| 50先 | 共通担保オペ（本店貸付）、ＣＰ等買現先オペ、手形売出オペ |
| 20先 | ＥＴＦ貸付け |

（注３）貸付希望店（共通担保オペ（全店貸付）の取引を行うことを希望する日本銀行本支店をいいます。以下同じです。）を日本銀行本店とする対象先および日本銀行支店とする対象先とも、特に先数を定めません。なお、対象先は、一法人当たり一店舗に限ります。

### （２）対象先としての役割

金融調節等を機動的・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（注４）。

イ．選定された金融市場調節取引に積極的に応札すること

ロ．正確かつ迅速に事務を処理すること

ハ．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

（注４）国債補完供給の対象先については、イ．を除きます。

各金融市場調節取引の対象先が、上記の役割に著しく背馳すると認められる場合その他の日本銀行が対象先との間で行う各金融市場調節取引の適切な運用を確保するうえで支障が生じ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、あるいは各金融市場調節取引の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

各金融市場調節取引の対象先は、それぞれ第２章から第７章までに記載の要件を満たしている必要があります。詳細は各章をご参照下さい。

### （４）選定方法

イ．国債補完供給

国債売買オペまたは国庫短期証券売買オペ・国債現先オペの2024年度対象先公募において、国債売買オペまたは国庫短期証券売買オペ・国債現先オペの対象先として選定した先であって、かつ、（２）の役割の遵守を確約しているすべての応募先（公募開始日現在対象先でない先（以下第１章から第７章までにおいて「新規先」といいます。）であって、申請書を提出した先および公募開始日現在対象先（以下第１章から第７章までにおいて「既存先」といいます。）であって、本年度も対象先となることを希望した先をいいます。以下同じです。）を対象先として選定します。

ロ．イ．を除く各金融市場調節取引

対象先数の定めがない、または、対象先数の定めがあるが、（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の数が（１）の対象先数以内の場合には、（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すべての応募先を対象先として選定します。

（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の数が（１）の対象先数を超える場合には、各金融市場調節取引の応募区分の別に応じ、対象先を選定します。この場合の具体的な選定方法については、各金融市場調節取引の選定基準・手続等をご参照下さい。

## ３．応募の方法

* 新規先のうち、対象先となることを希望する先は、別添１の申請書を、公募締切日までに、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（本店新館４Ｆ）に提出して下さい。

――　申請書については、一法人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金融市場調節取引がある場合には、資格抹消申出期限までに、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。ただし、こうした先においても、それぞれ第２章から第７章までに定める必須基準を満たしている必要がありますのでご留意下さい。特に、共通担保オペ（本店貸付）に関しては、第３章１.（４）の適格担保差入平残にかかる必須基準を満たしていることを確認するようにして下さい。

## ４．応募に関する留意事項

### （１）自己資本比率等

イ．応募頂くに当たり、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（イ）から（ニ）までのいずれかに該当する場合には、いずれに該当するかを記した適宜の書面とともに、ロ．の資料を提出して下さい。

（イ）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

（ロ）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。）

（ハ）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。）

（ニ）（イ）から（ハ）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。）

ロ．提出資料

（イ）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

（ロ）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

### （２）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、新会社が対象先としての必須基準（それぞれ第２章から第７章までを参照）を満たしていること等を確認（注５）のうえ、次のとおり取扱います。

（注５）国債補完供給については、国債売買オペもしくは国庫短期証券売買オペ・国債現先オペの対象先であること、または国債売買オペもしくは国庫短期証券売買オペ・国債現先オペの対象先としての資格の移管を受けることを承認されていること等を確認します。

イ．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。

ロ．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、資格の移管を希望する金融市場調節取引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、当該対象先との各金融市場調節取引について、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。

## ５．その他

### （１）随時選定

共通担保オペ（全店貸付）および国債系オペの対象先選定は、定例選定のほかにも随時行っていますが、定例選定中の2024年9月の第9営業日（9月12日）から定例選定結果の公表日までの間は、原則、随時選定を停止します（9月の第8営業日（9月11日）までは随時選定を受け付けます。）。随時選定の応募を希望される場合には、予め下記の照会先にご相談下さい。

――　①貸出支援基金の運営として行う貸出増加を支援するための資金供給または米ドル資金供給オペと併せて共通担保オペ（全店貸付）の対象先となることを希望する場合、②米ドル資金供給オペと併せて国庫短期証券売買オペ・国債現先オペの対象先となることを希望する場合には、上記の期間であっても、随時選定を受け付けます。

### （２）約定書等の貸与

各金融市場調節取引に関する約定書等の借覧を希望される場合には、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ご照会下さい。

### （３）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＞

各金融市場調節取引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して頂く予定です。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頂くようお願い致します。

|  |  |
| --- | --- |
| （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 |
|  | TEL：03-3277-3046、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 |

# 第２章　共通担保オペ（全店貸付）の対象先選定基準・手続等

## １．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。また、下記の基準に鑑み必要と認められる場合には、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。）から除外すること等があります。

（１）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。

・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。

・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。

・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。

（２）貸付希望店の当座預金取引先であること。

――　貸付希望店は、応募に当たり、日本銀行本支店の中から一店舗を指定して頂きます。

（３）貸付希望店との当座預金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。

（４）新たに対象先となることを希望する先については、2024年7月中（8月30日までに申請書を提出する場合）、8月中（9月2日から9月30日までの間に申請書を提出する場合）または9月中（10月1日に申請書を提出する場合）の適格担保差入平残が100万円以上であること。

――　適格担保差入平残の定義および確認方法は、２．を参照して下さい。

（５）公募開始日直前の決算期末（中間決算期末を含みます。以下この章において同じです。）において、自己資本比率等が「金融調節取引の対象先等に関する信用力要件」に定める要件を満たすこと、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、自己資本比率等が当該要件を満たすようになったと確認できること。

――　「金融調節取引の対象先等に関する信用力要件」は、日本銀行ホームページ（https://www.boj.or.jp/mopo/measures/select/index.htm/）に掲載しています。

――　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．いず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

（６）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、自己資本比率等が実質的に「金融調節取引の対象先等に関する信用力要件」に定める要件を満たしていないとみられる事情、その他信用力が十分でないと認められる特段の事情がないこと。

## ２．適格担保差入平残

* 適格担保差入平残とは、算出月の1日から算出月の末日までの日々の適格担保差入額（適格担保（注２）の担保価額合計額から代理店契約に基づく保証額および歳入代理店契約に基づく保証額の合計額を差引いた額をいいます。以下同じです。）（注３）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。

（注２）適格担保とは、日本銀行と金融機関等との間の「担保に関する基本約定」または「担保に関する基本約定（適格外国債券担保用）」に基づく担保をいいます。

（注３）営業日以外の日（土曜日、日曜日および祝日）の適格担保差入額は、その直前の営業日の適格担保差入額とします。

* 各営業日における適格担保差入額は、「所要担保価額」（日本銀行金融ネットワークシステムの業務処理区分「所要担保価額」（コード534201）の出力データです。「日本銀行金融ネットワークシステム利用細則（担保関係事務）」を参照して下さい。）により、算出できます。

▼　各営業日における適格担保差入額

**＝** 担保価額合計額―（代理店保証額（注４）＋歳入代理店保証額（注５））

（注４）与信種類コード「90」の所要担保価額

（注５）与信種類コード「91」の所要担保価額

* 2024年7月1日から同月31日までの間、8月1日から同月31日までの間または9月1日から同月30日までの間に、他の金融機関等との合併、他の金融機関等から事業の全部譲受けまたは他の金融機関等から会社分割による事業の全部承継を受けた応募先は、合併した金融機関等、事業の全部譲渡を行った金融機関等または会社分割による事業の全部承継を行った金融機関等の毎日の適格担保差入額を、自らの適格担保差入額に加えることができます。

# 第３章　共通担保オペ（本店貸付）の対象先選定基準・手続等

## １．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。また、下記の基準に鑑み必要と認められる場合には、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。）から除外すること等があります。

（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。

・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。

・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。

・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。

（２）日本銀行本店との当座預金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）日本銀行が行う共通担保オペ（全店貸付）の対象先であること。

（４）2024年7月中、8月中または9月中のうち、いずれか一つ以上の期間の適格担保差入平残が500億円以上であること。

―― 適格担保差入平残の定義および確認方法は、第２章２．を参照して下さい。

（５）公募開始日直前の決算期末（中間決算期末を含みます。以下この章において同じです。）において、自己資本比率等が「金融調節取引の対象先等に関する信用力要件」に定める要件を満たすこと、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、自己資本比率等が当該要件を満たすようになったと確認できること。

――　「金融調節取引の対象先等に関する信用力要件」は、日本銀行ホームページ（https://www.boj.or.jp/mopo/measures/select/index.htm/）に掲載しています。

――　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．いず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

（６）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、自己資本比率等が実質的に「金融調節取引の対象先等に関する信用力要件」に定める要件を満たしていないとみられる事情、その他信用力が十分でないと認められる特段の事情がないこと。

## ２．応募先の数が50先を超える場合の選定方法

* １．の必須基準を満たし、かつ第１章２．（２）の役割の遵守を確約している応募先の数が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、2023年7月3日から2024年6月28日までの間に共通担保オペ（本店貸付）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 | 公募開始日現在で共通担保オペ（本店貸付）の対象先でない先 |
| ＜該当先なし＞既存先（シード先） | 公募開始日現在で共通担保オペ（本店貸付）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） | 公募開始日現在で共通担保オペ（本店貸付）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。

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| ある対象先の落札シェア | ＝ | ある対象先の落札総額（注3） | × | 100 |
| 全対象先の落札総額（注4） |

（注３）2023年7月3日から2024年6月28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共通担保オペ（本店貸付）における当該先の落札総額。

（注４）2023年7月3日から2024年6月28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共通担保オペ（本店貸付）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）および（ロ）の計数等を点数化します。

（イ）適格担保差入平残

（ロ）共通担保オペ（全店貸付）の落札実績

ロ．イ．（イ）の計数の点数化方法

* 適格担保差入平残評価点は、次の算式で点数化します。

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 50点（満点）× | 応募先の順位 |  |
| 既存先（非シード先）および新規先数 |  |

──　上記の算式中の「応募先の順位」とは、応募先の適格担保差入平残（2024年7月中、8月中または9月中の適格担保差入平残のうち最も大きいもの）の小さい先から順位を付したものをいいます。

ハ．イ．（ロ）の計数の点数化方法

* 共通担保オペ（全店貸付）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。

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 50点（満点）× | 応募先の順位 |  |
| 落札実績がゼロでない既存先（非シード先）および新規先の数 |  |

――　上記の算式中の「応募先の順位」とは、共通担保オペ（全店貸付）の落札実績（注５）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５）2023年7月3日から2024年6月28日（オファーベース）までの間のある既存先（非シード先）および新規先の共通担保オペ（全店貸付）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。

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数を差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。

──　ロ．およびハ．による点数の合計値が同じ先については、ハ．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、ロ．およびハ．と共通担保オペ（本店貸付）落札実績評価点（100点満点）の合計値が低い先から順に選びます。
* 共通担保オペ（本店貸付）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。

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 100点（満点）× | 応募先の順位 |  |
| 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、共通担保オペ（本店貸付）の落札実績（注６）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６）2023年7月3日から2024年6月28日（オファーベース）までの間のある既存先（非シード先）の共通担保オペ（本店貸付）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。

──　適格担保差入平残評価点、共通担保オペ（全店貸付）落札実績評価点および共通担保オペ（本店貸付）落札実績評価点の合計値が同じ先については、共通担保オペ（本店貸付）落札実績評価点の低い先から順に選びます。

# 第４章　国債系オペ（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）の対象先選定基準・手続等

## １．国債売買オペの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。また、下記の基準に鑑み必要と認められる場合には、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。以下この章において同じです。）から除外すること等があります。

（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）。

（注）・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（以下この章において同じです。）。

・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（以下この章において同じです。）。

・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（以下この章において同じです。）。

・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（以下この章において同じです。）。

（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）国債振替決済制度の参加者（間接参加者を除きます。）であること（ただし、（５）の場合を除きます。）。

（４）国債資金同時受渡関係事務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（ただし、（５）の場合を除きます。）。

─―　なお、国債資金同時受渡関係事務における資金受入・払込先として、日本銀行本店との間で当座勘定取引を行う自己の店舗を指定している必要があります。

（５）売買に係る決済を委託する場合には、日本銀行が承認する金融機関に委託すること。

─―　国債売買オペに係る決済を他の金融機関に委託することを希望する場合には、第８章および第８章の２をご参照のうえ、決済代行者の承認のための申出等を別途行って下さい。

（６）公募開始日直前の決算期末（中間決算期末を含みます。以下この章において同じです。）において、自己資本比率等が「金融調節取引の対象先等に関する信用力要件」に定める要件を満たすこと、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、自己資本比率等が当該要件を満たすようになったと確認できること。

――　「金融調節取引の対象先等に関する信用力要件」は、日本銀行ホームページ（https://www.boj.or.jp/mopo/measures/select/index.htm/）に掲載しています。

─―　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．いず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

（７）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、自己資本比率等が実質的に「金融調節取引の対象先等に関する信用力要件」に定める要件を満たしていないとみられる事情、その他信用力が十分でないと認められる特段の事情がないこと。

## ２．国庫短期証券売買オペ・国債現先オペの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。また、下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。

（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。）。

（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）国債振替決済制度の参加者（間接参加者を除きます。）であること（ただし、（５）の場合を除きます。）。

（４）国債資金同時受渡関係事務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（ただし、（５）の場合を除きます。）。

─―　なお、国債資金同時受渡関係事務における資金受入・払込先として、日本銀行本店との間で当座勘定取引を行う自己の店舗を指定している必要があります。

（５）売買に係る決済を委託する場合には、日本銀行が承認する金融機関に委託すること。

─―　国庫短期証券売買オペ・国債現先オペに係る決済を他の金融機関に委託することを希望する場合には、第８章および第８章の２をご参照のうえ、決済代行者の承認のための申出等を別途行って下さい。

（６）公募開始日直前の決算期末において、自己資本比率等が「金融調節取引の対象先等に関する信用力要件」に定める要件を満たすこと、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、自己資本比率等が当該要件を満たすようになったと確認できること。

――　「金融調節取引の対象先等に関する信用力要件」は、日本銀行ホームページ（https://www.boj.or.jp/mopo/measures/select/index.htm/）に掲載しています。

─―　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．いず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

（７）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、自己資本比率等が実質的に「金融調節取引の対象先等に関する信用力要件」に定める要件を満たしていないとみられる事情、その他信用力が十分でないと認められる特段の事情がないこと。

## ３．国債補完供給の対象先としての必須基準

* 対象先は、国債売買オペの対象先または国庫短期証券売買オペ・国債現先オペの対象先である必要があります。
* 「１．国債売買オペの対象先としての必須基準」または「２．国庫短期証券売買オペ・国債現先オペの対象先としての必須基準」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。

# 第５章　ＣＰ等買現先オペの対象先選定基準・手続等

## １．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。また、下記の基準に鑑み必要と認められる場合には、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。）から除外すること等があります。

（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。

・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。

・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。

・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。

（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。以下この章において同じです。）において、自己資本比率等が「金融調節取引の対象先等に関する信用力要件」に定める要件を満たすこと、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、自己資本比率等が当該要件を満たすようになったと確認できること。

――　「金融調節取引の対象先等に関する信用力要件」は、日本銀行ホームページ（https://www.boj.or.jp/mopo/measures/select/index.htm/）に掲載しています。

─―　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．いず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

（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、自己資本比率等が実質的に「金融調節取引の対象先等に関する信用力要件」に定める要件を満たしていないとみられる事情、その他信用力が十分でないと認められる特段の事情がないこと。

## ２．応募先の数が50先を超える場合の選定方法

* １．の必須基準を満たし、かつ第１章２．（２）の役割の遵守を確約している応募先の数が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、2023年7月3日から2024年6月28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。

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| ある対象先の落札シェア | ＝ | ある対象先の落札総額（注３） | × | 100 |
| 全対象先の落札総額（注４） |

（注３）2023年7月3日から2024年6月28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）2023年7月3日から2024年6月28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、３．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）公募締切日以降、応募先の数が対象先数を超えた場合は、日本銀行から応募先に対して改めて当該計数等の提出を依頼します。申請書提出と併せて提出して頂く必要はありません。

──　この場合に提出して頂く書式を参考までに添付しています（別添２）。

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。

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| （満点） | × | 応募先の順位 |  |
| 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）

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

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 20点 | × | 該当項目数 |  |
| 新規先数 ＋ 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で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ＩＤ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ＩＤ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差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が同じ先については、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点（満点） | × | 応募先の順位 |  |
| 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）2023年7月3日から2024年6月28日（オファーベース）までの間のある既存先（非シード先）のＣＰ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。

## ３．ＣＰ等買現先オペの対象先選定に係る計数等

（１）ＣＰ等（注８）の流通市場における取引高（2023年8月～2024年7月）

（注８）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。）。

へ．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　2023年8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、2023年8月1日から2024年7月31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。以下この章において同じです。）

→　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、2023年8月1日から移管時点まで（移管時点が2024年7月31日より前のとき。）または2023年8月1日から2024年7月31日まで（移管時点が2024年7月31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、2023年8月1日から2024年7月31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（2023年8月～2024年7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（2023年8月～2024年7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たっては、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、2023年8月1日から2024年7月31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　2023年8月1日から2024年7月31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・分割後の法人数の和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（へ）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（へ）までに関係する各法人のいずれとも同期間中にＣＰ等取引を行ったとき

→　（イ）から（へ）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社いずれともＣＰ等取引を行ったときは、取引先数は2先となります。）。

④　2023年8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、2023年8月1日から2024年7月31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2023年8月1日から移管時点まで（移管時点が2024年7月31日より前のとき。）または2023年8月1日から2024年7月31日まで（移管時点が2024年7月31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で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。）。

# 第６章　手形売出オペの対象先選定基準・手続等

## １．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。また、下記の基準に鑑み必要と認められる場合には、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。以下この章において同じです。）から除外すること等があります。

（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。

・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。

・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。

・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。

（２）日本銀行本店の業務区域内にある自己の営業所等において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。以下この章において同じです。）において、自己資本比率等が「金融調節取引の対象先等に関する信用力要件」に定める要件を満たすこと、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、自己資本比率等が当該要件を満たすようになったと確認できること。

――　「金融調節取引の対象先等に関する信用力要件」は、日本銀行ホームページ（https://www.boj.or.jp/mopo/measures/select/index.htm/）に掲載しています。

─―　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．いず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

（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、自己資本比率等が実質的に「金融調節取引の対象先等に関する信用力要件」に定める要件を満たしていないとみられる事情、その他信用力が十分でないと認められる特段の事情がないこと。

## ２．応募先の数が50先を超える場合の選定方法

* １．の必須基準を満たし、かつ第１章２．（２）の役割の遵守を確約している応募先の数が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、2023年7月3日から2024年6月28日までの間に手形売出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 | 公募開始日現在で手形売出オペの対象先でない先 |
| ＜該当先なし＞既存先（シード先） | 公募開始日現在で手形売出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） | 公募開始日現在で手形売出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。

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| ある対象先の落札シェア | ＝ | ある対象先の落札総額（注３） | × | 100 |
| 全対象先の落札総額（注４） |

（注３）2023年7月3日から2024年6月28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手形売出オペにおける当該先の落札総額。

（注４）2023年7月3日から2024年6月28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手形売出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． 売出手形等保有平均残高（注５）（定義等は、３．を参照して下さい。）を次の算式で点数化します（満点は50点とします。）。売出手形等保有平均残高がゼロである先の点数はゼロ点とします。

（注５）公募締切日以降、応募先の数が対象先数を超えた場合は、日本銀行から応募先に対して改めて当該計数等の提出を依頼します。申請書提出と併せて提出して頂く必要はありません。

――　この場合に提出して頂く書式を参考までに添付しています（別添３）。

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 50点（満点）× | 応募先の順位 |  |
| 売出手形等保有平均残高がゼロでない先の数 |  |

──　上記の算式中の「応募先の順位」とは、売出手形等保有平均残高の小さい先（ただし、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。

ロ． 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、イ．による点数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。

──　イ．による点数の同じ先については、売出手形の保有平均残高の多い先から順位を付します。

ハ． 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、ロ．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、イ．による点数と落札実績評価点（50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。

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 50点（満点）× | 応募先の順位 |  |
| 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６）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６）2023年7月3日から2024年6月28日（オファーベース）までの間のある既存先（非シード先）の手形売出オペの落札総額を、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。

──　イ．による点数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。

## ３．売出手形等保有平均残高

（１）売出手形等保有平均残高とは、2023年8月1日から2024年7月31日までの間における日本銀行が売出した手形（以下「売出手形」といいます。）および国庫短期証券の保有平均残高の合計をいいます。

（２）売出手形等保有平均残高の算出に当たっては、次の点にご注意下さい。

①　無条件保有ならびに売戻条件付買入および金銭担保付借入による保有の月中平均残高（額面・受渡ベース。億円未満も含めて合算し、合計値の億円未満を切捨てて下さい。）を記載すること。

②　日本銀行の共通担保に差し入れている国庫短期証券については、業務終了時点の担保余裕額が国庫短期証券の担保差入額（担保価額（注７）ベース）を下回っている日には、「額面」に代えて「担保余裕額」を計上すること。

（注７）担保価額 ＝ 額面×（額面100円当たりの時価／100）×日本銀行が定める掛目

→　計数の算出は、応募先が自ら管理している担保差入額、額面および時価のデータに基づいて行って下さい。

③　売出手形等保有平均残高は、算出月の1日から算出月の末日までの日々の保有残高を合計し、これを暦日数で除し算出すること（円位未満切捨て）。なお、営業日以外の日（土曜日、日曜日および祝日）については、その直前の営業日の残高をその日の残高とすること。

④　買戻条件付売却または金銭担保付貸出を行っているものは含めないこと。

⑤　信託勘定で保有しているものは含めないこと。

（３）2023年8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（該当する応募先は、別添３「手形売出オペの対象先選定に係る計数等」の２．にその概要を記載して下さい。）

①　応募先に、（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、2023年8月1日から2024年7月31日までの間に売出手形または国庫短期証券の残高を有している場合には、当該各法人の合計計数を報告して下さい。

②　応募先に、（イ）他の法人からの事業の一部譲受け、（ロ）他の法人への事業の一部譲渡、（ハ）他の法人からの会社分割による事業の一部承継または（ニ）他の法人への会社分割による事業の一部承継があった場合

→　（イ）から（ニ）までに関係する各法人が、2023年8月1日から2024年7月31日までの間に売出手形または国庫短期証券の残高を有している場合には、当該各法人毎に計数を報告して下さい。

─―　（イ）から（ニ）までについては、その内容に様々な態様が考えられるため、譲受け、譲渡または承継の内容を踏まえ、日本銀行において当該先に係る計数を算出します。

# 第７章　ＥＴＦ貸付けの対象先選定基準・手続等

## １．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。また、下記の基準に鑑み必要と認められる場合には、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。）から除外すること等があります。

（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。

・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。

・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。

・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。

（２）日本銀行本店との当座預金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）株式等振替制度の加入者（株式会社証券保管振替機構が定める「株式等の振替に関する業務規程」第2条第16号に規定する加入者をいいます。）であること。

（４）決済照合システム（株式会社証券保管振替機構が行う有価証券の取引等の決済条件の照合等に関する業務を処理するシステムをいいます。）を利用していること。

（５）公募開始日直前の決算期末（中間決算期末を含みます。以下この章において同じです。）において、自己資本比率等が「金融調節取引の対象先等に関する信用力要件」に定める要件を満たすこと、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、自己資本比率等が当該要件を満たすようになったと確認できること。

――　「金融調節取引の対象先等に関する信用力要件」は、日本銀行ホームページ（http://www.boj.or.jp/mopo/measures/select/index.htm/）に掲載しています。

─―　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．いず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

（６）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、自己資本比率等が実質的に「金融調節取引の対象先等に関する信用力要件」に定める要件を満たしていないとみられる事情、その他信用力が十分でないと認められる特段の事情がないこと。

## ２．応募先の数が20先を超える場合の選定方法

* １．の必須基準を満たし、かつ第１章２．（２）の役割の遵守を確約している応募先の数が20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。

|  |  |
| --- | --- |
| 応募区分 | 該当する先 |
| 新規先 | 公募開始日現在でＥＴＦ貸付けの対象先でない先 |
| 既存先（シード先） | 公募開始日現在でＥＴＦ貸付けの対象先である先のうち、借入シェア（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 |
| 既存先（非シード先） | 公募開始日現在でＥＴＦ貸付け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。

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| ある対象先の借入シェア | ＝ | ある対象先の借入総額（注３） | × | 100 |
| 全対象先の借入総額（注４） |

（注３）2023年7月3日から2024年6月28日までの間のある対象先の平均借入額。

（注４）2023年7月3日から2024年6月28日までの間の全対象先の平均借入額。

* 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）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）または新規先である応募先

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

（イ）日本株等の借入残高

（ロ）日本株等の貸付残高

（ハ）日本株等の貸付先数

（注５）公募締切日以降、応募先の数が対象先数を超えた場合は、日本銀行から応募先に対して改めて当該計数等の提出を依頼します。申請書提出と併せて提出して頂く必要はありません。

──　この場合に提出して頂く書式を参考までに添付しています（別添４）。

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)：40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。

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| （満点） | × | 応募先の順位 |  |
| 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．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．による点数の合計値の高い先から順位を付し、その順位が、対象先数（20先）から①により対象先として選定した先の数を差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。

──　ロ．による点数の合計値が同じ先については、イ．（イ）の点数の高い先から順位を付します。

ニ．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、ハ．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、ロ．による点数と借入実績評価点（100点満点）の合計値が低い先から順に選びます。
* 借入実績評価点は、次の算式で点数化します。借入実績がゼロである先の借入実績評価点はゼロ点とします。

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 100点（満点） | × | 応募先の順位 |  |
| 借入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、借入実績（注６）の小さい先（ただし、借入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６）2023年7月3日から2024年6月28日までの間のある既存先（非シード先）のＥＴＦ貸付けの借入総額。

──　ロ．による点数と借入実績評価点の合計値が同じ先については、借入実績評価点の低い先から順に選びます。

## ３．ＥＴＦ貸付けの対象先選定に係る計数等

（１）日本株等の借入残高および貸付残高（2023年8月～2024年7月）

①　現金を担保とする日本株または日本株で構成される指数に連動する指数連動型上場投資信託受益権（以下「日本株等」といいます。）の証券貸借取引（取引相手の法域が日本であるものに限ります。また、個人との取引を除きます。以下同じです。）における各月末時点での残高（コラテラルサイドの金額）として下さい。

②　計数の算出に当たっては、次の点にご注意下さい。

イ．同一法人内の国内の内部取引は報告対象外とすること。

ロ．証券貸借取引とは、貸出者が、借入者に債券等を貸出し、当事者間で合意された期間を経た後、借入者が貸出者に同種・同量の債券等を返済する取引です。具体的には、基本契約書（MSLA、GMSLA、債券貸借取引に関する基本契約書、株券等貸借取引に関する基本契約書、その他各国の基本契約書をいいます。）に基づく取引をいいます。

――　ただし、上記契約書を使用していても、無担保取引については対象外とするほか、上記契約書に基づかない取引（制度信用取引に紐づく証券金融会社との貸借取引を含みます。）は報告対象外として下さい。

ハ．現金とは、円貨および外貨をいいます。

――　ただし、外貨の場合、日本円ベースに換算のうえ報告して下さい。なお、日本円への換算レートについては報告対象月の月末時点でのレートを利用して下さい。

ニ．日本株とは、国内の金融商品取引所に上場されている株式（日本法に準拠して設立された株式会社の発行する株式をいいます。）であって、円建てで発行されているものをいいます。

③　2023年8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（該当する場合は、その旨をご連絡下さい。）。

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）までに関係する法人が、2023年8月1日から2024年7月31日までの間に日本株等の借入または貸付けを行っていた場合、当該各法人の借入残高または貸付残高の合計を記入して下さい（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。以下この章において同じです。）

→　応募先が、一部譲受けまたは一部承継する事業に、日本株等の借入または貸付けが含まれている場合、当該法人が2023年8月1日から移管時点まで（移管時点が2024年7月31日より前のとき。）または2023年8月1日から2024年7月31日まで（移管時点が2024年7月31日以後のとき。）の間に行った借入残高または貸付残高を加算して記入して下さい（ただし、当該各法人間の取引は除いて下さい。）。

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

→　応募先が、一部譲渡または一部承継する事業に、日本株等の借入または貸付けが含まれている場合、当該借入または貸付けは算入しないで下さい。この場合、一部譲渡または一部承継後、2023年8月1日から2024年7月31日までの間に行った借入残高または貸付残高のみ記入して下さい。
　ただし、一部譲渡または一部承継後に日本株等の借入または貸付けを行った場合であっても、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、当該借入残高または当該貸付残高は算入しないで下さい。

（２）日本株等の貸付先数（2023年8月～2024年7月）

①　日本株等の証券貸借取引における貸付先数（2023年8月1日から2024年7月31日までの間に実際に取引を行った先数）として下さい。

②　貸付先数の算出に当たっては、次の点にご注意下さい。

イ．貸付先とは、株券等貸借取引に関する契約を締結している先をいいます。

ロ．同一先との複数回の取引は1つとして数えて下さい（名寄せベース）。

ハ．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、貸付先数は1先として数えて下さい。

ニ．業務を停止した貸付先についても、2023年8月1日から2024年7月31日までの間に日本株等の貸付けがあれば貸付先として数えて下さい。

③　2023年8月1日から2024年7月31日までに、応募先の貸付先が次に該当する場合の取扱い

イ．応募先の貸付先が、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・分割後の法人に対して、上記期間中に日本株等の貸付けを行ったとき

→　合併・分割元の法人数と合併・分割後の法人数の和を貸付先数として下さい（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、そのすべてに対して日本株等の貸付けがあるときは、貸付先数は3先となります。）。

ロ．応募先の貸付先が、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（へ）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（へ）までに関係する各法人のいずれに対しても、同期間中に日本株等の貸付けを行ったとき

→　（イ）から（へ）までが行われる前の貸付先の数を貸付先数として下さい（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社いずれに対しても日本株等の貸付けを行ったときは、貸付先数は2先となります。）。

④　2023年8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。関係する各法人の貸付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、2023年8月1日から2024年7月31日までの間に日本株等の貸付けを行ったときは、当該各法人の貸付先数の合計を記入して下さい（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

→　応募先が、一部譲受けまたは一部承継する事業に、日本株等の貸付けが含まれている場合、譲渡会社または分割会社が2023年8月1日から移管時点まで（移管時点が2024年7月31日より前のとき。）または2023年8月1日から2024年7月31日まで（移管時点が2024年7月31日以後のとき。）の間に貸付けた貸付先数を加算して記入して下さい。

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

→　応募先が、他の法人へ一部譲渡または一部承継する事業に、日本株等の貸付けが含まれている場合、当該貸付先数は算入しないで下さい。一部譲渡または一部承継後に貸付けを行った貸付先数をご記入下さい。
　ただし、一部譲渡または一部承継後に日本株等の貸付けを行った場合であっても、当該貸付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、当該貸付先は算入しないで下さい。

# 第８章　国債系オペにおける決済代行者の定例承認

## １．はじめに

* 日本銀行では、次のスケジュールで、国債系オペ（注）の2024年度対象先公募においてその対象先となった先が、国債系オペに関する決済を委託する決済代行者の2024年度定例承認を行うこととしました。

▼公募スケジュール

|  |  |
| --- | --- |
| 申出受付開始日 | 2024年8月2日 |
| 資格抹消申出期限 | 2024年9月13日午後3時 |
| 申出受付締切日 | 2024年10月1日午後3時 |
| 承認結果の通知 | 2024年10月下旬以降の予定 |
| 承認先との取引 | 承認結果の公表後所要の準備が整い次第開始 |

（注）国債系オペの取引方法等については、日本銀行ホームページ（https://www.boj.or.jp/）に掲載している次の資料をご覧下さい。

・「国債買入オペの取引概要」

・「国庫短期証券売買オペの取引概要」

・「国債現先オペの取引概要」

・「国債補完供給の取引概要」

・「金融市場調節取引におけるオファー停止、対象先除外等の措置について」

* 公募開始日現在、国債系オペに関する決済を決済代行者に委託する承認を受けている場合であって、本年度も決済代行者に委託する承認を受け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ので、別添５の申出書の提出は不要です。本年度は決済代行者に委託する承認を受けることを希望しない場合には、資格抹消申出期限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「国債系オペにおける決済代行の承認取り消しの件（金融機関等名）」として下さい。

――　公募開始日現在、国債系オペに関する決済を決済代行者に委託する承認を受けている場合であって、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．のとおり承認を行います。

## ２．決済代行者の承認

* 決済代行者は、「国債系オペにおける決済代行者の定例承認基準・手続等」（第８章の２）に基づき承認します。ただし、現段階では予見できない事情のために、同章に記載の承認基準・手続等を適用することが不適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承認を行うこと、または承認された決済代行者の見直し等を行うことがごく例外的にあります。

## ３．その他

* 国債系オペにおける決済代行者の承認は、定例承認のほかにも随時行っていますが、定例承認中の2024年9月の第9営業日（9月12日）から定例承認結果の公表日までの間は、原則、随時承認を停止します（9月の第8営業日（9月11日）までは随時承認を受け付けます。）。随時承認の応募を希望される場合には、予め下記の照会先にご相談下さい。

|  |  |
| --- | --- |
| （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 |
|  | TEL：03-3277-3046、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 |

# 第８章の２　国債系オペにおける決済代行者の定例承認基準・手続等

## １．決済代行者の数等

* 国債系オペの対象先が、国債系オペに関する決済を委託できる決済代行者は3先までとします。
* また、国債系オペの対象先が複数の国債系オペ（注１）の対象先である場合には、すべての国債系オペ（注１）に関する決済を同一の決済代行者に委託して下さい。

（注１）国債整理基金が行う国債買入を含みます。

## ２．決済代行者としての役割等

* 金融調節を機動的・効率的に遂行する観点から、決済代行者および当該決済代行者に決済を委託している国債系オペの対象先には、「適切に連携をとることにより正確かつ迅速に事務を処理すること」を求めます。
* 決済代行者および当該決済代行者に決済を委託している国債系オペの対象先が、上記の役割に著しく背馳すると認められる場合その他の国債系オペにおける代行決済の適切な運用を確保する上で支障が生じると認められる場合には、当該決済代行者および国債系オペの対象先に対して理由を示したうえで、当該決済代行者および国債系オペの対象先の双方に対して、次の措置を採ることがあります（注２）。

（注２）国債整理基金が行う国債買入についても同様に取扱います。

・決済代行者に対する措置・・・・・・・代行決済の停止、あるいは決済代行者の承認取消

・国債系オペの対象先に対する措置・・・オファーの見送り、あるいは対象先からの除外

* ただし、個別の事情を勘案し、帰責事由がないと認められる者については、上記の措置の対象外とします。

## ３．決済代行者としての必須基準

* 決済代行者は、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（注３）であること。

（注３）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。

（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）国債振替決済制度の参加者（間接参加者を除きます。）であること。

（４）国債資金同時受渡関係事務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。

─―　なお、国債資金同時受渡関係事務における資金受入・払込先として、日本銀行本店との間で当座勘定取引を行う自己の店舗を指定している必要があります。

（５）銀行法その他の法律により業務として為替取引を行うことが認められていること。

（６）申出受付開始日直前の決算期末（中間決算期末を含みます。以下この章において同じです。）において、自己資本比率等が「金融調節取引の対象先等に関する信用力要件」に定める要件を満たすこと、または、申出受付開始日直前の決算期末以降の増資等の事情により、自己資本比率等が当該要件を満たすようになったと確認できること。

――　「金融調節取引の対象先等に関する信用力要件」は、日本銀行ホームページ（https://www.boj.or.jp/mopo/measures/select/index.htm/）に掲載しています。

─―　申出受付開始日直前の決算期末の自己資本比率等が、申出受付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。

――　申出受付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、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との合併、当該他の金融機関からの事業の全部譲受けまたは当該他の金融機関からの会社分割による事業の全部承継を受けた先は申出が可能です。

（７）申出受付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、自己資本比率等が実質的に「金融調節取引の対象先等に関する信用力要件」に定める要件を満たしていないとみられる事情、その他信用力が十分でないと認められる特段の事情がないこと。

* 決済代行者の承認後、決済代行者、または決済代行者として承認された先であって所要の約定を未締結の先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、当該決済代行者から自己資本比率、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、決済代行者の承認を取消すこと等があります（注４）。

（注４）国債整理基金が行う国債買入についても同様に取扱います。

## ４．申出

（１）申出の方法

新規先（2024年度対象先公募において国債系オペの対象先となることを希望する先のうち、公募開始日現在において国債系オペに関する決済の委託をしていない先をいいます。以下同じです。）および当該新規先の決済代行希望者（国債系オペに関する決済の委託を受けることを希望する金融機関をいいます。以下同じです。）は、連名により、別添５の申出書を提出して下さい。

――　申出書は新規先および決済代行希望者のいずれから提出頂いても構いません。

既存先（2024年度対象先公募において国債系オペの対象先となることを希望する先のうち、公募開始日現在において国債系オペに関する決済の委託をしている先をいいます。以下同じです。）が、現在は対象先となっていない国債系オペについて、2024年度対象先公募において新たに当該国債系オペの対象先となることを希望する場合には、新規先と同様に、決済代行希望者と連名により、別添５の申出書を提出して下さい。

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| オペの種類（注５） | 申出書 | 提出先・提出締切日時 |
| 国債売買オペ | **別添５** | 金融市場局市場調節課オペレーション企画グループ（新館4F）2024年10月1日午後3時 |
| 国庫短期証券売買オペ・国債現先オペ |
| 国債補完供給 |
| 国債整理基金が行う国債買入 | **（注５）** |

（注５）希望先が国債整理基金が行う国債買入の対象先である場合には、別途届出を行って頂く必要があります。届出の手続等は、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）申出に関する留意事項

申出に当たっては、以下の点にご留意下さい。

①　決済代行希望者について

イ．決済代行希望者の数は3先までとして下さい。

ロ．希望先（新規先ならびに既存先のうち本年度も決済代行者の承認を受けることを希望する者および現在は対象先となっていない国債系オペについて2024年度対象先公募において新たに当該国債系オペの対象先となることを希望する者をいいます。以下同じです。）が対象先となることを希望するすべての国債系オペについて申し出て下さい。その際、決済代行希望者は同一の金融機関とするとともに、決済代行希望者の決済を行う営業所等および国債に係る代行決済口座区分（自己口Ⅰまたは預り口の別）も、同一の営業所等および代行決済口座区分として下さい。

②　自己資本比率等について

イ．申出受付締切日において、決済代行希望者が次の（イ）から（ニ）までのいずれかに該当するときは、決済代行希望者は、いずれに該当するかを記した適宜の書面とともに、ロ．の資料を提出して下さい。

（イ）申出受付締切日において初回の決算期末が到来していない先

（ロ）申出受付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。）

（ハ）申出受付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。）

（ニ）（イ）から（ハ）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。）

ロ．提出資料

（イ）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

（ロ）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　決済代行者が合併、事業譲渡または会社分割を行う場合の取扱い

* 今回承認した決済代行者が、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、当該決済代行者による代行決済について、日本銀行、当該決済代行者および当該決済代行者に決済を委託している国債系オペの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、当該決済代行者による代行決済を停止す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、決済代行者として承認した先が合併、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。

## ５．承認方法

* 希望先が国債系オペの対象先として選定された場合に、３．の必須基準を満たし、かつ、２．の役割の遵守を確約した決済代行希望者を、希望先が対象先として選定された国債系オペにおける決済代行者として承認します（注６）。

（注６）国債整理基金が行う国債買入についても同様に取扱います。

## ６．その他

（１）規則等の貸与

代行決済に係る規則等の借覧を希望される場合には、国債系オペの種類（注７）別に貸与します。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。なお、貸与した代行決済に係る規則等の転貸等は認めていませんので、希望先および決済代行希望者の双方が借覧を希望する場合には、個別にご照会下さい。

（注７）国債整理基金が行う国債買入を含みます。

（２）承認結果の通知

決済代行者の承認結果は決済代行希望者および希望先に通知します（原則として、決済代行希望先および新規先である希望先には申出書にご記入頂いた連絡先の第1順位の方に通知します。既存先である希望先には日本銀行金融市場オンラインにより通知します。）。

以　　上

（別添）書　　式

別添１

**金融市場調節取引の対象先選定に係る申請書（2024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 |  |
| ＥＴＦ貸付け |  |

（金融機関等名、金融機関等コード・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、定例選定の概要に掲げる対象先としての役割を遵守します。

（２） 当方は、希望する金融市場調節取引について、それぞれ各金融市場調節取引の対象先選定基準・手続等に掲げる対象先としての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、取引先数およびレート情報の提供内容、売出手形等保有平均残高または日本株等の借入残高、貸付残高および貸付先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。

　　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（１．においてＣＰ等買現先オペの右欄に○を記入した先）のみ、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。

以　　上

（金融機関等名）

別添２

**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）

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | 2023年8月 | 9月 | 10月 | 11月 | 12月 | 2024年1月 | 2月 | 3月 | 4月 |  5月 | 6月 | 7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

|  |  |
| --- | --- |
|  | 2023年8月～2024年7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

1. 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の要否、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 |  |  |

 金融機関等名

以　　上

別添３

**手形売出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．売出手形等保有平均残高**

単位：億円（注１）

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | 2023年8月 | 9月 | 10月 | 11月 | 12月 | 2024年1月 | 2月 | 3月 | 4月 |  5月 | 6月 | 7月 |
| 売出手形保有平均残高 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 国庫短期証券（注２）保有平均残高 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

（注１）億円未満も含めて合算し、合計値の億円未満を切捨て。

（注２）日本銀行の共通担保に差し入れている国庫短期証券については、業務終了時点の担保余裕額が国庫短期証券の担保差入額（担保価額ベース）を下回っている日には、「額面」に代えて「担保余裕額」を計上。詳細は、手形売出オペの対象先選定基準・手続等の３.参照。

**２.手形売出オペの対象先選定基準・手続等の３.（３）の該当の有無**

|  |
| --- |
| （該当の場合その概要を記入） |

**３．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ｱﾄﾞﾚｽ |  |  |

以　　上

別添４

**ＥＴＦ貸付け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．日本株等の借入残高および貸付残高**

（単位）億円（注）

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | 2023年8月 | 9月 | 10月 | 11月 | 12月 | 2024年1月 | 2月 | 3月 | 4月 |  5月 | 6月 | 7月 |
| 借入残高 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 貸付残高 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

（注）億円未満も含めて合算し、合計値の億円未満を切捨て

**２．日本株等の貸付先数（2023年8月～2024年7月）**

貸付先数： 先

**３．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

別添５

**国債系オペにおける決済代行者の定例承認に係る申出書**

　　　　　　（注１）（以下「甲」といいます。）は、下表の希望する国債系オペ（国債売買オペ、国庫短期証券売買オペ・国債現先オペまたは国債補完供給をいいます。以下同じです。）の対象先として選定された場合には、以下の1．を確約のうえ、下表の国債系オペについて、　（注２）（以下「乙」といいます。）を決済代行者とすることを希望します。

乙は、甲が国債系オペの対象先として選定された場合には、以下の1．から3．までを確約のうえ、甲が対象先として選定された国債系オペについて、甲の決済代行者となることを希望します。

乙が甲の国債系オペにおける決済代行者として承認された場合には、同オペに係る決済を行う営業所等は　　　　　（注３）とし、国債に係る代行決済口座区分は　　　　　（注４）　　　　　　とします。

　※希望する国債系オペの左欄に○を記入。

|  |
| --- |
| 甲が対象先となることを希望する国債系オペおよび乙を甲の決済代行者とすることを希望する国債系オペ |
|  | 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 |

（確約事項）

１.　甲および乙は、乙が甲の国債系オペにおける決済代行者として承認された場合には、国債系オペにおける決済代行者の定例承認基準・手続等の２．に掲げる役割を遵守します。

２.　乙は、国債系オペにおける決済代行者の定例承認基準・手続等の３．に掲げる基準を満たしています。

３.　乙は、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。

 　年 　 月　 日（注５）

 金融機関等名（甲）、金融機関等コード・4桁

 金融機関名（乙）、金融機関等コード・4桁

（金融機関等コード・4桁）

（金融機関等名）（注１）

（役職名・代表者）

　　　　　　　　　　　　　（注６）印（注７）

（金融機関等コード・4桁）

（金融機関名）（注２）

（役職名・代表者）

　　　　　　　　　　　　　（注６）印（注７）

日本銀行金融市場局長 殿

（注１）国債系オペの対象先となることを希望する者の名称（日本銀行との当座預金取引において業務局に届出済の印鑑届における金融機関等名）を記入して下さい。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２）（注１）記載の者が決済を委託する金融機関の名称（日本銀行との当座預金取引において業務局に届出済の印鑑届における金融機関名）を記入して下さい。外国銀行の場合には、届出済の和文呼称を使用して下さい。

（注３）（注２）記載の金融機関に属する営業所等のうち、日本銀行本店と当座預金取引を行っている営業所等の名称を記入して下さい。

（注４）自己口Ⅰまたは預り口の別を記入して下さい。

（注５）申出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６）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７）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。

|  |
| --- |
| 甲の連絡先（優先順位を付けて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． |  |  |  |  |
| 住所：〒 |

|  |
| --- |
| 乙の連絡先（優先順位を付けて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． |  |  |  |  |
| 住所：〒 |