

2007年10月11日
日 本 銀 行

「適格担保取扱基本要領」の一部改正等について

日本銀行は、本日、政策委員会・金融政策決定会合において、下記の諸措置を講ずることを決定しましたので、お知らせします。

本件は、適格担保の担保価格等について、新たに40年利付国債が発行されること等に対応するとともに、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所要の見直しを行うものです。

記

1. 「適格担保取扱基本要領」（平成12年10月13日決定）を別紙1のとおり一部改正すること。
2. 「国債の条件付売買基本要領」（平成14年9月18日決定）を別紙2のとおり一部改正すること。
3. 「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日決定）を別紙3のとおり一部改正すること。

以 上

<本件照会先>

企 画 局	菅野 (03-3277-3768)
	藤原 (03-3277-2813)
金 融 市 場 局	三木 (03-3277-1272)
	徳高 (03-3277-1277)

「適格担保取扱基本要領」中一部改正

- 別表 1 を横線のとおり改める。

別表 1

担保の種類および担保価格

1. 国債（変動利付国債、分離元本振替国債および分離利息振替国債ならびに物価連動国債を除く。）

- | | |
|---------------------------------|--------------------------------|
| (1) 略（不変） | |
| (2) 残存期間 1 年超 5 年以内のもの | 時価の <u>9.9 9.8%</u> |
| (3) } 略（不変） | |
| (4) } | |
| (5) 残存期間 20 年超 <u>30 年以内のもの</u> | 時価の <u>8.9 9.0%</u> |
| (6) <u>残存期間 30 年超のもの</u> | <u>時価の 8.7%</u> |

1-2. 変動利付国債

- | | |
|------------------------|--------------------------------|
| (1) 略（不変） | |
| (2) 残存期間 1 年超 5 年以内のもの | 時価の <u>9.9 9.8%</u> |
| (3) } 略（不変） | |
| (4) } | |

1-3. 分離元本振替国債および分離利息振替国債

- | | |
|---|--------------------------------|
| (1) 残存期間 5.1 年以内のもの | 時価の 9.8% |
| (2) 残存期間 5.1 年超 10.5 年以内のもの | 時価の <u>9.5 9.7%</u> |
| (3) 残存期間 10.5 年超 20.10 年以内のもの | 時価の <u>9.2 9.5%</u> |
| (4) 残存期間 20.10 年超 <u>20 年以内のもの</u> | 時価の <u>8.8 9.2%</u> |
| (5) <u>残存期間 20 年超 30 年以内のもの</u> | <u>時価の 8.6%</u> |
| (6) <u>残存期間 30 年超のもの</u> | <u>時価の 8.1%</u> |

1-4. 物価連動国債

(1) 残存期間 5 <u>1</u> 年以内のもの	時価の98%
(2) 残存期間 5 <u>1</u> 年超 10 <u>5</u> 年以内のもの	時価の 95 <u>97</u> %
(3) 残存期間 10 <u>5</u> 年超 20 <u>10</u> 年以内のもの	時価の 92 <u>95</u> %
(4) 残存期間 20 <u>10</u> 年超 <u>20</u> 年以内のもの	時価の 88 <u>92</u> %
<u>(5) 残存期間20年超30年以内のもの</u>	<u>時価の89%</u>
<u>(6) 残存期間30年超のもの</u>	<u>時価の86%</u>

2. 略 (不変)

3. 政府保証付債券

(1) 残存期間 5 <u>1</u> 年以内のもの	時価の98%
(2) 残存期間 5 <u>1</u> 年超 10 <u>5</u> 年以内のもの	時価の 95 <u>97</u> %
(3) 残存期間 10 <u>5</u> 年超 20 <u>10</u> 年以内のもの	時価の 92 <u>95</u> %
(4) 残存期間 20 <u>10</u> 年超 <u>20</u> 年以内のもの	時価の 88 <u>92</u> %
<u>(5) 残存期間20年超30年以内のもの</u>	<u>時価の89%</u>
<u>(6) 残存期間30年超のもの</u>	<u>時価の86%</u>

4. 地方債

(1) 残存期間 5 <u>1</u> 年以内のもの	時価の98%
(2) 残存期間 5 <u>1</u> 年超 10 <u>5</u> 年以内のもの	時価の 95 <u>97</u> %
(3) 残存期間 10 <u>5</u> 年超 20 <u>10</u> 年以内のもの	時価の 92 <u>95</u> %
(4) 残存期間 20 <u>10</u> 年超 <u>20</u> 年以内のもの	時価の 88 <u>92</u> %
<u>(5) 残存期間20年超30年以内のもの</u>	<u>時価の89%</u>
<u>(6) 残存期間30年超のもの</u>	<u>時価の86%</u>

5. 財投機関等債券

(1) 残存期間 5 <u>1</u> 年以内のもの	時価の97%
(2) 残存期間 5 <u>1</u> 年超 10 <u>5</u> 年以内のもの	時価の 94 <u>96</u> %
(3) 残存期間 10 <u>5</u> 年超 20 <u>10</u> 年以内のもの	時価の 91 <u>94</u> %
(4) 残存期間 20 <u>10</u> 年超 <u>20</u> 年以内のもの	時価の 87 <u>91</u> %
<u>(5) 残存期間20年超30年以内のもの</u>	<u>時価の88%</u>
<u>(6) 残存期間30年超のもの</u>	<u>時価の85%</u>

6. 社債

(1) 残存期間 5 <u>1</u> 年以内のもの	時価の97%
(2) 残存期間 5 <u>1</u> 年超 10 <u>5</u> 年以内のもの	時価の 94 <u>96</u> %
(3) 残存期間 10 <u>5</u> 年超 20 <u>10</u> 年以内のもの	時価の 91 <u>94</u> %
(4) 残存期間 20 <u>10</u> 年超 <u>20</u> 年以内のもの	時価の 87 <u>91</u> %
(5) <u>残存期間20年超30年以内のもの</u>	<u>時価の88%</u>
(6) <u>残存期間30年超のもの</u>	<u>時価の85%</u>

7. }
8. } 略（不変）

9. 資産担保債券

(1) 残存期間 5 <u>1</u> 年以内のもの	時価の97%
(2) 残存期間 5 <u>1</u> 年超 10 <u>5</u> 年以内のもの	時価の 94 <u>96</u> %
(3) 残存期間 10 <u>5</u> 年超 20 <u>10</u> 年以内のもの	時価の 91 <u>94</u> %
(4) 残存期間 20 <u>10</u> 年超 <u>20</u> 年以内のもの	時価の 87 <u>91</u> %
(5) <u>残存期間20年超30年以内のもの</u>	<u>時価の88%</u>
(6) <u>残存期間30年超のもの</u>	<u>時価の85%</u>

10. 略（不変）

11. 外国政府債券

(1) 残存期間 5 <u>1</u> 年以内のもの	時価の97%
(2) 残存期間 5 <u>1</u> 年超 10 <u>5</u> 年以内のもの	時価の 94 <u>96</u> %
(3) 残存期間 10 <u>5</u> 年超 20 <u>10</u> 年以内のもの	時価の 91 <u>94</u> %
(4) 残存期間 20 <u>10</u> 年超 <u>20</u> 年以内のもの	時価の 87 <u>91</u> %
(5) <u>残存期間20年超30年以内のもの</u>	<u>時価の88%</u>
(6) <u>残存期間30年超のもの</u>	<u>時価の85%</u>

12. 国際金融機関債券

(1) 残存期間 5 <u>1</u> 年以内のもの	時価の97%
(2) 残存期間 5 <u>1</u> 年超 10 <u>5</u> 年以内のもの	時価の 94 <u>96</u> %
(3) 残存期間 10 <u>5</u> 年超 20 <u>10</u> 年以内のもの	時価の 91 <u>94</u> %

- | | |
|--|-------------------------------|
| (4) 残存期間 20 <u>10</u> 年超 <u>20</u> 年以内のもの | 時価の 87 <u>91</u> % |
| (5) 残存期間 <u>20</u> 年超 <u>30</u> 年以内のもの | 時価の <u>88</u> % |
| (6) 残存期間 <u>30</u> 年超のもの | 時価の <u>85</u> % |

13. }
14. } 略（不変）

15. 企業に対する証書貸付債権

- | | |
|---------------------------|----------------------------------|
| (1) 当初貸付期間残存期間1年以内のもの | 残存元本額の <u>96</u> % |
| (2) 当初貸付期間残存期間1年超3年以内のもの | 残存元本額の 94 <u>90</u> % |
| (3) 当初貸付期間残存期間3年超5年以内のもの | 残存元本額の <u>80</u> % |
| (4) 当初貸付期間残存期間5年超7年以内のもの | 残存元本額の 70 <u>75</u> % |
| (5) 当初貸付期間残存期間7年超10年以内のもの | 残存元本額の 60 <u>65</u> % |
- (満期が応当月内に到来するものを含む。)

16. 交付税及び譲与税配付金特別会計に対する証書貸付債権

- | | |
|---------------------------|----------------------------------|
| (1) 当初貸付期間残存期間1年以内のもの | 残存元本額の <u>97</u> % |
| (2) 当初貸付期間残存期間1年超3年以内のもの | 残存元本額の 93 <u>92</u> % |
| (3) 当初貸付期間残存期間3年超5年以内のもの | 残存元本額の <u>85</u> % |
| (4) 当初貸付期間残存期間5年超7年以内のもの | 残存元本額の 75 <u>80</u> % |
| (5) 当初貸付期間残存期間7年超10年以内のもの | 残存元本額の 65 <u>70</u> % |
- (満期が応当月内に到来するものを含む。)

17. 預金保険機構に対する政府保証付証書貸付債権

- | | |
|---------------------------|----------------------------------|
| (1) 当初貸付期間残存期間1年以内のもの | 残存元本額の <u>97</u> % |
| (2) 当初貸付期間残存期間1年超3年以内のもの | 残存元本額の 93 <u>92</u> % |
| (3) 当初貸付期間残存期間3年超5年以内のもの | 残存元本額の <u>85</u> % |
| (4) 当初貸付期間残存期間5年超7年以内のもの | 残存元本額の 75 <u>80</u> % |
| (5) 当初貸付期間残存期間7年超10年以内のもの | 残存元本額の 65 <u>70</u> % |
- (満期が応当月内に到来するものを含む。)

18. 銀行等保有株式取得機構に対する政府保証付証
書貸付債権

- | | |
|------------------------------------|----------------------------------|
| (1) 当初貸付期間 <u>残存期間</u> 1年以内のもの | 残存元本額の97% |
| (2) 当初貸付期間 <u>残存期間</u> 1年超3年以内のもの | 残存元本額の 93 <u>92</u> % |
| (3) 当初貸付期間 <u>残存期間</u> 3年超5年以内のもの | 残存元本額の85% |
| (4) 当初貸付期間 <u>残存期間</u> 5年超7年以内のもの | 残存元本額の 75 <u>80</u> % |
| (5) 当初貸付期間 <u>残存期間</u> 7年超10年以内のもの | 残存元本額の 65 <u>70</u> % |
- (満期が応当月内に到来するものを含む。)

(特則)

略(不変)

○ 別表 2 を横線のとおり改める。

別表 2

担保の種類ごとの適格基準

担保の種類	適格基準
国債（変動利付国債、 分離元本振替国債およ び分離利息振替国債な らびに物価連動国債を 含む）	} 略（不変）
）	
外国政府債券 国際金融機関債券	
企業に対する証書貸付 債権	(1)および(2)を満たしていること。 (1) 略（不変） (2) 当初貸付期間 <u>残存期間</u> が 10 年以内のもの（満 期が応当月内に到来するものを含む。）である こと。
交付税及び譲与税配付 金特別会計に対する証 書貸付債権 預金保険機構に対する 政府保証付証書貸付債 権 銀行等保有株式取得機 構に対する政府保証付 証書貸付債権	当初貸付期間 <u>残存期間</u> が 10 年以内のもの（満期が応 当月内に到来するものを含む。）であること。

(附則)

この一部改正は、平成19年11月末までの総裁が別に定める日から実施する。ただし、企業に対する証書貸付債権、交付税及び譲与税配付金特別会計に対する証書貸付債権、預金保険機構に対する政府保証付証書貸付債権および銀行等保有株式取得機構に対する政府保証付証書貸付債権に係る一部改正は、平成20年2月末までの総裁が別に定める日から実施する。

「国債の条件付売買基本要領」中一部改正

○ 7. (2) を横線のとおり改める。

(2) 時価売買価格比率

時価売買価格比率は、買入または売却の別および売買国債の残存期間に応じ、次の別表1に定めるとおりとする。

イ. 買入の場合

(イ) 残存期間1年以内のもの	1. 002
(ロ) 残存期間1年超5年以内のもの	1. 006
(ハ) 残存期間5年超10年以内のもの	1. 019
(ニ) 残存期間10年超20年以内のもの	1. 036
(ホ) 残存期間20年超のもの	1. 057

ロ. 売却の場合

(イ) 残存期間1年以内のもの	0. 998
(ロ) 残存期間1年超5年以内のもの	0. 994
(ハ) 残存期間5年超10年以内のもの	0. 982
(ニ) 残存期間10年超20年以内のもの	0. 967
(ホ) 残存期間20年超のもの	0. 948

○ 8. (5) を横線のとおり改める。

(5) 担保価格

担保価格は、受入または差入の別およびならびに担保国債の種類および残存期間に応じ、次の別表2に定めるとおりとする。

イ. 受入の場合

(イ) 残存期間1年以内のもの	時価の99. 8%
(ロ) 残存期間1年超5年以内のもの	時価の99. 4%

（ハ）残存期間5年超10年以内のもの	時価の98.2%
（ニ）残存期間10年超20年以内のもの	時価の96.6%
（ホ）残存期間20年超のもの	時価の94.6%

ロ. 差入の場合

（イ）残存期間1年以内のもの	時価の100.2%
（ロ）残存期間1年超5年以内のもの	時価の100.6%
（ハ）残存期間5年超10年以内のもの	時価の101.8%
（ニ）残存期間10年超20年以内のもの	時価の103.4%
（ホ）残存期間20年超のもの	時価の105.4%

○ （附則）の次に次の別表1および別表2を加える。

別表1

時価売買価格比率

1. 買入の場合

(1) 残存期間1年以内のもの	1. 0 0 2
(2) 残存期間1年超5年以内のもの	1. 0 0 6
(3) 残存期間5年超10年以内のもの	1. 0 1 9
(4) 残存期間10年超20年以内のもの	1. 0 3 6
(5) 残存期間20年超のもの	1. 0 4 8

2. 売却の場合

(1) 残存期間1年以内のもの	0. 9 9 8
(2) 残存期間1年超5年以内のもの	0. 9 9 4
(3) 残存期間5年超10年以内のもの	0. 9 8 2
(4) 残存期間10年超20年以内のもの	0. 9 6 7
(5) 残存期間20年超のもの	0. 9 5 7

担保価格

1. 受入の場合

(1) 担保国債（変動利付国債、分離元本振替国債および分離利息振替国債ならびに物価連動国債を除く。）

イ. 残存期間1年以内のもの	時価の99.8%
ロ. 残存期間1年超5年以内のもの	時価の99.4%
ハ. 残存期間5年超10年以内のもの	時価の98.2%
ニ. 残存期間10年超20年以内のもの	時価の96.6%
ホ. 残存期間20年超30年以内のもの	時価の95.5%
ヘ. 残存期間30年超のもの	時価の93.4%

(2) 変動利付国債

イ. 残存期間1年以内のもの	時価の99.8%
ロ. 残存期間1年超5年以内のもの	時価の99.4%
ハ. 残存期間5年超10年以内のもの	時価の99.1%
ニ. 残存期間10年超20年以内のもの	時価の99.1%

(3) 物価連動国債

イ. 残存期間1年以内のもの	時価の98.8%
ロ. 残存期間1年超5年以内のもの	時価の98.2%
ハ. 残存期間5年超10年以内のもの	時価の97.0%
ニ. 残存期間10年超20年以内のもの	時価の95.2%
ホ. 残存期間20年超30年以内のもの	時価の93.4%
ヘ. 残存期間30年超のもの	時価の92.2%

2. 差入の場合

(1) 担保国債（変動利付国債、分離元本振替国債および分離利息振替国債ならびに物価連動国債を除く。）

イ. 残存期間1年以内のもの	時価の100. 2%
ロ. 残存期間1年超5年以内のもの	時価の100. 6%
ハ. 残存期間5年超10年以内のもの	時価の101. 8%
ニ. 残存期間10年超20年以内のもの	時価の103. 4%
ホ. 残存期間20年超30年以内のもの	時価の104. 5%
ヘ. 残存期間30年超のもの	時価の106. 6%

(2) 変動利付国債

イ. 残存期間1年以内のもの	時価の100. 2%
ロ. 残存期間1年超5年以内のもの	時価の100. 6%
ハ. 残存期間5年超10年以内のもの	時価の100. 9%
ニ. 残存期間10年超20年以内のもの	時価の100. 9%

(3) 物価連動国債

イ. 残存期間1年以内のもの	時価の101. 2%
ロ. 残存期間1年超5年以内のもの	時価の101. 8%
ハ. 残存期間5年超10年以内のもの	時価の103. 0%
ニ. 残存期間10年超20年以内のもの	時価の104. 8%
ホ. 残存期間20年超30年以内のもの	時価の106. 6%
ヘ. 残存期間30年超のもの	時価の107. 8%

(附則)

この一部改正は、平成19年11月末までの総裁が別に定める日から実施する。ただし、変動利付国債および物価連動国債に係る一部改正は、平成20年4月末までの総裁が別に定める日から実施する。

「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」中一部改正

○ 8. (2) を横線のとおり改める。

(2) 時価売却価格比率

時価売却価格比率は、売却国債の残存期間に応じ、次のとおりとする。

イ. }
 ㄱ } 略 (不変)
ニ. }

ホ. 残存期間 20 年超のもの

~~0.9480~~. 957

(附則)

この一部改正は、平成 19 年 11 月末までの総裁が別に定める日から実施する。