

2010年5月10日  
日 本 銀 行

## 「米ドル資金供給オペレーション基本要領」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、最近における国際金融資本市場の状況と、これが円市場の流動性に及ぼし得る影響に鑑み、金融調整の一層の円滑化を図るとともに、金融市場の円滑な機能の維持および安定性の確保に資するため、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。

### 記

1. 「米ドル資金供給オペレーション基本要領」を別紙1のとおり制定すること。
2. 「米ドル資金供給オペレーションにおける貸付対象先選定基本要領」を別紙2のとおり制定すること。
3. (1) 1.の「米ドル資金供給オペレーション基本要領」に基づく米ドル資金供給オペレーションを行うために必要な米ドル資金の調達のため、ニューヨーク連邦準備銀行との間で、別紙3の内容を骨子とする外国為替の売買（以下「スワップ取引」という。）に係る取極（以下「スワップ取極」という。）を締結すること。  
(2) スワップ取極に基づき本行が取得する米ドル建て資産および負債の期末における邦貨への換算については、会計規程（平成10年10月9日決定）第15条の定めにかかわらず、スワップ取引に適用

する外国為替相場を用いて行うこと。

- (3) スワップ取引の具体的な条件については、総裁が決定し、遅滞なく政策委員会に報告すること。

以 上

< 本件照会先 >

|           |                    |
|-----------|--------------------|
| 企 画 局     | 坂 本 (03-3277-2800) |
|           | 中尾根 (03-3277-3768) |
| 金 融 市 場 局 | 千 田 (03-3277-1244) |
|           | 福 田 (03-3277-1272) |

## 「米ドル資金供給オペレーション基本要領」

### 1．趣旨

この基本要領は、最近における国際金融資本市場の状況と、これが円市場の流動性に及ぼし得る影響に鑑み、金融調節の一層の円滑化を図るとともに、金融市場の円滑な機能の維持および安定性の確保に資する趣旨から、米ドル資金供給オペレーション（適格担保を根担保として行う公開市場操作としての米ドル建て貸付けをいう。）を行うために必要な基本的事項を定めるものとする。

### 2．貸付店

本店（国際局）とする。

### 3．貸付対象先

金融機関（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う。ただし、整理回収機構および預金保険法（昭和46年法律第34号）第2条第13項に規定する承継銀行を除く。）、金融商品取引業者（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う。）、証券金融会社（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う。）および短資業者（同項第4号に規定する者をいう。）のうち、別に定めるところにより選定した先とする。

### 4．貸付方式

電子貸付とする。

### 5．貸付期間

金融市場の情勢等を勘案して貸付けのつど決定する3か月以内の期間とする。

## 6．貸付利率および利息の徴収

### (1) 貸付利率

次のいずれかの方式による。

#### イ．金利入札方式

貸付利率を入札に付してコンベンショナル方式により決定する方式。ただし、ニューヨーク連邦準備銀行が指定する貸付期間に応じたドル・オーバーナイト・インデックス・スワップ市場における実勢金利をその下限とする。

#### ロ．固定金利方式

ニューヨーク連邦準備銀行が貸付期間に応じたドル・オーバーナイト・インデックス・スワップ市場における実勢金利を勘案して指定する利率を貸付利率とする方式。

### (2) 利息の徴収

(1)の定めにより決定された貸付利率によって、貸付日の翌日から返済期日までの日数に応じて、後取りの方法により行う。

## 7．貸付日および貸付金額等

貸付日、貸付金額、貸付先その他貸付けを行うために必要な具体的事項については、金融市場の情勢等を勘案して貸付けのつど決定するものとする。

## 8．担保

(1) 貸付対象先から、適格担保を根担保として差入れさせるものとする。

(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) 担保の差入れに当たり基準とする貸付金額の円貨換算額は、円・米ドルにかかる実勢為替相場に基づく円貨換算額に、貸付期間が1か月以下の場合は1.13、1か月超3か月以下の場合は1.25を乗じた金額とする。

#### 9. 米ドル資金の決済

貸付先との間の米ドル資金の受渡しは、本行および貸付先が各々指定したニューヨーク連邦準備銀行における米ドル口座を用いて行う。

#### (附則)

この基本要領は、本日より実施し、平成23年1月31日をもって廃止する。ただし、同日以前の日を貸付日とする貸付けの取扱いについては、なお従前の例による。

## 「米ドル資金供給オペレーションにおける貸付対象先選定基本要領」

### 1. 趣旨

この基本要領は、米ドル資金供給オペレーションに関する事務手続の明確化を図る趣旨から、「米ドル資金供給オペレーション基本要領」(平成22年5月10日付政委第38号別紙1.)に規定する貸付対象先(以下「対象先」という。)の選定を行うために必要な基本的事項を定めるものとする。

### 2. 対象先の選定基準等

対象先の選定に当っては、「共通担保資金供給オペレーションにおける貸付対象先選定基本要領」(平成18年4月11日付政委第31号別紙2.)に基づいて選定された共通担保資金供給オペレーション(本店貸付)の貸付対象先、同要領に基づいて選定された共通担保資金供給オペレーション(全店貸付)の貸付対象先のうち本行本店を貸付店とする先または「国庫短期証券売買および国債の条件付売買における売買対象先選定基本要領」(平成14年9月18日付政委第109号別紙2.)に基づいて選定された売買対象先で、かつ、米ドル資金供給オペレーションにかかる米ドルを本行との間で受渡しするために使用する口座としてニューヨーク連邦準備銀行に米ドル口座を保有する先(ニューヨーク連邦準備銀行に米ドル口座を保有する他の金融機関に受渡を委託する先を含む。)から、対象先となることを希望する先を公募し、その公募に応じた先を選定するものとする。

### 3. 対象先の遵守事項等

(1)対象先の公募に際しては、次に掲げる対象先としての遵守事項を明示するものとする。

イ、正確かつ迅速に事務を処理すること

ロ、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

(2) 対象先が(1)に掲げる事項に著しく背馳した場合には、対象先からの除外等の措置を講ずることができるものとする。

(3) (2)に定める場合のほか、2.に定める基準、「共通担保資金供給オペレーションにおける貸付対象先選定基本要領」2.に定める基準または「国庫短期証券売買および国債の条件付売買における売買対象先選定基本要領」2.に定める基準に鑑み必要と認められる場合には、対象先からの除外等の措置を講ずることができるものとする。

(附則) この基本要領は、本日より実施し、平成23年1月31日をもって廃止する。ただし、同日以前の日を貸付日とする貸付けの取扱いについては、なお従前の例による。

## ニューヨーク連邦準備銀行との間の為替スワップ取極要綱

### 1．取極の目的

金融市場の円滑な機能の維持および安定性の確保に資する観点から、日本銀行が取引先金融機関等に対して米ドル資金を供給するために当面必要とする米ドル資金の調達

### 2．取極の主体

日本銀行とニューヨーク連邦準備銀行

### 3．対象取引

ニューヨーク連邦準備銀行が日本銀行に対して米ドルを提供し、日本銀行がニューヨーク連邦準備銀行に対して円貨を提供する為替スワップ取引

### 4．為替スワップ取極の有効期限（引出可能期限）

平成 23 年 1 月 31 日

### 5．引出限度額

設定しない