

2011年12月21日

日本銀行

## 「カナダ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、最近における国際短期金融市場の状況と、これが円の金融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. 「カナダ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. 「カナダ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) カナダ銀行からカナダドル資金を調達するため、同行との間で、別紙3の要綱に基づく外国為替の売買（以下「スワップ取引」という。）にかかる取極（以下「スワップ取極」という。）を締結すること。  
(2) カナダ銀行に対して円資金を提供するため、同行との間で、別紙4の要綱に基づくスワップ取極を締結すること。
4. 「英ポンド資金供給オペレーション基本要領」を別紙5のとおり制定すること。
5. 「英ポンド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6のとおり制定すること。

6. (1) イングランド銀行から英ポンド資金を調達するため、同行との間で、別紙7の要綱に基づくスワップ取極を締結すること。  
(2) イングランド銀行に対して円資金を提供するため、同行との間で、別紙8の要綱に基づくスワップ取極を締結すること。
7. 「ユーロ資金供給オペレーション基本要領」を別紙9のとおり制定すること。
8. 「ユーロ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10のとおり制定すること。
9. (1) 欧州中央銀行からユーロ資金を調達するため、同行との間で、別紙11の要綱に基づくスワップ取極を締結すること。  
(2) 欧州中央銀行に対して円資金を提供するため、同行との間で、別紙12の要綱に基づくスワップ取極を締結すること。
10. 「スイスフラン資金供給オペレーション基本要領」を別紙13のとおり制定すること。
11. 「スイスフラン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14のとおり制定すること。
12. (1) スイス国民銀行からスイスフラン資金を調達するため、同行との間で、別紙15の要綱に基づくスワップ取極を締結すること。  
(2) スイス国民銀行に対して円資金を提供するため、同行との間で、別紙16の要綱に基づくスワップ取極を締結すること。
13. ニューヨーク連邦準備銀行に対して円資金を提供するため、同行との間で、別紙17の要綱に基づくスワップ取極を締結すること。
14. (1) 3.、6.、9.、12. および 13. のスワップ取極に基づき本行が取得するカナダドル、英ポンド、ユーロ、スイスフランおよび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。  
(2) 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 千 田 (03-3277-2800)

福 田 (03-3277-3768)

金 融 市 場 局 正 木 (03-3277-1234)

飯 島 (03-3277-1272)

## 「カナダ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、これが円の金融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、カナダドル資金供給オペレーション（適格担保を担保として行う公開市場操作としてのカナダ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

カナダ銀行が指定する利率とする。

### (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・カナダ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1.22、1か月超3か月以下の場合は1.27を乗じた金額とする。

## 9. カナダドル資金の決済

貸付先との間のカナダドル資金の受渡しは、本行および貸付先が各々指定したカナダ銀行におけるカナダ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25年2月1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。

## 「カナダ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、カナダ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、「カナダドル資金供給オペレーション基本要領」（平成23年12月21日付政委第104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、カナダドル資金供給オペレーションにかかるカナダ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カナダ銀行にカナダドル口座を保有する先（カナダ銀行にカナダ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25年2月1日をもって廃止する。ただし、同日以前に選定された対象先の取扱いについては、なお従前の例による。

「カナダ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カナダドル資金を供給するために当面必要とするカナダドル資金の調達

2. 取極の主体

日本銀行とカナダ銀行

3. 対象取引

カナダ銀行が日本銀行に対してカナダドルを提供し、日本銀行がカナダ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25年2月1日

5. 引出限度額

設定しない

「カナダ銀行との間の円資金提供のための為替スワップ取極要綱」

1. 取極の目的

円の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、カナダ銀行が円資金を供給するために当面必要とする円資金の提供

2. 取極の主体

日本銀行とカナダ銀行

3. 対象取引

日本銀行がカナダ銀行に対して円貨を提供し、カナダ銀行が日本銀行に対してカナダドル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25年2月1日

5. 引出限度額

設定しない

6. 為替スワップ取引の期間

最長88日後に上記3. の反対売買取引を実施（但し、双方の合意に基づき更新可）

## 7. 適用為替相場

約定日の市場実勢レート（更新の場合は、更新前の為替スワップ取引において適用したレート（但し、双方の合意に基づき変更可））。取引終了時にも同じレートを適用

## 8. 円資金の提供に伴う適用金利

日本銀行が指定する金利（更新の場合は、更新前の為替スワップ取引において適用した金利（但し、双方の合意に基づき変更可））

## 9. 資金決済の方法

### (1) 円資金

カナダ銀行が日本銀行に有するスワップ専用の海外預り金口座における入出金

### (2) カナダドル資金

日本銀行がカナダ銀行に有するスワップ専用のカナダドル口座における入出金

## 「英ポンド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、これが円の金融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、英ポンド資金供給オペレーション（適格担保を担保として行う公開市場操作としての英ポンド建て貸付けをいう。）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

イングランド銀行が指定する利率とする。

### (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・英ポンド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1.16、1か月超3か月以下の場合は1.22を乗じた金額とする。

## 9. 英ポンド資金の決済

貸付先との間の英ポンド資金の受渡しは、本行および貸付先が各々指定したイングランド銀行における英ポンド口座を用いて行う。

(附則)

この基本要領は、本日より実施し、平成25年2月1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。

## 「英ポンド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、英ポンド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、「英ポンド資金供給オペレーション基本要領」（平成23年12月21日付政委第104号別紙5.）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

対象先の選定に当たっては、「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、英ポンド資金供給オペレーションにかかる英ポンドを本行との間で受渡しするために使用する口座としてイングランド銀行に英ポンド口座を保有する先（イングランド銀行に英ポンド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25年2月1日をもって廃止する。ただし、同日以前に選定された対象先の取扱いについては、なお従前の例による。

「イングランド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英ポンド資金を供給するために当面必要とする英ポンド資金の調達

2. 取極の主体

日本銀行とイングランド銀行

3. 対象取引

イングランド銀行が日本銀行に対して英ポンドを提供し、日本銀行がイングランド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 25 年 2 月 1 日

5. 引出限度額

設定しない

「イングランド銀行との間の円資金提供のための為替スワップ取極要綱」

1. 取極の目的

円の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、イングランド銀行が円資金を供給するために当面必要とする円資金の提供

2. 取極の主体

日本銀行とイングランド銀行

3. 対象取引

日本銀行がイングランド銀行に対して円貨を提供し、イングランド銀行が日本銀行に対して英ポンド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 25 年 2 月 1 日

5. 引出限度額

設定しない

6. 為替スワップ取引の期間

最長 88 日後に上記 3. の反対売買取引を実施（但し、双方の合意に基づき更新可）

## 7. 適用為替相場

約定日の市場実勢レート（更新の場合は、更新前の為替スワップ取引において適用したレート（但し、双方の合意に基づき変更可））。取引終了時にも同じレートを適用

## 8. 円資金の提供に伴う適用金利

日本銀行が指定する金利（更新の場合は、更新前の為替スワップ取引において適用した金利（但し、双方の合意に基づき変更可））

## 9. 資金決済の方法

### (1) 円資金

イングランド銀行が日本銀行に有するスワップ専用の海外預り金口座における入出金

### (2) 英ポンド資金

日本銀行がイングランド銀行に有するスワップ専用の英ポンド口座における入出金

## 「ユーロ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、これが円の金融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、ユーロ資金供給オペレーション（適格担保を担保として行う公開市場操作としてのユーロ建て貸付けをいう。）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

欧州中央銀行が指定する利率とする。

### (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・ユーロ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か月以下の場合には1.16、1か月超3か月以下の場合には1.26を乗じた金額とする。

## 9. ユーロ資金の決済

貸付先との間のユーロ資金の受渡しは、本行および貸付先が各々指定したユーロシステム構成中央銀行（ユーロシステムを構成する欧州中央銀行および各国中央銀行をいう。）におけるユーロ口座を用いて行う。

（附則）

この基本要領は、本日より実施し、平成25年2月1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。

## 「ユーロ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、ユーロ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、「ユーロ資金供給オペレーション基本要領」（平成23年12月21日付政委第104号別紙9.）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

対象先の選定に当たっては、「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、ユーロ資金供給オペレーションにかかるユーロを本行との間で受渡しするために使用する口座としてユーロシステム構成中央銀行（ユーロシステムを構成する欧州中央銀行および各国中央銀行をいう。以下同じ。）にユーロ口座を保有する先（ユーロシステム構成中央銀行にユーロ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25年2月1日をもって廃止する。ただし、同日以前に選定された対象先の取扱いについては、なお従前の例による。

「欧州中央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ユーロ資金を供給するために当面必要とするユーロ資金の調達

2. 取極の主体

日本銀行と欧州中央銀行

3. 対象取引

欧州中央銀行が日本銀行に対してユーロを提供し、日本銀行が欧州中央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25年2月1日

5. 引出限度額

設定しない

「欧州中央銀行との間の円資金提供のための為替スワップ取極要綱」

1. 取極の目的

円の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、欧州中央銀行が円資金を供給するために当面必要とする円資金の提供

2. 取極の主体

日本銀行と欧州中央銀行

3. 対象取引

日本銀行が欧州中央銀行に対して円貨を提供し、欧州中央銀行が日本銀行に対してユーロ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25年2月1日

5. 引出限度額

設定しない

6. 為替スワップ取引の期間

最長88日後に上記3. の反対売買取引を実施（但し、双方の合意に基づき更新可）

## 7. 適用為替相場

約定日の市場実勢レート（更新の場合は、更新前の為替スワップ取引において適用したレート（但し、双方の合意に基づき変更可））。取引終了時にも同じレートを適用

## 8. 円資金の提供に伴う適用金利

日本銀行が指定する金利（更新の場合は、更新前の為替スワップ取引において適用した金利（但し、双方の合意に基づき変更可））

## 9. 資金決済の方法

### (1) 円資金

ユーロシステム構成中央銀行（ユーロシステムを構成する欧州中央銀行および各国中央銀行をいう。以下同じ。）が日本銀行に有するスワップ専用の海外預り金口座における入出金

### (2) ユーロ資金

日本銀行がユーロシステム構成中央銀行に有するスワップ専用のユーロ口座における入出金

## 「スイスフラン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、これが円の金融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、スイスフラン資金供給オペレーション（適格担保を担保として行う公開市場操作としてのスイスフラン建て貸付けをいう。）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

スイス国民銀行が指定する利率とする。

### (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・スイスフラン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1.16、1か月超3か月以下の場合は1.24を乗じた金額とする。

## 9. スイスフラン資金の決済

貸付先との間のスイスフラン資金の受渡しは、本行および貸付先が各々指定したスイス国民銀行におけるスイスフラン口座を用いて行う。

### (附則)

この基本要領は、本日より実施し、平成25年2月1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。

「スイスフラン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、スイスフラン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、「スイスフラン資金供給オペレーション基本要領」（平成23年12月21日付政委第104号別紙13.）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、スイスフラン資金供給オペレーションにかかるスイスフランを本行との間で受渡しするために使用する口座としてスイス国民銀行にスイスフラン口座を保有する先（スイス国民銀行にスイスフラン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25年2月1日をもって廃止する。ただし、同日以前に選定された対象先の取扱いについては、なお従前の例による。

「スイス国民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スイスフラン資金を供給するために当面必要とするスイスフラン資金の調達

2. 取極の主体

日本銀行とスイス国民銀行

3. 対象取引

スイス国民銀行が日本銀行に対してスイスフランを提供し、日本銀行がスイス国民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25年2月1日

5. 引出限度額

設定しない

「スイス国民銀行との間の円資金提供のための為替スワップ取極要綱」

1. 取極の目的

円の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、スイス国民銀行が円資金を供給するために当面必要とする円資金の提供

2. 取極の主体

日本銀行とスイス国民銀行

3. 対象取引

日本銀行がスイス国民銀行に対して円貨を提供し、スイス国民銀行が日本銀行に対してスイスフラン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25年2月1日

5. 引出限度額

設定しない

6. 為替スワップ取引の期間

最長88日後に上記3. の反対売買取引を実施（但し、双方の合意に基づき更新可）

## 7. 適用為替相場

約定日の市場実勢レート（更新の場合は、更新前の為替スワップ取引において適用したレート（但し、双方の合意に基づき変更可））。取引終了時にも同じレートを適用

## 8. 円資金の提供に伴う適用金利

日本銀行が指定する金利（更新の場合は、更新前の為替スワップ取引において適用した金利（但し、双方の合意に基づき変更可））

## 9. 資金決済の方法

### (1) 円資金

スイス国民銀行が日本銀行に有するスワップ専用の海外預り金口座における入出金

### (2) スイスフラン資金

日本銀行がスイス国民銀行に有するスワップ専用のスイスフラン口座における入出金

「ニューヨーク連邦準備銀行との間の円資金提供のための為替スワップ  
取極要綱」

1. 取極の目的

円の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、  
ニューヨーク連邦準備銀行が円資金を供給するために当面必要とする円資金  
の提供

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

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し、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 25 年 2 月 1 日

5. 引出限度額

設定しない

6. 為替スワップ取引の期間

最長 88 日後に上記 3. の反対売買取引を実施（但し、双方の合意に基づ

き更新可)

## 7. 適用為替相場

約定日の市場実勢レート（更新の場合は、更新前の為替スワップ取引において適用したレート（但し、双方の合意に基づき変更可））。取引終了時にも同じレートを適用

## 8. 円資金の提供に伴う適用金利

日本銀行が指定する金利（更新の場合は、更新前の為替スワップ取引において適用した金利（但し、双方の合意に基づき変更可））

## 9. 資金決済の方法

### (1) 円資金

ニューヨーク連邦準備銀行が日本銀行に有するスワップ専用の海外預り金口座における入出金

### (2) 米ドル資金

日本銀行がニューヨーク連邦準備銀行に有するスワップ専用の米ドル口座における入出金