

2013年10月31日
日本銀行

「米ドル資金供給オペレーション基本要領」等の一部改正について

日本銀行は、本日、政策委員会・金融政策決定会合において、金融調節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、外貨資金供給オペレーションおよび5中央銀行との間で締結している為替スワップ取極の期限等の見直しにつ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。

なお、本措置は、日本銀行が実施している固定金利方式の米ドル資金供給オペレーションの具体的な適用利率（貸付期間に応じたドル・オーバーナイト・インデックス・スワップ市場の実勢金利に0.5%ポイントを上乘せた水準）を現時点で変更するものではありません。

記

1. 「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日決定）を別紙1のとおり一部改正すること。
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」（平成22年5月10日決定）を別紙2のとおり一部改正すること。
3. 「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」（平成22年5月10日決定）を別紙3のとおり一部改正すること。
4. 「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」（平成23年12月21日決定）を別紙4のとおり一部改正すること。

5. 「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日決定）を別紙5のとおり一部改正すること。
6. 「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」（平成23年12月21日決定）を別紙6のとおり一部改正すること。
7. 「カナダ銀行との間の為替スワップ取極要綱」（平成23年12月21日決定）を別紙7のとおり一部改正すること。
8. 「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」（平成23年12月21日決定）を別紙8のとおり一部改正すること。
9. 「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日決定）を別紙9のとおり一部改正すること。
10. 「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」（平成23年12月21日決定）を別紙10のとおり一部改正すること。
11. 「イングランド銀行との間の為替スワップ取極要綱」（平成23年12月21日決定）を別紙11のとおり一部改正すること。
12. 「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」（平成23年12月21日決定）を別紙12のとおり一部改正すること。
13. 「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日決定）を別紙13のとおり一部改正すること。
14. 「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」（平成23年12月21日決定）を別紙14のとおり一部改正すること。
15. 「欧州中央銀行との間の為替スワップ取極要綱」（平成23年12月21日決定）を別紙15のとおり一部改正すること。
16. 「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」（平成23年12月21日決定）を別紙16のとおり一部改正すること。

17. 「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日決定）を別紙17のとおり一部改正すること。
18. 「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」（平成23年12月21日決定）を別紙18のとおり一部改正すること。
19. 「スイス国民銀行との間の為替スワップ取極要綱」（平成23年12月21日決定）を別紙19のとおり一部改正すること。
20. 「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」（平成23年12月21日決定）を別紙20のとおり一部改正すること。

以 上

<本件照会先>

企 画 局 上 口	(03-3277-2800)
二 宮	(03-3277-3768)
金 融 市 場 局 鈴 木	(03-3277-1234)
大 塚	(03-3277-1272)

「米ドル資金供給オペレーション基本要領」中一部改正

- 1. を横線のとおり改める。

1. 趣旨

(1) 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) この基本要領に基づく資金供給は、当分の間、これを行い得るものとする。

- 6. (1) を横線のとおり改める。

(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。~~

○ 附則を横線のとおり改める。

(附則)

~~この基本要領は、本日より実施し、平成26年2月1日をもって廃止するから実施する。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。~~

(附則)

この一部改正は、本日から実施する。

「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」中
一部改正

- 附則を横線のとおり改める。

(附則)

~~この基本要領は、本日より実施し、平成26年2月1日をもって廃止するから実施する。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。~~

(附則)

この一部改正は、本日から実施する。

「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」中
一部改正

○ 4. を横線のとおり改める。

4. 為替スワップ取極の有効期限（引出可能期限）

平成26年2月1日設定しない

（附則）

この一部改正は、本日から実施する。

「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」中一部改正

○ 4. を横線のとおり改める。

4. 為替スワップ取極の有効期限（引出可能期限）

平成26年2月1日設定しない

（附則）

この一部改正は、本日から実施する。

「カナダドル資金供給オペレーション基本要領」中一部改正

- 1. を横線のとおり改める。

1. 趣旨

(1) 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行う。）を行うために必要な基本的事項を定めるものとする。

(2) この基本要領に基づく資金供給は、当分の間、これを行い得るものとする。

- 附則を横線のとおり改める。

(附則)

~~この基本要領は、本日より実施し、平成26年2月1日をもって廃止するから実施する。ただし、同日以前の目を貸付目とする貸付けの取扱いについては、なお従前の例による。~~

(附則)

この一部改正は、本日から実施する。

「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」中
一部改正

○ 附則を横線のとおり改める。

(附則)

~~この基本要領は、本日より実施し、平成26年2月1日をもって廃止するから実施する。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。~~

(附則)

この一部改正は、本日から実施する。

「カナダ銀行との間の為替スワップ取極要綱」中一部改正

○ 4. を横線のとおり改める。

4. 為替スワップ取極の有効期限（引出可能期限）

平成26年2月1日設定しない

（附則）

この一部改正は、本日から実施する。

「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」中
一部改正

○ 4. を横線のとおり改める。

4. 為替スワップ取極の有効期限（引出可能期限）

平成26年2月1日設定しない

（附則）

この一部改正は、本日から実施する。

「英ポンド資金供給オペレーション基本要領」中一部改正

- 1. を横線のとおり改める。

1. 趣旨

(1) 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) この基本要領に基づく資金供給は、当分の間、これを行い得るものとする。

- 附則を横線のとおり改める。

(附則)

~~この基本要領は、本日より実施し、平成26年2月1日をもって廃止するから実施する。ただし、同日以前の目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。~~

(附則)

この一部改正は、本日から実施する。

「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」中
一部改正

- 附則を横線のとおり改める。

(附則)

~~この基本要領は、本日より実施し、平成26年2月1日をもって廃止するから実施する。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。~~

(附則)

この一部改正は、本日から実施する。

「イングランド銀行との間の為替スワップ取極要綱」 中一部改正

○ 4. を横線のとおり改める。

4. 為替スワップ取極の有効期限（引出可能期限）

平成26年2月1日設定しない

（附則）

この一部改正は、本日から実施する。

「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」中
一部改正

○ 4. を横線のとおり改める。

4. 為替スワップ取極の有効期限（引出可能期限）

平成26年2月1日設定しない

（附則）

この一部改正は、本日から実施する。

「ユーロ資金供給オペレーション基本要領」中一部改正

- 1. を横線のとおり改める。

1. 趣旨

(1) 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) この基本要領に基づく資金供給は、当分の間、これを行い得るものとする。

- 附則を横線のとおり改める。

(附則)

~~この基本要領は、本日より実施し、平成26年2月1日をもって廃止するから実施する。ただし、同日以前の目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。~~

(附則)

この一部改正は、本日から実施する。

「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」中
一部改正

- 附則を横線のとおり改める。

(附則)

~~この基本要領は、本日より実施し、平成26年2月1日をもって廃止するから実施する。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。~~

(附則)

この一部改正は、本日から実施する。

「欧州中央銀行との間の為替スワップ取極要綱」 中一部改正

○ 4. を横線のとおり改める。

4. 為替スワップ取極の有効期限（引出可能期限）

平成26年2月1日設定しない

（附則）

この一部改正は、本日から実施する。

「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」中
一部改正

○ 4. を横線のとおり改める。

4. 為替スワップ取極の有効期限（引出可能期限）

平成26年2月1日設定しない

（附則）

この一部改正は、本日から実施する。

「スイスフラン資金供給オペレーション基本要領」 中一部改正

- 1. を横線のとおり改める。

1. 趣旨

(1) 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) この基本要領に基づく資金供給は、当分の間、これを行い得るものとする。

- 附則を横線のとおり改める。

(附則)

~~この基本要領は、本日より実施し、平成26年2月1日をもって廃止するから実施する。ただし、同日以前の目を貸付目とする貸付けの取扱いについては、なお従前の例による。~~

(附則)

この一部改正は、本日から実施する。

「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」中一部改正

- 附則を横線のとおり改める。

(附則)

~~この基本要領は、本日より実施し、平成26年2月1日をもって廃止するから実施する。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。~~

(附則)

この一部改正は、本日から実施する。

「スイス国民銀行との間の為替スワップ取極要綱」 中一部改正

○ 4. を横線のとおり改める。

4. 為替スワップ取極の有効期限（引出可能期限）

平成26年2月1日設定しない

（附則）

この一部改正は、本日から実施する。

「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」中
一部改正

○ 4. を横線のとおり改める。

4. 為替スワップ取極の有効期限（引出可能期限）

平成26年2月1日設定しない

（附則）

この一部改正は、本日から実施する。