

2017年12月15日  
日 本 銀 行

「指数連動型上場投資信託受益権等買入等基本要領に定める  
信託の受託者の選定に関する細目」の一部改正について

日本銀行は、指数連動型上場投資信託受益権および不動産投資法人投資口の買入れ等にかかる受託者の選定を適切に行うとともに、その買入れ等を円滑に進める観点から、「指数連動型上場投資信託受益権等買入等基本要領に定める信託の受託者の選定に関する細目」（平成29年1月31日決定）を別紙. のとおり一部改正することとしましたので、お知らせします。

以 上

<本件照会先>

金融市場局市場調節課（03-3277-0055）

別紙.

「指数連動型上場投資信託受益権等買入等基本要領に定める信託の  
受託者の選定に関する細目」 中一部改正

○ 3. (1) を横線のとおり改める。

(1) 受託者は、2. (1) の公募に応じた者であって、次に掲げる要件を満  
たす者に限る。

イ、略（不変）

ロ、略（不変）

ハ、信用力に関する次の要件を満たすこと

(イ) 自己資本の充実

a. 銀行法（昭和56年法律第59号）第14条の2に掲げる基準に  
基づいて算出された連結および単体自己資本比率が、基準時点（受  
託者の選定を行う日（以下「選定日」という。）の直近の決算期末  
（中間期末を含む。以下同じ。）をいう。ただし、受託者の選定の  
応募締切日において直近の決算期末の当該計数が判明していない場  
合には、当該計数が判明している直近の決算期末とする。以下同じ。）  
において、国際統一基準が適用される先については普通株式等Tier  
1比率4.5%以上、Tier1比率6%以上および総自己資本比率8%  
以上、国内基準が適用される先については4%以上であること。た  
だし、~~審査等から得られた情報に照らし、同水準が一時的なものと  
認められるとき、当該基準時点以降の状況変化により信用力に問題  
が生じているときその他信用力に問題があると認められる特段の事  
情があるときはこの限りでない。~~

b. 法令により資本バッファ規制が適用される場合には、資本バッ  
ファ比率が、法令により定められた水準を満たすこと。ただし、  
資本バッファ比率が法令により定められた水準を満たさない場合  
であっても、その水準を満たすよう着実に改善すると認められると  
きは、本要件を満たすものとみなす。

(ロ) 流動性にかかる健全性

a. 流動性リスク管理が適切でないと認められる特段の事情がないこと。

b. 法令により流動性カバレッジ比率規制が適用される場合には、流動性カバレッジ比率が、基準時点において、法令により定められた水準を満たすこと。ただし、流動性カバレッジ比率が法令により定められた水準を満たさない場合であっても、その水準を満たすよう着実に改善すると認められるときは、本要件を満たすものとみなす。

(ハ) (イ) または (ロ) の要件を充足している場合であっても、考査等から得られた情報に照らし、信用力が十分でないと認められる特段の事情があるときは、各要件を満たすものとして扱わない。

ニ、基準時点において、金銭の信託、有価証券の信託または包括信託にかかる信託財産として所有する株式（他の法人に対する再信託または他の法人との共同での受託により当該他の法人に資産管理が委託されている株式を含む。）の貸借対照表価額の合計額が、~~5,000~~億円2兆4,000億円以上であること

ホ、略（不変）

へ、略（不変）

○ 3. (3) の次に次の (4) を加える。

(4) 受託者が本件の受託業務の一部を委託する場合（(3) に定める場合を除く。）には、当該委託の相手方（以下「事務委託先」という。）は、実質的な支配力または影響力に照らして、受託者と特に密接な関係を有すると本行が認める企業に限るほか、事務委託先においても (1) ホ、およびへ、の要件を満たさなければならない。

○ 5. を6. とし、4. を5. とし、3. の次に次の4. を加える。

4. 受託者の遵守事項

受託者の公募に際しては、次に掲げる受託者としての遵守事項を明示する

ものとする。

- (1) 本件の受託業務を正確かつ迅速に履行すること
- (2) 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
- (3) 買入対象である指数連動型上場投資信託受益権にかかる投資信託委託会社における最新の「「責任ある機関投資家」の諸原則<日本版スチュワードシップ・コード>」の受入れおよび実施の状況を報告すること

○ 5. (2) を横線のとおり改める。

- (2) (1) に定める信託契約の契約期間（契約期間を延長するときは、延長後の通算の契約期間をいう。以下同じ。）は、3年（(3) または6. に基づき新たな受託者を選定する場合には、新たな受託者が従前の受託者から円滑な信託財産の引継ぎ等を受けるために必要と認める期間を3年に加算した期間）を超えないものとする。

○ 6. を横線のとおり改める。

## 6. 信託の終了

次に掲げる事由のいずれかに該当する場合には、本行は信託を終了し、速やかに新たな受託者を選定することができる。

- (1) 受託者、または再信託の受託者または事務委託先が3. に定める要件を満たさなくなったとき
- (2) 略（不変）
- (3) 受託者が本件の受託業務を正確かつ迅速に履行していない4. に掲げる事項に著しく背馳したと本行が認めたとき
- (4) 略（不変）

(附則)

この一部改正は、平成29年12月15日から実施する。ただし、この一部改正前の本細目に基づき、現に受託者として選定されている先にかかる取扱いについては、なお従前の例による。