

平成 21 年 7 月 29 日
日 本 銀 行

「適格外国債券担保取扱要領」の実施日および適用開始日について

日本銀行は、「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 . .）の実施日を平成 21 年 7 月 31 日とするとともに、当該実施日から、同要領の適用を開始し、いわゆるクロスボーダー担保として、適格外国債券を適格担保として受け入れることとしました。

適格担保として受け入れた適格外国債券は、日本銀行の当座貸越、相対型電子貸付、共通担保資金供給オペレーション、代理店契約、歳入代理店契約、米ドル資金供給オペレーションまたは企業金融支援特別オペレーションにかかる債務を担保します（ただし、企業金融支援特別オペレーションの貸付限度額の算定対象となる担保種類には含まれません）。

なお、本件に関する実務上の取扱いについては、別途、関係金融機関等に対して通知します。

以 上

< 本件照会先 >

企 画 局 浜 野 (03-3277-1634)

(参 考) 適格外国債券を日本銀行の適格担保とするスキームの概要

1. 日本銀行は、各国国債（米・英・独・仏国債）の担保受入のために各国中央銀行（ニューヨーク連邦準備銀行、イングランド銀行、ドイツ Bundesbank、フランス銀行）に証券口座を開設。
2. 取引先金融機関等は、各国国債の証券集中保管機関（連邦準備銀行、ユーロクリアUK & アイルランド、クリアストリーム・フランクフルト、ユーロクリア・フランス）を通じて、保有している適格外国債券を日本銀行の証券口座に振り替える。

取引先金融機関等が、適格外国債券を日本銀行の証券口座に振り替えるよう、口座管理機関等^(注1)に指図。

(注1)証券集中保管機関が取引先金融機関等の口座管理機関等となる場合があります。

口座管理機関等は、適格外国債券を日本銀行の証券口座に振り替えるよう、証券集中保管機関に指図。

証券集中保管機関は、適格外国債券を各国中央銀行の証券口座に振替^(注2)。

(注2)国債の証券集中保管機関が中央銀行（連邦準備銀行）である米国国債の場合には、当該事務フローはありません。

各中央銀行は、日本銀行の証券口座に適格外国債券を振り替えるとともに、日本銀行に対して適格外国債券の受入れを通知。

日本銀行は、取引先金融機関等ごとに担保として受け入れた適格外国債券を管理するとともに、受け入れた適格外国債券の担保価額を算出し、「共通担保」の担保価額合計額に合算。

