

経済要録

国内

◆日本銀行、「本年6月の国債の利払日における日銀ネットのオンライン入力開始時刻等に関する通知について」を公表

日本銀行は、5月16日、本年6月の国債の利払日（6月20日）において日銀ネットのオンライン入力開始時刻の繰上げ措置等を実施することとし、当座勘定取引先、日銀ネット国債系オンライン利用先等に連絡するとともに、日本銀行ホームページ(<http://www.boj.or.jp/>)に掲載した。その内容は以下のとおり。

本年6月の国債の利払日における日銀ネットのオンライン入力開始時刻等に関する通知について

平成13年5月16日
日本銀行

日本銀行当座預金決済および国債決済は、RTGS化実施後、これまで事務・システム面での大きなトラブルもなく、円滑な決済が続いております。

さて、例年、3月、6月、9月および12月（以下「利払集中月」といいます。）の国債の利払日（以下単に「利払日」といいます。）においては、既発債を中心に国債決済件数が大幅に増加する傾向がみられます。このことを踏まえ、さる3月21日には、日本銀行では、事務の時間的制約を緩和する観点から、日本銀行金融ネットワークシステム（以下「日銀ネット」とい

ます。）のオンライン入力開始時刻の繰上げ措置等を実施しました。同日は、当座預金決済、国債決済ともに決済件数が予想どおりRTGS化実施後のピークを記録しましたが、取引先等からのご協力を得て、決済は順調に進捗しました。

これを踏まえ、日本銀行では、本年6月の利払日に当たる6月20日においても、円滑な決済の確保に万全を期す観点から、日銀ネットのオンライン入力開始時刻等に関し、3月21日と同様の次の措置を講じることとしました。

1. 日銀ネットのオンライン入力開始時刻^(注1)を午前8時とし、通常午前9時からオンライン入力を行うことのできるすべての電文について、オンライン入力を行うことを可能とすること。

(注1) オンライン入力締切時刻については変更ありません。すなわち、本年6月20日は利付国債の発行日に当たりますので、国債入力締切時刻は午後6時、5時同時処理にかかる入力締切時刻は午後6時30分です。

2. 日銀ネットの外国為替円決済制度関係事務のNET CREDIT LIMIT（ネット受取限度額）電文の初回の入力時間帯（午前8時30分から同8時45分）を午前7時30分から同7時45分とすること。
3. 以下に掲げる書面を午前8時より受け

ること。

- (1) 当座勘定振替依頼書
- (2) 国債振替決済振替指図書
- (3) 国債振替決済寄託書（登録国債による寄託）
- (4) 国債振替決済返還請求書（登録国債による返還）
- (5) 国債登録変更請求書
- (6) 質権関係登録請求書
- (7) 担保差入証書（振込国債）
- (8) 担保差入証書（登録国債）
- (9) 担保返戻依頼書（振込国債）
- (10) 担保返戻依頼書（登録国債）

今回のオンライン入力開始時刻の繰上げは、すべての日銀ネットの利用先に、午前8時に一斉に開局して頂くことをお願いするものではありません。各利用先等のご事情により、午前8時から同9時までの間に随時開局頂ければ結構です。この点、午前8時に開局して頂いた利用先が日銀ネットへの付記電文付振替依頼の入力を行った場合において、振替金受取人が日銀ネットの開局を行っていないときは、当該入力はエラーとなりますのでご注意ください。

なお、すでに公表したとおり、日本銀行では、本年8月以降、国債振替決済制度における利払口振替期間の短縮を実施する予定です^(注2)。これが実施されれば、利払集中月の利払日における国債決済の集中度合いは現在に比べ緩和するものと予想されます。したがって、現時点では、本年9月以降の利払集中月の利払日においては、今回のようなオンライン入力開始時刻の繰上げ措置等は不要になるものと見込んでおりますので、念のため申し添えます。

(注2) 「国債振替決済制度における利払口振替期間の短縮について」（平成13年4月4日付）を参照して下さい。

◆日本銀行、「当面の金融政策運営について」を公表

日本銀行は、5月18日、政策委員会・金融政策決定会合において、次回金融政策決定会合までの金融市場調節方針を下記のとおりとし、別添のとおり公表することを決定、同日対外公表を行った。また同会合において、金融政策判断の基礎となる経済及び金融の情勢に関する基本的見解を決定し、これを「金融経済月報」に掲載、5月21日に公表したほか、4月12日および13日に開かれた金融政策決定会合の議事要旨を承認し、これを5月23日に公表した。

記

日本銀行当座預金残高が5兆円程度となるよう金融市場調節を行う。

なお、資金需要が急激に増大するなど金融市場が不安定化するおそれがある場合には、上記目標にかかわらず、一層潤沢な資金供給を行う。

(別添)

当面の金融政策運営について

平成13年5月18日

日本銀行

日本銀行は、本日、政策委員会・金融政策決定会合において、次回金融政策決定会合までの金融市場調節方針を、以下のとおりとすること

を決定した（全員一致）。

日本銀行当座預金残高が5兆円程度となるよう金融市場調節を行う。

なお、資金需要が急激に増大するなど金融市場が不安定化するおそれがある場合には、上記目標にかかわらず、一層潤沢な資金供給を行う。

◆日本銀行、「金融市場調節の円滑化に向けた措置について」を公表

日本銀行は、5月18日、「金融市場調節の円滑化に向けた措置について」を公表した。その内容は以下のとおり。

金融市場調節の円滑化に向けた措置について

平成13年5月18日
日本銀行

日本銀行は、金融市場調節の円滑化を図る観点から、以下の措置を講ずることとしました。

1. 手形買入オペにおける手形期間の延長

本日開催された政策委員会・金融政策決定会合において、「手形買入基本要領」（平成12年4月27日決定）を別紙のとおり一部改正し、これまで「3か月以内」としていた手形期間を「6か月以内」に延長することを決定しました。本日より実施します。

2. 手形買入（本店買入）オペにおける買入対象先数の拡大等

先般締切った手形買入（本店買入）オペの買入対象先の募集には、多くの先から応募をいた

だきました。日本銀行としては、手形買入（本店買入）オペの買入対象先を拡大することは、金融市場への円滑な資金供給に資すると考えています。このため、今般、買入対象先数を10先増やして、合計40先にすることとしました。

また、これとあわせ、今月末までの間、追加的に手形買入（本店買入）オペの買入対象先を募ることとしました。

3. オペ入札におけるレート刻み幅の細分化

現在、オペの入札におけるレートの刻み幅は、国債売買オペおよび短期国債売買オペが0.001%刻み、その他のオペは0.01%刻みとなっていますが、これを0.001%刻みに統一することとしました。7月下旬までに順次実施する予定です。

4. 国債買入オペにおける買入対象国債の追加

現在、国債買入オペでは、10年債および20年債を買入の対象としておりますが、今般、2年債、4年債、5年債および6年債を買入の対象として追加することとしました。6月の国債買入オペから実施する予定です。

別紙

「手形買入基本要領」中一部改正

○ 4. を横線のとおり改める。

4. 買入対象

買入先が自己を受取人および支払人として振出し引受を完了した為替手形であって、満期日が買入日の翌日から起算して36か月以内に到来するものとする。

(附則)

この一部改正は、平成13年5月18日から実施する。

◆金融庁および法務省、「短期社債等の振替に関する法律案」を国会へ提出

金融庁および法務省は、5月24日、「短期社債等の振替に関する法律案」を国会へ提出した。同法案の概要は以下のとおり。

「短期社債等の振替に関する法律案」の概要

短期社債等の流通の円滑化を図るため、短期社債等の振替を行う振替機関及び短期社債等の発行、譲渡等に関し必要な事項を定めるための所要の措置を講ずる。

【振替機関】

1. 通則

(1) 指定要件の整理

振替機関は、特別の法的効果を伴う口座簿の管理者としての適格性・信頼性を有し、かつ、振替業を安定的・継続的に遂行できる者である必要がある。

このような観点から、振替機関の指定については、振替業を適正かつ確実に遂行するに足りる財産的基礎及び人的構成等を備える株式会社であること等の一定の水準に達していることを要件とする。

(2) 最低資本金及び最低純資産額

安定的かつ信頼性の高い証券決済システムの維持・運営の観点から、振替機関の財産的

基盤の健全性を確保するため、振替機関の最低資本金及び最低純資産額を5億円を下回らない金額で政令で定める金額とする。

2. 業務

(1) 業務の範囲

業務範囲が無制限に拡大し、その結果、財産的基盤に悪影響が生じるなどして振替業の適正かつ確実な遂行が困難となることを防止するため、振替機関の業務の範囲を振替業及び株券等保管振替法に規定する保管振替業等に限定する。ただし、振替業の関連業務で、振替業の遂行に支障を生ずるおそれがないとして主務大臣が承認した業務については兼業を可能とする。

(2) 業務規程

業務規程は、振替業の実施に関する基本的な規程であり、加入者及び発行者にも関係する振替制度の根幹となる重要なものであることから、そこで定めるべき事項を規定する。

(3) 業務の規制

振替業の公正な運営を確保するため、特定の加入者又は発行者に対し不当な差別的取扱いをすることを禁止する。

3. 監督

(1) 事故の報告等

振替業の安定的な維持・運営の観点から、振替等に関する事故発生時における報告義務のほか、定款等の変更の認可、商号等の変更の届出義務など監督上必要な規定を設ける。

(2) 業務移転命令

振替機能を維持する観点から、債務超過に陥るおそれ等のある振替機関に対し、他の会社への振替業移転を命令できる旨の規定を設ける。この場合、円滑かつ迅速な処理を可能とするため、株主総会の特別決議の特例を設ける。

4. 合併、分割及び営業の譲渡

振替機関の適格性維持の観点から、振替機関を当事者とする合併、分割及び営業譲渡などの組織変更は認可制とする。

5. 加入者

(1) 加入者の範囲については、法律上、特段の制限を設けない。

(2) 短期社債の権利関係は、振替機関が管理する振替口座簿の記録によるものとし、株券等保管振替法における顧客口座簿に相当する制度は設けない（単層構造）。

(3) 振替機関の合併、分割及び営業譲渡における加入者の利益を保護する観点から、加入者集会に関する規定を設ける。

6. 解散等

振替業の円滑かつ迅速な結了を確保する観点から、解散等のような重大な決定については、これを認可制とする。

7. 機関口座

振替機関は、消却義務履行のため、機関口座を設けることができる。

8. 雑則

主務大臣が行う振替機関の指定の取消しに係る財務大臣への協議、この法律の主務大臣、内閣総理大臣の権限の金融庁長官への委任等について、所要の規定を設ける。

【短期社債等の振替】

1. 通則

短期社債（償還期間1年未満、各社債の金額1億円以上等の要件を満たす社債）についての権利の帰属は、原則として振替口座簿の記録により定まるものとする。この場合、社債券を発行することができないこととする。

2. 振替口座簿

振替口座簿に係る記録事項、新規記録手続、振替手続、抹消手続及び記録の変更手続につき、所要の規定を設ける。

3. 振替の効果等

(1) 短期社債の譲渡、質入れについて、振替の申請による、譲受人、質権者の口座における増額の記録を効力要件とする。

(2) 短期社債に係る信託は、受託者の口座における信託財産である旨等の記録を第三者対抗要件とする。

(3) 加入者は、その口座における記録がされた短期社債についての権利を適法に有するものと推定する。

(4) 加入者は、悪意又は重大な過失があるときを除き、振替の申請により、その口座に

において増額の記録を受けた短期社債に係る権利を善意取得する。

- (5) 善意取得により、社債権者の有する短期社債の総額がその発行総額を超えることとなる場合において、振替機関が短期社債の消却義務を負うこととするほか、所要の規定を設ける。

4. 短期社債の発行等に関する商法の特例

短期社債については、取締役会決議により、発行可能期間等を定めた上で、個別の発行の特定の実行への委任を可能とするほか、社債原簿制度、社債管理会社制度、社債権者集会制度等を設けない。

5. 雑則

振替口座簿に記録されている事項の証明及び短期社債に関する強制執行等につき、所要の規定を設ける。

6. その他の短期社債等の振替

短期社債以外の短期社債等の振替に関する所要の規定を設ける。

【その他】

1. 罰則

振替口座簿に係る虚偽記録等に関して、所要の罰則規定を設ける。

2. 施行期日

この法律は、平成14年4月1日から施行し、施行日以後に発行される短期社債等について適用する。

3. 関係法律の整備

(1) 頻繁に発行・償還が行われる短期社債等に適合するよう、発行登録制度における開示事項及び開示方法について、証券取引法の所要の整備を行う。

(2) 銀行その他の金融機関が、付随業務として短期社債等を取り扱えるよう所要の規定の整備を図るほか、相互会社における「短期社債」の発行規定を設けるなど銀行法等の所要の整備を行う。

(3) 特定目的会社における「特定短期社債」の発行規定の新設その他、資産の流動化に関する法律の所要の整備を行う。

4. その他所要の規定を整備する。

◆金融庁および法務省、「株券等の保管及び振替に関する法律の一部を改正する法律案」を国会へ提出

金融庁および法務省は、5月24日、「株券等の保管及び振替に関する法律の一部を改正する法律案」を国会へ提出した。同法案の概要は以下のとおり。

「株券等の保管及び振替に関する法律の一部を改正する法律案」の概要

株券等の証券決済に係るリスクとコストの低減を図り、使い勝手が良く、高い国際競争力のある証券決済システムを構築するため、保管振替機関について、その証券決済システムの担い手としての公共性を確保しつつ、業務運営の効

率化・弾力化を図るための所要の措置を講ずる。

【骨子】

1. 保管振替機関の組織形態について、資金調達手段の多様化や競争可能性の確保による業務の効率化等の観点から、現行の公益法人形態を株式会社形態に改める。
2. 保管振替機関が行う保管振替業の公共性の確保については、指定制度を前提に、株式会社の有するコーポレートガバナンス機能を活用しつつ、行政当局の規制・監督は、これらにより実現されないものについて必要最小限のものとする。

【保管振替機関に関する改正の概要】

1. 通則

(1) 指定要件の整理

保管振替機関は、特別の法的効果を伴う口座簿の管理者としての適格性・信頼性を有し、かつ、保管振替業を安定的・継続的に遂行できる者である必要がある。

このような観点から、保管振替機関の指定については、保管振替業を適正かつ確実に遂行するに足りる財産的基礎及び人的構成等を備える株式会社であること等の一定の水準に達していることを要件とする。

(2) 最低資本金及び最低純資産額

安定的かつ信頼性の高い証券決済システムの維持・運営の観点から、保管振替機関の財産的基礎の健全性を確保するため、その最低資本金及び最低純資産額を5億円を下回らない金額で政令で定める金額とする。

2. 業務

(1) 業務の範囲

株式会社形態への変更に伴い、業務範囲が無制限に拡大し、その結果、財産的基盤に悪影響が生じるなどして保管振替業の適正かつ確実な遂行が困難となることを防止するため、保管振替機関の業務の範囲を保管振替業に限定する。ただし、保管振替業の関連業務で、保管振替業の遂行に支障を生ずるおそれがないとして主務大臣が承認した業務については兼業を可能とする。

(2) 業務規程

業務規程は、保管振替業の実施に関する基本的な規程であり、参加者、顧客及び発行者にも関係する保管振替制度の根幹となる重要なものであることから、そこで決めるべき事項を規定する。

(3) 業務の規制

保管振替業の公正な運営を確保するため、特定の参加者又は発行者に対し不当な差別的取扱いをすることを禁止する。

3. 監督

(1) 事故の報告等

保管振替業の安定的な維持・運営の観点から、預託を受けた株券等の喪失等の事故発生時の報告義務や、定款等の変更の認可、商号等の変更の届出義務など監督上必要な規定を設ける。

(2) 業務移転命令

証券決済システムを維持する観点から、債務超過に陥るおそれ等のある保管振替機関に

対し、他の会社への保管振替業の移転を命令できる旨の規定を設ける。この場合、円滑かつ迅速な処理を可能とするため、株主総会の特別決議や債権者保護手続の特例を設ける。

4. 合併、分割及び営業の譲渡

保管振替機関の適格性維持の観点から、保管振替機関を当事者とする合併、分割及び営業譲渡などの組織変更は認可制とする。この場合、円滑かつ迅速な処理を可能とするため、債権者保護手続の特例を設ける。

5. 解散等

保管振替業の円滑かつ迅速な結了を確保する観点から、解散等のような重大な決定は認可制とする。

6. 機関口座

保管振替機関は、自己のために株券等の保管及び振替を行うための口座を開設し、機関口座簿を備えることができることとする。

7. 罰則

株式会社形態への変更に伴い、公益性確保のため新設した規定等に関し、その実効性を確保する観点から、罰則について所要の改正を行う。

【その他】

1. 施行期日

この法律は、平成14年4月1日から施行する。ただし、下記2. (2)については、同年1月1日から施行する。

2. 経過措置

(1) 施行日から平成16年3月31日までの間

は、この法律の施行の際現に存する旧法の保管振替機関（旧保管振替機関）については、新法の保管振替機関とみなして、一部の規定を除き新法の規定を適用する。

(2) 旧保管振替機関が新法に規定する主務大臣の指定を受けようとする株式会社に施行日以後に保管振替事業の譲渡を行うことを施行日の前日までに議決した場合における、株券等の預託に係る債務の引受けに関する債権者異議の手続及び効果等について、所要の規定を設ける。

3. その他所要の規定を整備する。

◆日本銀行、「国債市場の流動性と金融調節の透明性を向上するための施策」を公表

日本銀行は、5月29日、「国債市場の流動性と金融調節の透明性を向上するための施策」を公表した。その内容は以下のとおり。

国債市場の流動性と金融調節の透明性を向上するための施策

平成13年5月29日
日 本 銀 行

日本銀行は、国債市場の流動性を高めるとともに、金融調節の透明性を一層向上させる観点から、以下の措置を実施することとしました。

1. 日本銀行が保有する国債の銘柄別残高の公表
国債市場における情報整備の一環として、定

期的に、日本銀行が保有する国債の銘柄別残高を公表することとしました。この措置は、市場参加者の皆様から寄せられたご要望等を踏まえたものです。日本銀行としても、個別銘柄の市中流通量の推測が容易となることにより、国債市場の流動性向上に資するものと考えています。具体的な公表方法や、本年5月1日現在の銘柄毎の残高は別紙1のとおりです。

2. 国債系オペにおける国債決済未了時の措置の公表

日本銀行が行なうオペの決済が約定どおりに実行されない場合、金融調節の円滑な遂行に支障が生じます。このため、日本銀行としては、こうした事態の発生を回避する必要があると考えています。

一方、市場参加者の方々からは、本年1月の国債決済の即時グロス決済化以降、国債を対象とするオペにおいて、オペの参加者が国債を約定どおりに日本銀行に引渡せなかった場合の措置を明確にして欲しい、との要望が寄せられてきました。

こうしたことを踏まえ、日本銀行では、今般、金融調節の円滑な遂行と透明性の向上を図る観点から、国債系オペにおける国債決済未了時の

措置を公表することとしました。具体的な内容は、別紙2のとおりです。

(別紙1)

日本銀行が保有する国債の銘柄別残高の公表^(注1)

1. 公表計数：銘柄別保有残高（除く短期国債）^(注2)
2. 公表頻度：月1回
3. 公表のタイミング：毎月1回目の国債買入オペにおける買入日時点の残高を翌営業日夕刻に公表
4. 公表方法：本行ホームページ上の「金融経済統計資料」エリアに掲載
なお、本年5月1日現在の銘柄別保有国債残高は、別添のとおりです。

(注1) これまでの検討経過については、金融市場局マーケット・レビュー2000-J-2をご参照ください。

(注2) 保有残高＝国債買入オペの買い入れ分＋借換のための引受分。額面ベース。

(別添)

銘柄別保有残高
(平成13年5月1日現在)

(単位、億円)

銘柄 (10年債)	保有残高*	銘柄 (20年債)	保有残高*
140回債	10,498	2回債	3,706
141回債	2,871	3回債	1,718
142回債	2,016	4回債	600
143回債	1,840	5回債	1,580
144回債	8,460	6回債	1,820
145回債	15,756	7回債	1,861
147回債	753	8回債	1,449
148回債	874	9回債	1,090
149回債	6,950	10回債	1,220
150回債	1,905	11回債	2,765
151回債	5,380	13回債	438
152回債	2,268	14回債	1,106
153回債	5,691	15回債	768
155回債	1,364	16回債	1,160
156回債	1,150	17回債	582
157回債	8,505	18回債	830
159回債	5,005	19回債	1,340
161回債	2,658	20回債	1,117
163回債	1,884	21回債	1,520
164回債	7,107	22回債	2,055
166回債	3,533	23回債	1,365
167回債	8,356	24回債	730
168回債	3,948	25回債	103
169回債	2,115	26回債	1,102
170回債	7,045	27回債	3,961
171回債	13,988	28回債	1,064
172回債	5,698	29回債	1,372
173回債	3,545	30回債	3,675
174回債	26,248	31回債	2,236
175回債	1,072	32回債	1,395
176回債	3,550	33回債	3,948
177回債	1,539	34回債	1,415
178回債	1,205	35回債	1,275
179回債	1,290	36回債	1,349
180回債	1,375	37回債	1,590
181回債	8,173	38回債	1,675
182回債	22,020	39回債	3,636
183回債	816	40回債	1,256
184回債	3,496	41回債	666
185回債	3,202	42回債	1,865
186回債	1,711	43回債	606
187回債	19,973	44回債	559
188回債	8,316	45回債	307
189回債	960		
190回債	293		
191回債	6,776		
192回債	645		
193回債	1,246		
194回債	3,432		
195回債	106		
196回債	11		
197回債	3		
198回債	3,528		
199回債	2,078		
200回債	15,538		
201回債	5,071		
202回債	1,578		
203回債	1,072		
204回債	24,315		
205回債	251		
206回債	13,700		
207回債	4,014		
208回債	12,114		
209回債	364		
210回債	7,611		
211回債	605		
212回債	1,391		
213回債	850		
214回債	1,927		
215回債	653		
216回債	100		
217回債	290		
218回債	310		
219回債	350		
220回債	30		

* 保有残高 = 国債買入オペの買い入れ分 + 借換のための引受分。額面ベース。

(別紙2)

国債系オペにおける国債決済未了時の措置について

通常日（国債発行のない日）	午後3時30分
利付国債以外の国債のみの発行日	午後4時30分
利付国債の発行日	午後5時

1. 対象となる国債系オペ

- (a) 国債借入（レポ）オペ
- (b) 国債買入オペ
- (c) 短期国債買入オペ
- (d) 短期国債買現先オペ
- (e) 短期国債売現先オペ

(注) 上記のオペで、オペの参加者（以下「オペ対象先」といいます。）から日本銀行に対する国債の引渡しが問題となり得るケースは、(a)～(d)のスタート取引と、(e)のエンド取引です。

このうち、(a)～(c)は、現在、「一般処理（午後3時）」で決済されており、(d)、(e)は即時グロス決済（以下「RTGS」といいます。）で決済されています。

2. 国債系オペにおける国債決済未了時の措置の具体的内容

(1) 決済締切時刻までに国債を日本銀行に引渡すことができなかった場合^(注1)

(a) 「一般処理（午後3時）」で決済することとしているオペ

一般処理（午後3時）の際に、オペ対象先が、保有する国債残高が不足していることを原因として、国債の全部または一部を日本銀行に引渡すことができなかった場合には、当該先が所要の国債調達の実確な目途を下表に掲げる時刻までに付けるとともに、遅滞なく所要の事務を行うことを条件に、その日本銀行への引渡しを一般処理（午後3時）後に行うことを認めます。

(注1) 日本銀行への国債の引渡しは、各国債系オペの決済単位毎に行います。国債借入（レポ）オペ、国債買入オペおよび短期国債買入オペの決済単位は「銘柄・レート別」に、短期国債買現先オペおよび短期国債売現先オペの決済単位は「銘柄別」になっています。

(b) RTGSで決済することとしているオペ

決済締切時刻^(注2)までに、オペ対象先が、国債の全部または一部を日本銀行に引渡すことができなかった場合には、当該先が所要の国債調達の確実な目途を当該時刻までに付けているとともに、遅滞なく所要の事務を行うことを条件に、その日本銀行への引渡しを決済締切時刻後に行うことを認めます。

(注2) RTGSで決済することとしているオペの決済締切時刻は、上記(a)の表に掲げる時刻と同じです。

(2) 日本銀行金融ネットワークシステム国債系のオンライン入力締切時刻までに国債を日本銀行に引渡すことができなかった場合

最終的に、下表に掲げる日本銀行金融ネットワークシステム国債系のオンライン入力締切時刻までに、オペ対象先が、国債の全部または一部を日本銀行に引渡すことができなかった場合には、オペの決済額を減額します（減額分の決済の翌営業日以後への延期は行いません）。

通常日（国債発行のない日）	午後4時30分
利付国債以外の国債のみの発行日	午後5時30分
利付国債の発行日	午後6時

（3）オペ対象先に対する措置

オペ対象先が、上記（1）または（2）を発生させた場合には、日本銀行は、下記（a）および（b）により点数をカウントし、その合計値に応じて、その先に対して（c）の措置を講じます。

（a）点数のカウント方法

イ. （1）を発生させたが、（2）は発生させなかった場合

1回当たり0.5点が発生します。

ロ. （1）および（2）の双方を発生させた場合

1回当たり1.0点が発生します。

なお、点数のカウントは、オペ手段別に行いません。

（b）点数の存続期間

発生した日から起算して3ヶ月とします。

（c）点数の合計値に応じた措置の内容

イ. 点数の合計値が1.5に達した場合
そのオペについて、点数の合計値が1.5に達した日から起算して1ヶ月間オファー

を停止します。

ロ. 点数の合計値が2.5に達した場合

そのオペについて、点数の合計値が2.5に達した日から起算して1ヶ月間オファーを停止します。

ハ. 点数の合計値が3.5に達した場合

そのオペについて、対象先としての資格を抹消します。

3. 国債系オペにおける国債決済未了時の措置の実施時期等

国債系オペにおける国債決済未了時の措置は、平成13年5月30日より、全ての国債系オペにかかる決済に適用します。

ただし、国債系オペにおける国債残高不足等の発生が、オペ対象先の不公正な取引意図、信用力の低下その他これらに準ずべき事由によるものと日本銀行が判断した場合には、上記とは異なる措置を講ずることがあり得ます。

日本銀行では、4月24日に、「国債決済のRTGS化に関する追加措置等の実施スケジュールについて」を公表したほか、市場関係者の間でも、一層の決済円滑化のための努力が続けられております。日本銀行としては、今後、こうした取り組みの進展に応じて、国債系オペにおける国債決済未了時の措置を見直していく方針であることを、最後に申し添えます。

◆現行金利一覧

(13年6月14日現在) (単位 年%)

	金利	実施時期	()内 前回水準
公定歩合 (基準割引率および基準貸付利率)	0.25	13. 3. 1	(0.35)
短期プライムレート	1.375	13. 3. 28	(1.500)
長期プライムレート	1.60	13. 6. 8	(1.85)

(注) 市中貸出金利の実施日は金利変更を最初に行った銀行のもの。ただし、短期プライムレートについては、都銀の中で最も多くの銀行が採用したレート (実施時期は同採用レートが最多となった時点)。

◆公社債発行条件

(13年6月14日現在)

		発行条件	改定前発行条件
国債 (10年)	応募者利回り (%)	〈6月債〉 <u>1.268</u>	〈5月債〉 1.260
	表面利率 (%)	<u>1.3</u>	1.4
	発行価格 (円)	<u>100.28</u>	101.24
政府短期証券	応募者利回り (%)	(13年6月11日発行分〜)	(13年6月4日発行分〜)
	発行価格 (円)	<u>0.0067</u> <u>99.9983</u>	0.007 99.998
政府保証債 (10年)	応募者利回り (%)	〈6月債〉 <u>1.385</u>	〈5月債〉 1.400
	表面利率 (%)	<u>1.3</u>	1.4
	発行価格 (円)	<u>99.25</u>	100.00
公募地方債 (10年)	応募者利回り (%)	〈6月債〉 <u>1.400</u>	〈5月債〉 1.417
	表面利率 (%)	1.4	1.4
	発行価格 (円)	<u>100.00</u>	99.85
利付金融債 (5年物)	応募者利回り (%)	〈6月債〉 <u>0.700</u>	〈5月債〉 0.850
	表面利率 (%)	<u>0.70</u>	0.85
	発行価格 (円)	100.00	100.00
割引金融債	応募者利回り (%)	〈6月後半債〉 0.100	〈6月前半債〉 0.100
	同税引後 (%)	0.090	0.090
	割引率 (%)	0.09	0.09
	発行価格 (円)	99.90	99.90

(注) 1. アンダーラインは今回改定箇所。
2. 利付金融債については募集債の計数。

海 外

◆バーゼル銀行監督委員会、「電子バンキングにおけるリスク管理の原則」を公表

バーゼル銀行監督委員会は、5月4日、「電子バンキングにおけるリスク管理の原則」（原題：Risk Management Principles for Electronic Banking）を公表した（「エグゼクティブ・サマリー」の仮訳は、日本銀行ホームページ（<http://www.boj.or.jp/>）に掲載）。