

各位

平成 20 年 11 月 17 日

短資協会

有担保コール取引担保における償還間近の国債の取扱について

短期金融市場取引活性化研究会における「償還間近の国債銘柄の時価の取扱について」の議論を受け、売買参考統計値が発表されなくなった償還間近の国債については、担保掛目により、十分取引金額分を確保できていることから、償還価格となる「100 円」を用いて担保価格を設定することとなりました（なお、当協会が発表している最新担保価額参考値には表示しない）。従いまして当協会が編集しております「インターバンク市場取引要綱」のうち有担保コールの担保掛目に関する記述（参考 2. 有担保コール、手形売買取引における担保の種類および掛目）を平成 20 年 11 月 18 日より下記のとおり注意書きに追記し、改訂することと致します。

（1）有担保コール取引

種類	担保価額
超長期国債	取引金額に対し額面で 10 % 増し
長期国債	〃 4 % 〃
中期国債	〃 2 % 〃
短期国債（T B F B）	〃 1 % 〃
金融債	〃 20 % 〃
世銀債	〃 20 % 〃
その他の公社債	〃 20 % 〃
円貨手形	〃 25 % 〃
外貨手形（円貨換算後）	〃 25 % 〃
短資取引担保株式預り証	〃 0 % 〃
日銀売出手形	〃 0 % 〃

（注）当協会が日々更新しております最新担保価額参考値に発表されなくなった償還間近の国債については、振替が停止するまでの間、償還価格となる「100 円」を用いて最新担保価額参考値に適用するものとする。（なお、当協会が発表する最新担保価額参考値には表示せず。）

（注）上記の担保価額に関して状況変化が生じた場合には、別途取引当事者の合意による。担保割れ銘柄(*)については、資金の出し手の承諾なく担保として利用しないものとする。

(*)担保割れ銘柄とは「差入担保銘柄の時価×掛目」が取引金額を下回る銘柄をいう。

（例）上記の担保掛目を用いた場合、時価 99.00 の短期国債は担保割れ銘柄となる。

差入担保銘柄の時価 99.00 × 短期国債担保掛目 101% = 99.99 < 取引金額 100

以上

この件につきましての問い合わせ先

上田八木短資株式会社	インターバンク営業部	(山本徳)	03-3270-1711
セントラル短資株式会社	資金営業部	(新田)	03-3242-7531
東京短資株式会社	営業一部	(杉野)	03-5200-1130