

第6期 事業報告

〔平成20年4月 1日から
平成21年3月31日まで〕

株式会社日本国債清算機関

(添付書類)

事業報告

〔平成20年4月1日から
平成21年3月31日まで〕

I. 当社の現況に関する事項

1. 事業の状況

(1) 事業の経過および成果

今年度の世界経済は、米国のサブプライムローン問題の顕在化による信用リスクの連鎖的な広がりや景気後退局面入りしていた中、ベアスターンズ証券の経営危機で幕を開け、9月の米国リーマン・ブラザーズ証券の経営破綻でさらにその混迷の度を深め、ついに世界的な金融危機に陥りました。国内経済も、急激な世界的景気減速と大幅な円高により急速に景気悪化が進み、上場企業の連結経常利益は2期連続して減益となりました。

このような経済状況の中、リーマン・ブラザーズ証券の経営破綻は、平成17年5月の開業以来順調に業容を拡大してきた当社にも、清算参加者による決済不履行という非常事態への対応を迫ることとなりました。リーマン・ブラザーズ証券の債務を履行するため、業務方法書に則り資金調達と一括清算処理を行い、それにより発生したフェイルの早期解消にも取り組み、9月末には全て解消することが出来ました。結果的に同社より預託を受けていた金銭等の範囲内で損失をカバーすることができ、他の清算参加者並びに市場関係者の皆様に、決済インフラとしての当社の存在意義を改めて認識していただくことができました。

当期業績としては、わが国の国債流通市場自体が収縮を余儀なくされたことにより、開業来の業容拡大に歯止めがかかり、債務引受高は前年度比17.7%減少しましたが、市場取扱高に占めるシェアは、売買取引、レポ取引、現先取引とも引き続き拡大しました。また、1営業日当たり決済処理量(片道ベース)は件数で2,602件(同比7.0%減)、金額では9.7兆円(同比7.0%減)となりました。営業収益では、経営破綻や営業譲渡といった参加者企業間の統廃合の影響で、参加者数が期初の37社から期末現在35社へと減少したことにより、特に下期の受入手数料収入が伸び悩んだ結果、12億26百万円と前期比6.3%の減収となりました。一方、営業費用については、システム関連の情報機器保守料および減価償却費の負担増、社内基幹システムの更新をにらんだプロパー社員増員に伴う人件費増加、参加者破綻対応に要した弁護士費用などを主要因として、11億79百万円(同比6.6%増)となりました。以上の結果、経常利益は51百万円、税引き後利益は29百万円を計上いたしました。尚、当該利益については、参加者サービスの一層の向上とそのためのシステム増強にそなえ、前年度に引き続き内部留保の蓄積に充当することとしております。

(2) 設備投資の状況

当期における設備投資の総額は 160 百万円であり、主な内容は、清算システムの機能強化と業務継続体制を強化させる為のシステム基盤の整備に関わるものであります。

(3) 資金調達の状況

記載すべき事項はありません。

2. 財産及び損益の状況の推移

(単位：千円)

区 分	第 3 期 平成 18 年 3 月期	第 4 期 平成 19 年 3 月期	第 5 期 平成 20 年 3 月期	第 6 期 (当期) 平成 21 年 3 月期
営 業 収 益	1,008,490	1,303,927	1,308,383	1,226,430
経 常 利 益	72,839	236,157	206,990	51,811
当 期 純 利 益	100,778	157,056	121,480	29,458
1 株当たり当期純利益	1,619.12 円	2,410.47 円	1,835.71 円	445.15 円
総 資 産	235,975,616	122,474,827	116,137,299	112,252,480
純 資 産	3,144,384	3,404,841	3,526,322	3,555,780

(注)1. 1 株当たり当期純利益は期中平均発行済株式総数に基づき算出しております。

2. 第 4 期より、「貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準」(企業会計基準第 5 号平成 17 年 12 月 9 日)及び「貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準等の適用指針」(企業会計基準適用指針第 8 号平成 17 年 12 月 9 日)を適用しております。

3. 対処すべき課題

当社は、清算機関として業務開始以来システム障害等による特段の業務中断等もなく、システム基盤の一層の整備と人的基盤の充実に取り組み、参加者のサービス向上と安定した業務基盤の構築に努めてまいりました。引き続き、今後の市場環境の変化、制度改革や参加者ニーズの変化に的確に対応し、取扱商品の拡大や参加者数の増加に努め、利用者の視点に立ったサービスの向上を図ると共に、安定的な財務基盤の確立、経営の効率化に向け努力してまいります。また、現行システムの保守期限切れに伴う次期システム開発についても、市場インフラとして一層の安全性、効率性、利便性を追求し計画を進めていく所存です。

株主の皆様におかれましては、今後とも一層のご支援ご鞭撻を賜りますようお願い申し上げます。

4. 主要な事業内容

内閣総理大臣より金融商品債務引受業の免許を取得し、金融商品取引法に基づく金融商品取引清算機関として、国債に係る決済・清算等の業務を行っております。

5. 主要な営業所

本店 東京都中央区日本橋兜町2番1号

6. 従業員の状況

従業員数	前期末比増減	平均年齢	平均勤続年数
16名	△1名	40.6才	1年2ヶ月

(注) 従業員には、出向者6名を含みます。

7. 当社の現況に関するその他の重要な事項

記載すべき事項はありません。

II. 会社役員に関する事項

1. 会社役員の状態（平成 21 年 3 月 31 日現在）

会社における地位	氏名	担当及び他の法人等の代表状況等
取締役社長 (代表取締役)	宇野清勝	
取締役	谷中幸夫	ICAP 東短証券株式会社 最高執行責任者兼同社取締役
取締役	渡辺豊彦	野村証券株式会社 グローバル・マーケット企画部長
取締役	星野好幸	ゴールドマン・サックス証券株式会社 業務統括本部長
取締役	富村和人	大和証券エスエムピーシー株式会社 商品業務部 部長
取締役	吉川兼次	みずほ証券株式会社 金融市場業務部長 エンサイドドットコム証券(株) 非常勤取締役
取締役	内田信幸	三菱UFJ証券株式会社 執行役員 市場商品統括グループ長
監査役 (常勤)	吉田重雄	
監査役	小澤均	ビー・エヌ・ピー・パリバ・セキュリティーズ(ジャパン) リミテッド(ビー・エヌ・ピー・パリバ証券会社 東京支店) 経理・財務部長 ビー・エヌ・ピー・パリバ・ジャパン株式会社 監査役 ビー・エヌ・ピー・パリバ・プリンシパルインベストメンツジャパン株式会社 監査役
監査役	石塚敏夫	株式会社三井住友銀行 証券ファイナンス営業部長

- (注) 1. 谷中幸夫氏、渡辺豊彦氏、星野好幸氏、富村和人氏、吉川兼次氏、内田信幸氏は、会社法第 2 条第 15 号に定める社外取締役であります。当社は、定款に社外取締役の責任限定契約に関する規定を設けております。
2. 吉田重雄氏、小澤均氏、石塚敏夫氏は、会社法第 2 条第 16 号に定める社外監査役であります。当社は、定款に社外監査役の責任限定契約に関する規定を設けております。
3. 平成 21 年 3 月 31 日付で取締役渡辺豊彦氏、富村和人氏が辞任、平成 21 年 4 月 23 日付で五嶋修氏、三澤博文氏が取締役に就任しております。
4. 平成 21 年 5 月 1 日付で監査役石塚敏夫氏が辞任しております。
5. 監査役小澤均氏は、米国公認会計士(AICPA)の資格を有する他、長年にわたり財務・会計業務を担当しており、財務及び会計に関する相当程度の知見を有するものであります。

Ⅲ. 会計監査人に関する事項

1. 名称

新日本有限責任監査法人

IV. 株式および新株予約権に関する事項

1. 大株主（上位 28 名）

株 主 名	当社への出資状況	
	持株数	出資比率
	株	%
アール・ビー・エス・セキュリティーズ・ジャパン・リミテッド（証券）	4,136	6.25
I C A P 東 短 証 券 株 式 会 社	2,068	3.12
上 田 八 木 短 資 株 式 会 社	2,068	3.12
株 式 会 社 岡 三 証 券 グ ル ー プ	2,068	3.12
カリヨン・キャピタル・マーケット・アジア・ビー・ヴィ	2,068	3.12
ク レ デ ィ ・ ス イ ス 証 券 株 式 会 社	2,068	3.12
ゴ ー ル ド マ ン ・ サ ッ ク ス 証 券 株 式 会 社	2,068	3.12
新 光 証 券 株 式 会 社	2,068	3.12
J P モ ル ガ ン 証 券 株 式 会 社	2,068	3.12
ソシエテジェネラルセキュリティーズノースパシフィックリミテッド	2,068	3.12
大 和 証 券 エ ス エ ム ビ ー シ ー 株 式 会 社	2,068	3.12
東 海 東 京 証 券 株 式 会 社	2,068	3.12
東 短 ホ ー ル デ ィ ン グ ス 株 式 会 社	2,068	3.12
ド イ ツ 証 券 株 式 会 社	2,068	3.12
ドレスナー・クライノート証券会社東京支店	2,068	3.12
日 興 シ テ ィ グ ル ー プ 証 券 株 式 会 社	2,068	3.12
日 本 証 券 金 融 株 式 会 社	2,068	3.12
日 本 相 互 証 券 株 式 会 社	2,068	3.12
農 林 中 央 金 庫	2,068	3.12
野 村 ホ ー ル デ ィ ン グ ス 株 式 会 社	2,068	3.12
バ ー ク レ イ ズ ・ キ ャ ピ タ ル 証 券 株 式 会 社	2,068	3.12
ビ ー ・ エヌ ・ ビ ー ・ パ リ バ 証 券 会 社	2,068	3.12
B G C シ ョ ウ ケ ン カ イ シ ャ リ ミ テ ッ ド	2,068	3.12
株 式 会 社 三 井 住 友 銀 行	2,068	3.12
メ リ ル リ ン チ 日 本 証 券 株 式 会 社	2,068	3.12
モ ル ガ ン ・ ス タ ン レ ー 証 券 株 式 会 社	2,068	3.12
U B S セ キ ュ リ テ ィ ー ズ ・ ジ ャ パ ン ・ リ ミ テ ッ ド	2,068	3.12
リ ー マ ン ・ ブ ラ ザ ー ズ 証 券 株 式 会 社	2,068	3.12

2. 株式に関するその他の重要な事項

(1) 発行可能株式総数	100,000 株
(2) 発行済株式の総数	66,176 株
(3) 株 主 数	34 名

3. 新株予約権等の状況

記載すべき事項はありません。

V. 業務の適正を確保するための体制に関する事項

業務の適正を確保するための体制としては、以下のとおりであります。

1. 取締役・使用人の職務執行が法令・定款に適合することを確保するための体制

企業としての倫理規範である基本運営方針及び具体的な行動基準としての行動規範等を定め、周知を図ることとする。

また、総合リスク管理委員会において、コンプライアンスを確保するために必要な制度を策定し、コンプライアンス体制の状況について検討及び改善を行うほか、相互牽制による内部監査を実施する。コンプライアンス責任者及び管理者は、法令等遵守状況を定期的に把握・管理し、問題発生時は直ちに対応をとることとする。

2. 損失の危険の管理に関する規定その他の体制

適切なリスク管理体制を確立するため、基本運営方針を指針として、管理規定・各種マニュアル等の整備を推進するとともに、役職員に対してその周知を図る。

また、総合リスク管理委員会において、当社が管理すべき各種リスクの現状把握、残存リスクの整理、適切なリスク管理のための計画の策定を行い、相互牽制による内部監査により、その実施及び改善状況を定期的に把握する等P D C Aを実施し、要旨を取締役に報告することとする。さらに、大規模な事故・災害が発生した場合に備えてB C P検討会を定期的に開催し、危機対応マニュアル・訓練計画に基づき必要な訓練を実施する。

3. 取締役の職務の執行に係る情報の保存および管理に関する体制

文書管理規定の定めにより、取締役の職務執行に係る情報を文書又は電磁的媒体に記録し、保存する。

4. 取締役の職務の執行が効率的に行われることを確保するための体制

取締役会は、取締役の職務の効率性を確保するために、業務の近況、各種委員会の行動について報告を受ける。さらに、取締役は必要に応じて議事録及び会議資料を閲覧できることとする。

5. 企業グループにおける業務の適正を確保するための体制

当社には親会社及び子会社は存しない。よって当該項目については規定しない。

6. 監査役の職務を補助すべき使用人及びその独立性に関する事項

監査役の職務を補助すべき使用人は設置しない。よって当該項目については規定しない。

7. 取締役・使用人による監査役への報告体制及びその他監査役監査の実効性を確保するための体制

取締役及び使用人は、法令に違反する事実、会社に著しい損害を与えるおそれのある事実を発見したとき及び当社に重大な影響を及ぼす事実を発見したときは、即時報告規定に定めるところにより、当該事実に関する事項を監査役に対して速やかに報告することとする。

また、監査役は、内部監査の実施状況について適宜報告を受け、必要があると認めるときは、追加監査の実施、業務改善策の策定等を求めることができるものとする。

なお、監査役は会計監査人を監督するものとし、会計監査人の取締役からの独立性を確保するため、会計監査人の監査計画について事前に報告を受けることとする。