

第9期 事業報告

〔 2011年4月 1日から
2012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

〔 2011年4月1日から
2012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

2011年度の世界経済は、ギリシャ危機を中心とした欧州債務問題に揺れ、今なお欧州債務危機再燃への懸念がくすぶっております。そのような中、国際決済銀行・支払決済システム委員会（BIS/CPSS）と証券監督者国際機構（IOSCO）専門委員会は、世界的金融危機の教訓やこれまでの国際基準の運用経験を踏まえ、従来の国際基準である「清算機関のための勧告」等に置き換わる新たな基準である「金融市場インフラのための原則（FMI原則）」を2012年4月に公表しました。

このような状況のもと、国債決済のインフラ機関である当社におきましては、利用者の拡大とその前提となる態勢強化並びに清算機関の利用メリット向上に向け、2010年6月に策定された「国債取引の決済リスク削減に関する工程表」に基づき、各種課題の達成に取り組んでまいりました。更に、清算機関を含む金融市場インフラを取り巻く環境変化にも的確に対応し、清算機関としての機能強化と事業基盤の強化を推し進めるため、2011年度より当該年度を含む3年間を対象とする中期事業計画を策定し、事業活動を展開してまいりました。

清算機関としての機能強化に関する取組みとしましては、CPSS/IOSCOが2004年11月に発表した「清算機関のための勧告」への適合状況に関する自己評価をあらためて行い、当社が取り組むべき課題の洗い出しを行いました。また、2012年4月23日約定分から国債取引の決済期間がアウトライイトT+2に短縮されるに際しては、参加者ニーズ等を踏まえ、システム面・制度面での対応を図りました。

事業基盤の強化に関する取組みとしましては、システム更改後の業務が安定的、かつ確実に遂行できるように、マニュアルの新規策定や見直し、習熟訓練を実施いたしました。併せて、金融庁検査マニュアルに基づいたフィット・ギャップ分析を基に「リスク管理基本方針」を制定し、システムリスク管理態勢の強化を図りました。また、日本証券クリアリング機構との連携を強化するとともに、業務運営の効率化についても検討を進めております。

2011年度の業績といたしましては、事業譲渡に伴う清算参加者の減少があったものの、債務引受額が高水準に推移したこと等から、営業収益は前期と同水準の14億28百万円となりました。一方、販売費及び一般管理費は、2011年5月のシステム更改に伴う減価償却

費が前期比 1 億 29 百万円増加したこと等から、営業利益は前期比 40.1%減の 2 億 20 百万円となりました。また、経常利益につきましては、前期比 39.5%減の 2 億 21 百万円となり、税引き後当期純利益につきましては、前期と同水準の 1 億 25 百万円となりました。

(2) 設備投資の状況

当期における設備投資の総額は 754 百万円であり、主な内容は、基幹システムの更改に関わる開発費用をはじめとする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 6 期 2009 年 3 月期	第 7 期 2010 年 3 月期	第 8 期 2011 年 3 月期	第 9 期 (当期) 2012 年 3 月期
営 業 収 益	1, 226, 430	1, 297, 782	1, 426, 427	1, 427, 784
経 常 利 益	51, 811	86, 138	364, 766	220, 530
当 期 純 利 益	29, 458	49, 992	125, 379	124, 733
1 株当たり当期純利益	445. 15 円	755. 44 円	1, 604. 03 円	1, 386. 55 円
総 資 産	112, 252, 480	93, 277, 303	76, 906, 069	77, 763, 603
純 資 産	3, 555, 780	3, 605, 773	5, 027, 041	5, 151, 774

(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。

3. 対処すべき課題

当社は、国債決済のインフラ機関として、安定的なサービスの提供を継続することで、我が国金融・資本市場の安全性と効率性の維持・向上に寄与してまいりましたが、CPSS/IOSCO が、従前の勧告とは異なり、より強制力を持つ基準となる FMI 原則を 2012 年 4 月に公表しており、清算機関としての当社は、この原則の充足に向けた対応策の取りまとめが求められることとなります。

こうした状況を踏まえ、当社では 2011 年度より当該年度を含めた 3 カ年の中期事業計画を策定し、積極的かつ戦略的に事業活動を展開しております。清算機関に関する国際的な基準強化の動きを踏まえ、リスク管理態勢やガバナンスの強化及び環境変化や参加者

ニーズへの対応に取り組むとともに、より頑健なインフラの構築及び災害時・システム障害時の対応力を向上させ、円滑なサービスの提供を図って参ります。株主の皆様におかれましては、今後ともご支援、ご協力を賜りますよう心より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、国債に係る清算・決済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
22 名	+3 名	44 才 2 ヶ月	2 年 11 ヶ月

(注) 従業員には、出向者 8 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 (2012年3月31日現在)

会社における地位	氏名	担当及び重要な兼職の状況等
取締役社長 (代表取締役)	園部 真	
取締役 (常務取締役)	清田 辰巳	
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	五嶋 修	大和証券キャピタル・マーケット株式会社 グローバル・マーケット業務部長
取締役	坂田 龍太郎	日本相互証券株式会社 内部管理統括部長
取締役	新長 義己	三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社 市場商品統括グループ長
取締役	北里 達夫	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式会社監査役 (非常勤)
取締役	石垣 夢作	株式会社三菱東京UFJ銀行 決済事業部長
取締役	山本 實	セントラル東短証券株式会社 取締役
監査役 (常勤)	吉田 重雄	
監査役	一色 知之	株式会社三井住友銀行 証券ファイナンス営業部長
監査役	宇都宮 研	BNPパリバ証券株式会社 インフォメーションテクノロジー・業務本部長 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 取締役 ビー・エヌ・ピー・パリバ銀行東京支店 インフォメーションテクノロジー・業務本部長

- (注)1. 星野好幸氏、五嶋修氏、坂田龍太郎氏、新長義己氏、北里達夫氏、石垣夢作氏、山本實氏は、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、一色知之氏、宇都宮研氏は、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. 2011年6月22日付で取締役谷中幸夫氏、取締役三島裕史氏が辞任しております。また、2012年1月25日付で取締役永尾和哉氏が辞任しております。

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. 株主一覧 (2012年3月31日現在)

株 主 名	当社への出資状況	
	持株数	出資比率
	株	%
株式会社日本証券クリアリング機構	32,055	35.63
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)	2,068	2.29
上田八木短資株式会社	2,068	2.29
株式会社岡三証券グループ	2,068	2.29
クレディ・アグリコル・セキュリティーズ・アジア・ビー・ヴィ	2,068	2.29
クレディ・スイス証券株式会社	2,068	2.29
ゴールドマン・サックス証券株式会社	2,068	2.29
シティグループ証券株式会社	2,068	2.29
J P モルガン証券株式会社	2,068	2.29
セントラル短資株式会社	2,068	2.29
セントラル東短証券株式会社	2,068	2.29
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	2.29
大和証券キャピタル・マーケット株式会社	2,068	2.29
東海東京フィナンシャル・ホールディングス株式会社	2,068	2.29
東短ホールディングス株式会社	2,068	2.29
ドイツ証券株式会社	2,068	2.29
日本証券金融株式会社	2,068	2.29
日本相互証券株式会社	2,068	2.29
農林中央金庫	2,068	2.29
野村ホールディングス株式会社	2,068	2.29
パークレイズ・キャピタル証券株式会社	2,068	2.29
B N P パリバ証券株式会社	2,068	2.29
B G C ショウケンカイシャリミテッド	2,068	2.29
株式会社三井住友銀行	2,068	2.29
メリルリンチ日本証券株式会社	2,068	2.29
モルガン・スタンレー M U F G 証券株式会社	2,068	2.29
U B S セキュリティーズ・ジャパン・リミテッド	2,068	2.29
みずほ証券株式会社	1,800	2.00
株式会社三菱東京 U F J 銀行	1,034	1.14
三菱 U F J モルガン・スタンレー証券株式会社	1,034	1.14
株式会社みずほコーポレート銀行	268	0.29

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	89,959 株
(3) 株 主 数	31 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. 取締役および使用人の職務執行が法令および定款に適合することを確保するための体制

- (1) 法令遵守を経営の基本方針の一つと位置づけ、具体的な行動基準として「行動規範」を定め、取締役および使用人に法令遵守の周知徹底を図る。
- (2) 総合リスク管理委員会を設置し、コンプライアンスを確保するために必要な体制を整備するとともに、コンプライアンス体制の状況について検討および改善を行う。
- (3) 「情報セキュリティポリシー」に基づき、情報セキュリティ管理体制を整備する。
- (4) 反社会的勢力とは、一切の関係を遮断するとともに、毅然とした姿勢で組織的に対応する。
- (5) 独立した内部監査部門を設置し、効率的かつ実効性のある内部監査体制を整備する。

2. 損失の危険の管理に関する規程その他の体制

- (1) 「リスク管理基本方針」に基づき、総合リスク管理委員会においてリスク管理のための諸施策を行う。
- (2) 「BCP（緊急時事業継続計画）の基本方針」に基づき、大規模な事故・災害が発生した場合に備えて総合リスク管理委員会の下にBCP検討会を設置し、危機対応マニュアルの整備や訓練等の諸施策を実施する。

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

取締役の職務執行に係る情報を記録した文書または電磁的媒体の作成、保存、管理に係る社内規程を整備し、情報の保存および管理を適切に行う。

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

- (1) 取締役会は、定款および取締役会規程に基づき運営し、定期的および必要に応じて臨時に開催するとともに、常勤取締役等で構成する経営会議を設置し、経営上の重要事項について審議を行う。
- (2) 社内規程において、組織・職務権限関係等を明確にして、効率的な業務遂行を行う。

5. 監査役の職務を補助すべき使用人およびその独立性に関する事項

- (1) 監査役からの要請がある場合には、必要に応じて、その職務を補助すべき使用人を置くものとする。

(2) 当該使用人の人事考課および人事異動等に関しては、常勤監査役の同意を得て決定するものとし、取締役からの独立性を確保するものとする。

6. 取締役および使用人による監査役への報告体制およびその他監査役の監査の実効性を確保するための体制

(1) 取締役および使用人は、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および当社に重大な影響を及ぼす事実を発見したときは、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。

(2) 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。

(3) 監査役は、取締役会のほか経営会議、総合リスク管理委員会等の重要な会議に出席し、意見を述べることができるほか、稟議書その他の業務執行に関する重要な書類を閲覧し、取締役および使用人に対して説明を求めることができるものとする。