

# 第10期 事業報告

〔 2012年4月 1日から  
2013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

〔 2012年4月1日から  
2013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

2012年4月に国際決済銀行・支払決済システム委員会（BIS/CPSS）と証券監督者国際機構（IOSCO）専門委員会より、新たな国際基準となる「金融市場インフラのための原則」（FMI原則）が公表され、清算機関である当社を含む金融市場インフラは、FMI原則の早期遵守が期待されております。また、2013年3月から金融機関に適用されるバーゼルⅢの資本規制において、金融機関の清算機関向けエクスポージャーに対する資本賦課に係る暫定規則が公表されており、清算機関の利用を促すと同時に、清算機関のリスク管理のさらなる強化が求められております。

このような状況のもと、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月に策定した「国債取引の決済リスク削減に関する工程表」に沿って各種の課題に取り組むとともに、清算機関としての機能強化および事業基盤の強化を柱とする「中期事業計画」を策定し、リスク管理態勢の強化や、環境変化や参加者ニーズへの対応等、各種課題に取り組んでまいりました。

リスク管理態勢の強化に関する取組みといたしましては、清算参加者破綻時における流動性資金調達スキームの改善策を含む、FMI原則の充足に向けた対応案を取りまとめるとともに、清算参加者破綻時における円滑な決済の遂行およびポジション整理等の処理を行う破綻対応システムを開発いたしました。

環境変化や参加者ニーズに対応する取組みといたしましては、日本銀行から開示された新日銀ネットの機能・仕様等を踏まえ、清算参加者と意見交換を行いつつ、具体的なシステム仕様の検討を行うとともに、国債取引の決済期間の短縮（アウトライト T+1 化、GCレポ取引 T+0 化）の実現に向けた議論において、清算機関として積極的な提言を行ってまいりました。

利用拡大に向けた取組みといたしましては、2014年前半に予定する資産管理専門信託銀行の円滑な参加に向け、信託協会との合意事項を踏まえ、必要なシステム対応を進めるとともに、取引移行方法等に係る清算参加者向け説明会を開催いたしました。

ガバナンスに関する取組みといたしましては、運営委員会を通じた清算参加者への業務状況の説明やウェブサイト掲載規則の充実化等、積極的な情報発信を継続し、経営の透明性を高めてまいりました。

システム基盤の強化に関する取組みといたしましては、障害時対応訓練の拡充等により、災害時・システム障害時の対応力の向上を図るとともに、資産管理専門信託銀行参加への対応、ISO20022 への移行に伴う対応、新日銀ネットへの対応等、大規模システム開発案件の着実な推進に取り組んでまいりました。また、大規模システム開発プロジェクトを確実にかつ効率的に進めるため、日本証券クリアリング機構とのシステムの共有化に向けた対応に着手いたしました。

組織運営に関する取組みといたしましては、戦略的な事業活動の推進および清算参加者とのリレーションシップ強化の観点から、総合戦略室および参加者グループを新設いたしました。また、事業運営基盤のより一層の強化と市場の効率性向上を図る観点から、日本証券クリアリング機構との合併に向けた協議を開始することといたしました。

2012年度の業績といたしましては、下期に合併に伴う清算参加者の減少があったものの、通期の営業収益としては前期と同水準の14億40百万円となりました。一方、従業員数増加に伴う人件費の増加や、災害時・システム障害時の対応を考慮したシステム運営費の増額等を行ったことから、販売費および一般管理費は前期比2.6%増の12億40百万円となり、営業利益は前期比8.8%減の2億円となりました。また、経常利益につきましては、前期比7.6%減の2億4百万円となり、税引き後当期純利益につきましては、前期比1.8%減の1億23百万円となりました。

## (2) 設備投資の状況

当期における設備投資の総額は341百万円であり、主な内容は参加者破綻対応システム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. 財産および損益の状況の推移

(単位：千円)

| 区 分   | 第7期<br>2010年<br>3月期 | 第8期<br>2011年<br>3月期 | 第9期<br>2012年<br>3月期 | 第10期(当期)<br>2013年<br>3月期 |
|-------|---------------------|---------------------|---------------------|--------------------------|
| 営業収益  | 1,297,782           | 1,426,427           | 1,427,784           | 1,439,820                |
| 経常利益  | 86,138              | 364,766             | 220,530             | 203,756                  |
| 当期純利益 | 49,992              | 125,379             | 124,733             | 122,504                  |

|             |            |            |            |             |
|-------------|------------|------------|------------|-------------|
| 1 株当たり当期純利益 | 755.44 円   | 1,604.03 円 | 1,386.55 円 | 1,361.78 円  |
| 総 資 産       | 93,277,303 | 76,906,069 | 77,763,603 | 139,794,997 |
| 純 資 産       | 3,605,773  | 5,027,041  | 5,151,774  | 5,274,278   |

(注) 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、市場参加者の決済に係るリスク削減と効率向上を担うインフラ機関として、2005年の業務開始以来、わが国の金融・資本市場の安定化の一翼を担ってまいりましたが、2012年4月に公表された FMI 原則やバーゼルⅢなどの国際基準を踏まえ、リスク管理のさらなる強化が求められています。

こうした状況を踏まえ、当社では清算機関としての機能強化に向け、リスク管理の更なる高度化、決済期間短縮に向けた対応、利用拡大、ガバナンスおよびシステム基盤の強化に取り組むとともに、日本証券クリアリング機構との合併を実現させ、事業運営基盤のより一層の強化と市場の効率性向上を図ってまいります。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   |
|------|--------|------------|----------|
| 25 名 | +3 名   | 43 才 10 ヶ月 | 3 年 6 ヶ月 |

(注) 従業員には、出向者 9 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（2013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<br>(代表取締役) | 園部 真                 |  |
| 取締役<br>(常務取締役)   | 清田 辰巳                |  |
| 取締役              | 五嶋 修                 | 大和証券株式会社 商品業務担当兼商品業務部長   |
| 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 執行役員市場商品本部市場商品統括部長   |
| 取締役              | 北里 達夫                | みずほ証券株式会社 金融市場業務部長<br>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              | 山本 實                 | セントラル東短証券株式会社 取締役  |
| 取締役              | 有馬 知秀                | 株式会社みずほコーポレート銀行 トランザクション業務部長<br>株式会社みずほ銀行 トランザクション業務部長   |
| 取締役              | 江原 正弘                | ゴールドマン・サックス証券株式会社 業務統括本部本部長  |
| 監査役<br>(常勤)      | 吉田 重雄                |  |
| 監査役              | 川東 徹                 | 株式会社三井住友銀行 決済企画部長<br>株式会社三井住友フィナンシャルグループ 決済企画部長<br>フィナンシャル・リンク株式会社 取締役<br>SMB Cファイナンスサービス株式会社 取締役<br>SMB C電子債権記録株式会社 監査役<br>グローバルファクタリング株式会社 監査役 |
| 監査役              | 飯塚 八重子<br>(通称 天野八重子) | BNPパリバ証券株式会社 経理・財務部長<br>ビー・エヌ・ピー・パリバ銀行東京支店 経理・財務部長<br>ビー・エヌ・ピー・パリバ・ジャパン株式会社 監査役<br>BNP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                              |

(注)1. 五嶋修氏、坂田龍太郎氏、新長義己氏、北里達夫氏、山本實氏、有馬知秀氏、江原正弘氏は、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、川東徹氏、飯塚八重子氏は、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. 取締役石垣夢作氏は、2012年6月27日開催の第9回定時株主総会の終結のときをもって任期満了により退任いたしました。

4. 取締役星野好幸氏は2012年8月31日付けで、取締役有馬知秀氏は2013年3月31日付けで、それぞれ辞任いたしました。

5. 監査役一色知之氏は2012年6月27日付けで、監査役宇都宮研氏は2012年9月28日付けで、それぞれ辞任いたしました。

### 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 (2013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  |
| バークレイズ証券株式会社                      | 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 証券株式会社                      | 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、意見を述べることもできるほか、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。