

国債店頭取引清算業務に関する業務方法書

第1章 総則

(目的)

第1条 この国債店頭取引清算業務に関する業務方法書（以下「本業務方法書」という。）は、株式会社日本証券クリアリング機構（以下「当社」という。）が行う金融商品債務引受業等及びこれに附帯する業務のうち国債店頭取引を対象取引とするもの（以下「国債店頭取引清算業務」という。）に関して必要な事項を定める。

2 本業務方法書等は、当社が行う国債店頭取引清算業務についてのみ適用されるものとし、当社が行う国債店頭取引以外の対象取引に係る金融商品債務引受業等その他の業務には適用されないものとする。

(定義)

第2条 本業務方法書等において使用する用語は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号。以下「法」という。）において使用される用語の例によるほか、次の各号に掲げる用語の意義は、それぞれ当該各号に定めるところによる。

(1) 「移管」とは、第39条の3第1項又は第81条第1項の規定により、移管元清算参加者と当社との間の顧客ポジションに係る債権債務を将来に向かって消滅させると同時に、移管先清算参加者と当社との間に、当該債権債務と同一内容の債権債務を新たに成立させ、それに伴う金銭の授受及び権利義務の処理を行うことをいう。

(1)の2 「移管先清算参加者」とは、移管により当社との間で当該顧客ポジションに係る債権債務を負担する清算参加者をいう。

(1)の3 「移管先口座」とは、移管を行う際に、移管先として指定されるネットティング口座をいう。

(1)の4 「移管元清算参加者」とは、移管の対象となる当該顧客ポジションに係る債権債務の当事者である清算参加者をいう。

(1)の5 「移管元口座」とは、移管を行う際に、移管元として指定されるネットティング口座をいう。

(1)の6 「一括清算事由」とは、破産手続開始、再生手続開始、更生手続開始、清算開始又は特別清算開始の申立てをいう。

(2) 「売方清算参加者」とは、国債証券の売買等において売買決済日に国債証券の渡方となる清算参加者をいう。

(3) 「エンド受渡金額」とは、現先取引等においてエンド取引受渡日に授受する金

銭の額をいう。

- (4) 「エンド金銭支払債務」とは、エンド受渡金額に係る支払債務をいう。
- (5) 「エンド国債引渡債務（バスケット）」とは、エンド取引受渡日における国債引渡債務（バスケット）をいう。
- (6) 「エンド取引」とは、現先取引等において国債証券の買戻し又は売戻しを行う取引をいう。
- (7) 「エンド取引受渡日」とは、エンド取引の受渡日をいう。
- (8) 「エンド／U n w i n d国債引渡債務（バスケット）」とは、第50条の2第1項に規定するエンド／U n w i n d国債引渡債務（バスケット）をいう。
- (9) 「親会社等」とは、ある法人等の親会社（当該法人等の財務及び事業の方針の決定を支配している他の法人等をいい、当該他の法人等の親会社を含む。以下本号において同じ。）及び当該法人等の親会社の子会社（当該法人等の親会社によって財務及び事業の方針の決定を支配されている他の法人等をいい、当該他の法人等の子会社を含む。）その他これらに類する者として当社が認める者をいう。
- (10) 「親会社等保証」とは、清算参加者の親会社等が、当社が定める様式による保証に関する書面（当社が当該書面と内容が同一であると認める書面を含む。）を当社に提出することにより当該清算参加者の当社に対する債務を保証することをいう。
- (11) 「買方清算参加者」とは、国債証券の売買等において売買決済日に国債証券の受方になる清算参加者をいう。
- (12) 「貸方清算参加者」とは、現金担保付債券貸借取引等において、取引実行日に国債証券の渡方となり、取引決済日に国債証券の受方となる清算参加者をいう。
- (13) 「借方清算参加者」とは、現金担保付債券貸借取引等において、取引実行日に国債証券の受方となり、取引決済日に国債証券の渡方となる清算参加者をいう。
- (14) 「規則」とは、本業務方法書に基づいて当社が定める規則（名称の如何を問わない。また、規則が改正された場合には、当該改正を含む。）を総称していう。
- (15) 「金銭」とは、日本円をいう。
- (16) 「金銭支払返還債務」とは、当社と清算参加者との間の次に掲げる債務を総称していう。
 - a 参加者決済に係る支払債務
 - b 第50条の2第2項に規定するスタート／R e w i n d金銭支払債務（第50条の6の規定により弁済された債務を除く。）及びエンド／U n w i n d金銭支払債務（第50条の6の規定により弁済された債務を除く。）
 - c 当初証拠金金銭預託残高（清算参加者が金銭により現に預託している当初証拠金の額をいう。）に係る返還債務

- d 国債店頭取引清算基金金銭預託残高（清算参加者が金銭により現に預託している国債店頭取引清算基金の額をいう。）に係る返還債務
 - e 第70条の8第4項の規定により当社が負担する当初証拠金及び国債店頭取引清算基金の代用国債証券の利金相当額（第83条の9第4項の規定により準用する第70条の8第4項の規定に基づき当社が支払う破綻時証拠金の代用国債証券の利金相当額を含む。）に係る支払債務
 - f 第76条第1項の規定により清算参加者が負担する資金調達に要した費用相当額に係る支払債務
 - g 破綻時証拠金金銭預託残高（清算参加者が金銭により現に預託している破綻時証拠金の額をいう。）に係る返還債務
- (17) 「決済日等」とは、売買決済日、取引実行日、取引決済日、スタート取引受渡日、エンド取引受渡日（サブステイション実行日を含む。）、Unwind金銭支払債務及びUnwind国債引渡債務（バスケット）を履行すべき日並びにRewind金銭支払債務及びRewind国債引渡債務（バスケット）を履行すべき日をいう。
- (18) 「現金担保付債券貸借取引」とは、国債証券の貸借及びその担保の目的で行う金銭の授受をいう。
- (19) 「現金担保付債券貸借取引等」とは、現金担保付債券貸借取引並びに当該取引に基づく債務を履行するために行う国債証券及び金銭の授受をいう。
- (20) 「現金担保付債券貸借取引等に係る利金相当額支払債務」とは、現金担保付債券貸借取引等において、取引実行日の翌日（銀行休業日に当たるときは、順次繰り下げる。）から取引決済日までの間に借入国債証券について利払期日が到来した場合に受領する利金に相当する額の利払期日における支払債務をいう。
- (21) 「現先売方清算参加者」とは、現先取引等において、スタート取引受渡日に国債証券の渡方となり、エンド取引受渡日に国債証券の受方となる清算参加者をいう。
- (22) 「現先買方清算参加者」とは、現先取引等において、スタート取引受渡日に国債証券の受方となり、エンド取引受渡日に国債証券の渡方となる清算参加者をいう。
- (23) 「現先取引等」とは、銘柄先決め現先取引等及び銘柄後決め現先取引等をいう。
- (24) 「現先取引等に係る利金相当額支払債務」とは、現先取引等において、スタート取引受渡日の翌日（銀行休業日に当たるときは、順次繰り下げる。）からエンド取引受渡日までの間に買付国債証券について利払期日が到来した場合に受領する利金に相当する額の利払期日における支払債務をいう。
- (25) 「原取引按分清算参加者」とは、生存清算参加者のうち信託口を有する者を

いう。

(26) 「原取引按分方式損失総額」とは、破綻処理損失（第90条の5の規定による破綻処理損失の補填が行われる場合においては、当該補填により補填される損失を除く。）の額に当社が規則により定める方法により算出した割合を乗じた額をいう。

(26)の2 「顧客ポジション」とは、国債店頭取引他社清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づく未決済の債権債務のうち、当該国債店頭取引他社清算参加者が有価証券等清算取次ぎにより受託した顧客に係るものをいう。

(26)の3 「国債先物ペアオフネットィング」とは、国債証券先物取引（証券取引等業務方法書第3条第2項第3号に規定する国債証券先物取引をいう。）に係る決済及び個別銘柄取引に係る決済について、第50条の12に定めるところにより、決済されたとみなすことをいう。

(27) 「国債証券の売買」とは、国債証券の売付け又は買付けであって買戻又は売戻条件の付されていないものをいう。

(28) 「国債証券の売買等」とは、国債証券の売買並びに当該取引に基づく債務を履行するために行う国債証券及び金銭の授受をいう。

(29) 「国債証券引渡返還債務」とは、当社と清算参加者との間の次に掲げる債務を総称していう。

- a 第46条に規定する個別銘柄取引に係る証券決済債務
- b スタート／R e w i n d 国債引渡債務（バスケット）及びエンド／U n w i n d 国債引渡債務（バスケット）
- c 第50条の5に規定する銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務
- d 清算参加者が負担するバイ・インに係る国債証券引渡債務
- e 当初証拠金代用預託残高に係る返還債務
- f 国債店頭取引清算基金代用預託残高に係る返還債務
- g 第74条第1項第2号及び第2項に規定する清算参加者を相手方とした銘柄先決め現先取引に係る国債証券引渡債務
- h 第80条の7第2項の規定により当社又は清算参加者が負担する入札対象取引に係る国債証券引渡債務
- i 破綻時証拠金代用預託残高に係る返還債務

(30) 「国債店頭取引自社清算資格」とは、国債店頭取引清算資格のうち有価証券等清算取次ぎを行うことができないものをいう。

(31) 「国債店頭取引清算基金所要額」とは、第15条及び第70条の5の規定により清算参加者が当社に預託すべき国債店頭取引清算基金の額をいう。

(32) 「国債店頭取引清算基金代用預託残高」とは、清算参加者が代用国債証券に

より現に預託している国債店頭取引清算基金の数量をいう。

(33) 「国債店頭取引清算資格」とは、当社が行う国債店頭取引清算業務の相手方となるための資格をいう。

(34) 「国債店頭取引他社清算参加者」とは、国債店頭取引他社清算資格を有する者をいう。

(35) 「国債店頭取引他社清算資格」とは、国債店頭取引清算資格のうち有価証券等清算取次ぎを行うことができるものをいう。

(36) 「国債引渡債務（バスケット）」とは、バスケットにより特定される国債証券の引渡債務をいう。

(37) 「個別銘柄取引」とは、国債証券の売買等、現金担保付債券貸借取引等及び銘柄先決め現先取引等を総称していう。

(38) 「サブスティテューション」とは、一の銘柄先決め現先取引等について、当該銘柄先決め現先取引等のエンド取引に係る国債証券の変更を目的として、次のa及びbに掲げる取引を同時に行うことをいう。

a 当初現先取引等の終了を目的として、当初現先取引等に係る現先売方清算参加者及び当初現先取引等に係る現先買方清算参加者が、次の(a)から(e)までに掲げる債務を負担する取引

(a) 当初現先取引等に係る現先売方清算参加者が、当初現先取引等に係る現先買方清算参加者に、当初現先取引等に係る国債証券を、当初現先取引等のエンド取引受渡日に引き渡す債務

(b) 当初現先取引等に係る現先買方清算参加者が、当初現先取引等に係る現先売方清算参加者に、当初現先取引等のエンド取引受渡日に授受する金銭の額を、当初現先取引等のエンド取引受渡日に支払う債務

(c) 当初現先取引等に係る現先買方清算参加者が、当初現先取引等に係る現先売方清算参加者に、当初現先取引等に係る国債証券を、サブスティテューション実行日に引き渡す債務

(d) 当初現先取引等に係る現先売方清算参加者が、当初現先取引等に係る現先買方清算参加者に、変更後銘柄先取引等のスタート取引受渡日に授受する金銭の額を、サブスティテューション実行日に支払う債務

(e) 当初現先取引等の終了に係る利金相当額支払債務

b 変更後銘柄先取引等

(39) 「サブスティテューション実行日」とは、当初現先取引等を終了させる日をいう。

(40) 「参加者決済に係る支払債務」とは、当社と清算参加者との間の次に掲げる

債務を総称している。

- a 第46条の3に規定する個別銘柄取引に係る利金相当額決済債務
- b 第47条第2項に規定する個別銘柄取引に係る証券決済債務時価評価額に係る支払債務
- c 第47条第3項に規定する個別銘柄取引に係る受渡調整金額に係る支払債務
- d 第50条の7に規定する銘柄後決め現先取引等に係る利金相当額決済債務
- e 第50条の8第2項に規定する銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務時価評価額に係る支払債務
- f 第50条の8第3項に規定する銘柄後決め現先取引等に係る受渡調整金額に係る支払債務
- g 第52条に規定するフェイルチャージに係る支払債務
- h 第53条に規定する利金相当額に係る支払債務
- i 第54条に規定する償還金相当額に係る支払債務
- j 第56条第1項に規定するバイ・インに係る売買代金の支払債務
- k 第57条第1項に規定するバイ・インに係る売買代金の額と当該バイ・インの対象であるフェイルに係る個別銘柄取引に係る証券決済債務時価評価額又は銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務時価評価額との差額及びバイ・インを行うための資金調達に要した費用相当額に係る支払債務
- l 第59条第1項に規定する参加者バイ・インに係る売買代金の額と当該参加者バイ・インの対象であるフェイルに係る個別銘柄取引に係る証券決済債務時価評価額又は銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務時価評価額との差額及び参加者バイ・インを行うための資金調達に要した費用相当額に係る支払債務
- m 第60条第1項に規定する参加者バイ・インに係る売買代金の額と当該参加者バイ・インの対象であるフェイルに係る個別銘柄取引に係る証券決済債務時価評価額又は銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務時価評価額との差額及び参加者バイ・インを行うための資金調達に要した費用相当額に係る支払債務
- n 第62条及び第63条に規定する統一慣習バイ・インに係る売買代金の額と当該統一慣習バイ・インの対象であるフェイルに係る個別銘柄取引に係る証券決済債務時価評価額又は銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務時価評価額との差額及び統一慣習バイ・インに係る費用相当額に係る支払債務
- o 第65条及び第66条に規定する変動証拠金の預託に係る債務
- p 第67条に規定する変動証拠金の返還に係る債務及び利息の支払債務
- q 第74条第1項第2号及び第2項に規定する清算参加者を相手方とした銘柄先決め現先取引に係る支払債務

- r 第80条の7第2項の規定により当社又は清算参加者が負担する入札対象取引に係る支払債務
- (41) 「参加者バイ・イン」とは、フェイルに係る決済を完了させることを目的として、当該フェイルに係る決済の受方清算参加者が、当社の計算により当該受方清算参加者の名において国債証券を買い付けることをいう。
- (42) 「自己資本規制比率」とは、法第46条の6第1項に規定する自己資本規制比率をいう。
- (42)の2 「証券取引等業務方法書」とは、当社が証券取引等清算業務に関して定める業務方法書をいう。
- (43) 「信託口」とは、信託に係る取引専用のネットティング口座をいう。
- (44) 「スタート受渡金額」とは、現先取引等においてスタート取引受渡日に授受する金銭の額をいう。
- (45) 「スタート受渡金額相当額」とは、スタート受渡金額と同額の金銭の額をいう。
- (46) 「スタート金銭支払債務」とは、スタート受渡金額に係る支払債務をいう。
- (47) 「スタート国債引渡債務（バスケット）」とは、スタート取引受渡日における国債引渡債務（バスケット）をいう。
- (48) 「スタート取引」とは、現先取引等において国債証券の当初の売付け又は買付けを行う取引をいう。
- (49) 「スタート取引受渡日」とは、スタート取引の受渡日をいう。
- (50) 「スタート／R e w i n d 国債引渡債務（バスケット）」とは、第50条の2第1項に規定するスタート／R e w i n d 国債引渡債務（バスケット）をいう。
- (50)の2 「スポンサー参加者」とは、スポンサー利用参加者のために国債店頭取引清算基金を預託する清算参加者をいう。
- (50)の3 「スポンサーネットティング口座」とは、スポンサー利用ネットティング口座分の国債店頭取引清算基金の預託を行うスポンサー参加者のネットティング口座をいう。
- (50)の4 「スポンサー利用参加者」とは、スポンサー利用ネットティング口座に係る国債店頭取引清算基金を他の清算参加者に預託させている清算参加者をいう。
- (50)の5 「スポンサー利用ネットティング口座」とは、清算基金スポンサー制度の利用により国債店頭取引清算基金の預託を免除されるネットティング口座をいう。
- (51) 「清算基金按分清算参加者」とは、信託口のみを有する清算参加者を除いた生存清算参加者をいう。
- (52) 「清算基金按分方式損失総額」とは、破綻処理損失（第90条の5の規定に

- よる破綻処理損失の補填が行われる場合においては、当該補填により補填される損失を除く。)の額から原取引按分方式損失総額を控除した額をいう。
- (52)の2 「清算基金スポンサー制度」とは、第11章の2の規定により、他の清算参加者に国債店頭取引清算基金を預託させることができる制度をいう。
- (53) 「清算参加者」とは、国債店頭取引清算資格を有する者をいう。
- (54) 「清算資格の区分」とは、国債店頭取引自社清算資格又は国債店頭取引他社清算資格の別をいう。
- (55) 「生存清算参加者」とは、破綻清算参加者以外の清算参加者をいう。
- (56) 「第一階層国債店頭取引決済保証準備金」とは、第83条の規定により破綻処理損失の補填に充てるために、当社が規則で定めるところにより積み立てる額の準備金をいう。
- (57) 「第三階層特別清算料」とは、第83条の4の規定により生存清算参加者から当社に支払われる金銭をいう。
- (58) 「第三階層特別清算料担保金」とは、第83条の8第1項第1号に掲げる目的で、生存清算参加者が当社に預託する金銭をいう。
- (59) 「第二階層国債店頭取引決済保証準備金」とは、第83条の2の規定により破綻処理損失の補填に充てるために、当社が規則で定めるところにより積み立てる額の準備金をいう。
- (60) 「第二階層清算参加者負担限度額(原取引按分)」とは、第83条の2の規定により当社に預託した国債店頭取引清算基金の取崩しを受ける原取引按分清算参加者ごとの破綻清算参加者に係る破綻認定日の属する破綻処理単位期間の開始日の前日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。)における国債店頭取引清算基金所要額(第90条の6第1項に規定する場合にあっては、清算基金スポンサー制度を利用していなかったとした場合の国債店頭取引清算基金所要額)(清算参加者が信託口以外のネットィング口座を有する場合は信託口以外のネットィング口座に係る額を除く。)をいう。
- (61) 「第二階層清算参加者負担限度額(清算基金按分)」とは、第83条の2の規定により当社に預託した国債店頭取引清算基金の取崩しを受ける清算基金按分清算参加者ごとの破綻清算参加者に係る破綻認定日の属する破綻処理単位期間の開始日の前日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。)における国債店頭取引清算基金所要額(第90条の6第1項に規定する場合にあっては、清算基金スポンサー制度を利用していなかったとした場合の国債店頭取引清算基金所要額)(清算参加者が信託口を有する場合は信託口に係る額を除く。)をいう。
- (62) 「第二階層清算参加者負担総額(原取引按分)」とは、第82条第1項第1

号に規定する原取引按分方式における原取引按分清算参加者が当社に預託した国債店頭取引清算基金から取崩しをする額の総額をいう。

(63) 「第二階層清算参加者負担総額(清算基金按分)」とは、第82条第1項第2号に規定する清算基金按分方式における清算基金按分清算参加者が当社に預託した国債店頭取引清算基金から取崩しをする額の総額をいう。

(64) 「代用国債証券」とは、第70条の8第1項の規定により預託される国債証券をいう。

(65) 「第四階層特別清算料」とは、第83条の7の規定により生存清算参加者から当社に支払われる金銭をいう。

(66) 「第四階層特別清算料担保金」とは、第83条の8第1項第2号に規定する債務を担保する目的で、生存清算参加者が当社に預託する金銭をいう。

(67) 「他の清算業務」とは、当社が行う金融商品債務引受業等及びこれに附帯する業務のうち国債店頭取引清算業務以外のものをいう。

(68) 「統一慣習規則」とは、日本証券業協会が定める統一慣習規則「債券等のフェイルの解消に関する規則」をいう。

(69) 「統一慣習バイ・イン」とは、統一慣習規則に規定するバイ・インをいう。

(70) 「当初現先取引等」とは、サブステイテューションの対象となる銘柄先決め現先取引等をいう。

(71) 「当初現先取引等の終了に係る利金相当額支払債務」とは、当初現先取引等に係る現先売方清算参加者が、当初現先取引等に係る現先買方清算参加者に、サブステイテューション実行日の翌日(銀行休業日に当たるときは、順次繰り下げる。)から当初現先取引等のエンド取引受渡日までの間に当初現先取引等に係る国債証券について利払期日が到来した場合に受領する利金に相当する額を、利払期日に支払う債務をいう。

(72) 「当初証拠金グループ」とは、当初証拠金に関してポジションを通算するための信託口の組合せをいう。

(73) 「当初証拠金所要額」とは、第15条及び第70条の規定により清算参加者が当社に預託すべき当初証拠金の額をいう。

(74) 「当初証拠金代用預託残高」とは、清算参加者が代用国債証券により現に預託している当初証拠金の数量をいう。

(75) 「特別清算料担保金」とは、第三階層特別清算料担保金及び第四階層特別清算料担保金を総称していう。

(76) 「取引実行日」とは、現金担保付債券貸借取引等における貸借期間の開始日をいう。

- (77) 「取引決済日」とは、現金担保付債券貸借取引等における貸借期間の終了日をいう。
- (78) 「ネットイング口座」とは、清算参加者が参加者決済に係る支払債務の履行に伴う金銭の授受その他本業務方法書に基づき当社との間で行う金銭又は国債証券の授受を行うために当社に開設する口座をいう。
- (79) 「売買決済日」とは、国債証券の売買等における決済日をいう。
- (80) 「バイ・イン」とは、フェイルに係る決済を完了させることを目的として、当社が、当該フェイルに係る決済の渡方清算参加者の計算により当社の名において清算参加者から国債証券を買い付けることをいう。
- (81) 「バスケット」とは、銘柄後決め現先取引において取引の対象となる国債証券の範囲を特定するために当社が設定する国債証券の組合せをいう。
- (82) 「バスケットネットイング」とは、第50条の2の規定によりバスケット及び決済日等を同一とする国債引渡債務（バスケット）及び金銭の支払債務について差引計算することをいう。
- (83) 「破綻時証拠金」とは、第83条の9第1項に定める債務を担保する目的で生存清算参加者が当社に預託する金銭又は代用国債証券をいう。
- (84) 「破綻時証拠金代用預託残高」とは、生存清算参加者が代用国債証券により現に預託している破綻時証拠金の数量をいう。
- (85) 「破綻処理損失」とは、破綻清算参加者の当社に対する金銭支払返還債務及び国債証券引渡返還債務について第79条の規定により一の債務となることによっても、又は当社が第80条の規定による相殺を行っても、なお残った当該破綻清算参加者の未履行債務により当社が損失を受けた場合の当該損失をいう。
- (86) 「破綻処理対象ポジション」とは、破綻清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づく債権債務で未決済のものをいう。
- (87) 「破綻処理単位期間」とは、清算参加者について破綻等が認定された場合（当該認定の時点で既に破綻処理単位期間が開始している場合を除く。）における当該清算参加者に係る破綻認定日から30日を経過するまでの期間（当該期間中に他の清算参加者について破綻等が認定された場合には、当該期間は、当該他の清算参加者に係る破綻認定日から30日を経過するまでの期間に延長されるものとし、延長後の期間中に他の清算参加者について破綻等が認定された場合も同様とする。）をいう。
- (88) 「破綻処理入札」とは、破綻処理対象ポジションの処理を目的とする取引を行うための入札をいう。
- (89) 「破綻清算参加者」とは、当社が破綻等を認定した清算参加者をいう。
- (90) 「破綻等」とは、第78条第1項各号若しくは第2項各号のいずれかに掲げ

る事由又は当社が清算参加者について支払不能のおそれがあると認めた場合をいう。

- (9 1) 「破綻認定日」とは、清算参加者について当社が破綻等を認定した日をいう。
- (9 2) 「フェイル」とは、決済日等において第50条の11第1項第1号から第4号までに掲げる取引の種類ごとに当該各号aに定める時限までに国債証券の渡方清算参加者からの国債証券の引渡しが行われないことをいう。
- (9 3) 「フェイルチャージ」とは、フェイルに係る決済についての金銭負担として当社と清算参加者との間で授受するものをいう。
- (9 4) 「フェイルに係る決済」とは、第51条第1項の規定により繰り延べられた決済、同条第2項の規定により当社が指定した決済、第84条の2第1項の規定により当社が指定した決済及び第84条の3の規定により当社が指定した決済をいう。
- (9 5) 「フェイルの場合における決済日」とは、第51条第1項の規定により繰り延べられた決済が行われる日、第84条の2第1項の規定により当社が定める日及び第84条の3の規定により当社が定める日をいう。
- (9 5) の2 「ペアオフネットティング利用申請参加者」とは、第50条の12第4項に定める申請を行った者をいう。
- (9 6) 「変更後銘柄現先取引等」とは、当初現先取引等に係る現先売方清算参加者が、当初現先取引等に係る現先買方清算参加者に、変更後の国債証券を、サブステイション実行日に売り付け、当初現先取引等に係るエンド取引受渡日に買い戻す銘柄先決め現先取引等をいう。
- (9 7) 「変動証拠金」とは、第65条及び第66条の規定により清算参加者が当社に預託する金銭及び当社が清算参加者に預託する金銭をいう。
- (9 8) 「本業務方法書等」とは、本業務方法書及び規則を総称していう。
- (9 9) 「未決済資金ポジション」とは、当社と清算参加者との間の次に掲げる債務を総称していう。
- a 第47条第2項に規定する個別銘柄取引に係る証券決済債務時価評価額に係る支払債務
 - b 第47条第3項に規定する個別銘柄取引に係る受渡調整金額に係る支払債務
 - c 第50条の2第2項に規定するスタート／R e w i n d金銭支払債務及びエンド／U n w i n d金銭支払債務
 - d 第50条の8第2項に規定する銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務時価評価額に係る支払債務
 - e 第50条の8第3項に規定する銘柄後決め現先取引等に係る受渡調整金額に係る支払債務
 - f 第54条に規定する償還金相当額に係る支払債務

- g 第56条第1項に規定するバイ・インに係る売買代金の支払債務
 - h 第74条第1項第2号及び第2項に規定する清算参加者を相手方とした銘柄先決め現先取引に係る支払債務
 - i 第80条の7第1項の規定により入札対象取引が成立した場合に適用される第50条の2第2項に規定するスタート／R e w i n d 金銭支払債務及びエンド／U n w i n d 金銭支払債務
- (100) 「未決済証券ポジション」とは、当社と清算参加者との間の次に掲げる債務を総称していう。
- a 第46条に規定する個別銘柄取引に係る証券決済債務
 - b スタート／R e w i n d 国債引渡債務（バスケット）及びエンド／U n w i n d 国債引渡債務（バスケット）
 - c 第50条の5に規定する銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務
 - d 当社又は清算参加者が負担するバイ・インに係る国債証券引渡債務
 - e 第74条第1項第2号及び第2項に規定する清算参加者を相手方とした銘柄先決め現先取引に係る国債証券引渡債務
 - f 第80条の7第1項の規定により入札対象取引が成立した場合に適用されるスタート／R e w i n d 国債引渡債務（バスケット）及びエンド／U n w i n d 国債引渡債務（バスケット）
 - g 第80条の7第2項の規定により当社又は清算参加者が負担する入札対象取引に係る国債証券引渡債務
- (101) 「銘柄後決め現先取引」とは、国債証券の買戻又は売戻条件付売買のうち売買の対象となる国債証券をバスケットにより特定して行うものをいう。
- (102) 「銘柄後決め現先取引等」とは、銘柄後決め現先取引並びに当該取引に基づく債務を履行するために行う国債証券及び金銭の授受をいう。
- (103) 「銘柄先決め現先取引」とは、国債証券の買戻又は売戻条件付売買のうち売買の対象となる国債証券を銘柄により特定して行うもの（GMRA契約に基づくものを含む。）をいう。
- (104) 「銘柄先決め現先取引等」とは、銘柄先決め現先取引並びに当該取引に基づく債務を履行するために行う国債証券及び金銭の授受をいう。
- (105) 「銘柄割当て」とは、第50条の4の規定により、スタート／R e w i n d 国債引渡債務（バスケット）のうちバスケットネットティングが行われた日を決済日等とするもの及びエンド／U n w i n d 国債引渡債務（バスケット）のうちバスケットネットティングが行われた日の翌日（休業日に当たるときは、順次繰り下げる。）を決済日等とするものに対し、国債証券の銘柄及び数量を割り当てることをいう。

(106) 「連結自己資本規制比率」とは、特別金融商品取引業者及びその子法人等の保有する資産等に照らし当該特別金融商品取引業者及びその子法人等の自己資本の充実の状況が適当であるかどうかを判断するための基準を定める件（平成22年金融庁告示第128号）第2条に規定する連結自己資本規制比率をいう。

(106) の2 「GMRA契約」とは、The International Capital Market Association（国際資本市場協会）及びSecurities Industry and Financial Markets Association（米国証券業金融市場協会）が公表するGlobal Master Repurchase Agreementに基づく契約をいう。

(107) 「Rewind金銭支払債務」とは、銘柄後決め現先取引等（スタート取引受渡日の翌日をエンド取引受渡日とするものを除く。）について、スタート取引受渡日の翌日（休業日に当たるときは、順次繰り下げる。）からエンド取引受渡日の前日（休業日に当たるときは、順次繰り上げる。）までの期間の各日（休業日を除く。）において現先買方清算参加者が現先売方清算参加者に対しスタート受渡金額相当額の金銭を支払う債務をいう。

(108) 「Rewind国債引渡債務（バスケット）」とは、銘柄後決め現先取引等（スタート取引受渡日の翌日（休業日に当たるときは、順次繰り下げる。）をエンド取引受渡日とするものを除く。）について、スタート取引受渡日の翌日（休業日に当たるときは、順次繰り下げる。）からエンド取引受渡日の前日（休業日に当たるときは、順次繰り上げる。）までの期間の各日（休業日を除く。）において現先売方清算参加者が現先買方清算参加者に対し負担する国債引渡債務（バスケット）をいう。

(109) 「Unwind金銭支払債務」とは、銘柄後決め現先取引等（スタート取引受渡日の翌日（休業日に当たるときは、順次繰り下げる。）をエンド取引受渡日とするものを除く。）について、スタート取引受渡日の翌日（休業日に当たるときは、順次繰り下げる。）からエンド取引受渡日の前日（休業日に当たるときは、順次繰り上げる。）までの期間の各日（休業日を除く。）において現先売方清算参加者が現先買方清算参加者に対しスタート受渡金額相当額の金銭を支払う債務をいう。

(110) 「Unwind国債引渡債務（バスケット）」とは、銘柄後決め現先取引等（スタート取引受渡日の翌日（休業日に当たるときは、順次繰り下げる。）をエンド取引受渡日とするものを除く。）について、スタート取引受渡日の翌日（休業日に当たるときは、順次繰り下げる。）からエンド取引受渡日の前日（休業日に当たるときは、順次繰り上げる。）までの期間の各日（休業日を除く。）において現先買方清算参加者が現先売方清算参加者に対し負担する国債引渡債務（バスケット）をいう。

(金融商品債務引受業等)

第3条 当社は、本業務方法書等に基づいて行う国債店頭取引を対象取引とする金融商品債務引受業のほか、これに係る法第156条の6第1項の業務を行う。

(清算対象取引)

第4条 当社の国債店頭取引清算業務の対象とする債務の起因となる取引（以下「清算対象取引」という。）の対象とする金融商品は、国債証券（当社が定めるものに限る。）とする。

- 2 清算対象取引は、次の各号に掲げる取引（当社が定めるものに限る。）とする。
 - (1) 国債証券の売買
 - (2) 現金担保付債券貸借取引
 - (3) 銘柄先決め現先取引
 - (4) 銘柄後決め現先取引
 - (5) 前各号に掲げる取引に基づく債務を履行するために行う国債証券又は金銭の授受
- 3 当社は、当社が定めるところにより、銘柄後決め現先取引に係るバスケットの設定、廃止又は内容の変更を行う。

(休業日)

第5条 当社は、次の各号に掲げる日を休業日とする。

- (1) 日曜日
 - (2) 国民の祝日
 - (3) 国民の祝日が日曜日に当たるときは、その日後においてその日に最も近い国民の祝日でない日
 - (4) 前日及び翌日が国民の祝日である日
 - (5) 土曜日
 - (6) 年始3日間
 - (7) 12月31日
- 2 当社は、必要があると認めるときは、臨時休業日を定めることができる。
 - 3 当社は、必要があると認めるときは、国債店頭取引清算業務に係る業務の全部若しくは一部を臨時に停止し又は臨時に行うことができる。
 - 4 前2項の場合には、当社は、あらかじめその旨を清算参加者に通知する。

第2章 清算参加者

第1節 国債店頭取引清算資格の取得

(国債店頭取引清算資格の取得の申請及び承認)

第6条 次の各号に掲げる者は、国債店頭取引自社清算資格又は国債店頭取引他社清算資格の別を示して、当社が定めるところにより、当社に国債店頭取引清算資格の取得の申請を行うことができる。この場合において、第2号から第6号までに掲げる者が国債店頭取引他社清算資格を取得しようとするときは、登録金融機関である者に限り申請を行うことができる。

- (1) 金融商品取引業者（法第28条第1項第1号に掲げる行為に係る業務の登録を受けた者に限る。）
- (2) 銀行
- (3) 協同組織金融機関（協同組織金融機関の優先出資に関する法律（平成5年法律第44号）第2条第1項に規定する協同組織金融機関をいう。以下同じ。）及び株式会社商工組合中央金庫
- (4) 保険会社
- (5) 証券金融会社
- (6) 短資会社（金融商品取引法施行令（昭和40年政令第321号）第1条の9第5号に掲げる者をいう。以下同じ。）

2 前項に規定する申請のほか、前項各号に掲げる者は、その者の当社に対する国債店頭取引清算業務に係る債務のすべてについて親会社等保証を受けることを条件として国債店頭取引自社清算資格を取得しようとするものであることを示して、当社が定めるところにより、当社に国債店頭取引清算資格の取得の申請を行うことができる。この場合において当該者は、当該申請に際し、当社が定める様式による当該親会社等の保証に関する書面（当社が当該書面と内容が同一であると認める書面を含む。）を当社に提出するものとする。

3 前2項に規定する申請のほか、第1項第1号に掲げる者は、その者が国債店頭取引清算資格を取得した場合において、当社が第44条第1項及び第45条第1項の規定により債務の引受けを行ったことにより負担する債務について、当社が定める比率以上の割合が対当することを条件とする国債店頭取引自社清算資格を取得しようとするものであることを示して、当社が定めるところにより、当社に国債店頭取引清算資格の取得の申請を行うことができる。

4 当社は、前3項の規定により国債店頭取引清算資格の取得の申請があった場合において、国債店頭取引清算資格の取得申請者（以下「資格取得申請者」という。）が審査に

より適当であると認めるときは、当該国債店頭取引清算資格の取得の承認を行う。

- 5 第1項の規定にかかわらず、特定承継金融機関等（預金保険法（昭和46年法律第34号）第126条の34第3項第5号に定める特定承継金融機関等をいう。以下同じ。）は、当社が定めるところにより、当社に国債店頭取引清算資格の取得の申請を行うことができる。この場合において、当社は、資格取得申請者に対する国債店頭取引清算資格の取得の承認を行うことができる。
- 6 前2項の承認は、国債店頭取引清算資格を取得すべき期日を指定して行う。
- 7 当社は、第4項又は第5項の規定により国債店頭取引清算資格の取得を承認したときは、その旨を当該資格取得申請者及び各清算参加者に通知する。

（国債店頭取引清算資格の要件）

第7条 前条第1項の申請に係る同条第4項の審査は、資格取得申請者に関する次の各号に掲げる事項その他国債店頭取引清算業務の運営に関して必要と認める事項について行うものとする。

（1） 経営の体制

当社の国債店頭取引清算業務の運営に鑑みて適当でないと認められる者の支配又は影響を受けていないことなど当社が行う国債店頭取引清算業務について社会的な信用が十分に確保されると見込まれる健全な経営の体制であること。

（2） 財務基盤

国債店頭取引清算資格を取得すべき期日までに、次のa又はbに掲げる区分に従い、当該a又はbに定める基準に適合すると見込まれ、かつ、清算参加者として安定した収益力が見込まれること。

a 金融商品取引業者、証券金融会社又は短資会社

- (a) 資本金の額が3億円以上であること。
- (b) 純財産額（証券金融会社又は短資会社にあつては純資産額）が50億円以上（国債店頭取引他社清算資格の場合には200億円以上）であること。
- (c) 金融商品取引業者にあつては、自己資本規制比率が200パーセントを上回っていること、証券金融会社又は短資会社にあつては、これに準ずる場合に該当していること。
- (d) 特別金融商品取引業者（法第57条の5第2項の届出を行う者に限る。以下同じ。）にあつては、連結自己資本規制比率が200パーセントを上回っていること。

b 銀行、協同組織金融機関、株式会社商工組合中央金庫又は保険会社

- (a) 資本金の額又は出資の総額（相互会社にあつては、基金（基金償却積立金

を含む。)の総額をいう。以下同じ。)が3億円以上であること。

(b) 純資産額が50億円以上(国債店頭取引他社清算資格の場合には200億円以上)であること。

(c) 銀行等(銀行、協同組織金融機関及び株式会社商工組合中央金庫をいう。以下同じ。)のうち、国際統一基準行、農林中央金庫、国際統一基準金庫及び株式会社商工組合中央金庫(以下「国際統一基準行等」という。)にあつては、次のイからハまでに該当していること(外国銀行にあつては、これに準ずる場合に該当していること)。

イ 単体及び連結普通株式等Tier1比率(農林中央金庫及び国際統一基準金庫にあつては、単体及び連結普通出資等Tier1比率とする。以下同じ。)が4.5パーセントを上回っていること。

ロ 単体及び連結Tier1比率が6パーセントを上回っていること。

ハ 単体及び連結総自己資本比率が8パーセントを上回っていること。

(d) 国際統一基準行等以外の銀行等(以下「国内基準行等」という。)にあつては、国内基準に係る単体及び連結自己資本比率が4パーセントを上回っていること。

(e) 保険会社にあつては、単体及び連結ソルベンシー・マージン比率が400パーセントを上回っていること。

(3) 業務執行体制

清算対象取引の決済、損失の危険の管理及び法令(法及びその関係法令をいう。以下同じ。)、法令に基づく行政官庁の処分、本業務方法書等の遵守に関し適切な業務執行の体制を備えていること。

2 前条第2項の申請に係る同条第4項の審査は、資格取得申請者に関する次の各号に掲げる事項その他国債店頭取引清算業務の運営に関して必要と認める事項について行うものとする。

(1) 財務基盤

国債店頭取引清算資格を取得すべき期日までに、次のa又はbに掲げる区分に従い、当該a又はbに定める基準に適合すると見込まれ、かつ、清算参加者として安定した収益力が見込まれること。

a 金融商品取引業者、証券金融会社又は短資会社

(a) 資本金の額が3億円以上であること。

(b) 純財産額(証券金融会社又は短資会社にあつては純資産額)が10億円以上であること。

(c) 金融商品取引業者にあつては、自己資本規制比率が140パーセントを上

回っていること、証券金融会社又は短資会社にあつては、これに準ずる場合に該当していること。

(d) 特別金融商品取引業者にあつては、連結自己資本規制比率が140パーセントを上回っていること。

(e) 当該資格取得申請者の親会社等から親会社等保証を受けること。

b 銀行、協同組織金融機関、株式会社商工組合中央金庫又は保険会社

(a) 資本金の額又は出資の総額が3億円以上であること。

(b) 純資産額が10億円以上であること。

(c) 国際統一基準行等にあつては、次のイからハまでに該当していること（外国銀行にあつては、これに準ずる場合に該当していること）。

イ 単体及び連結普通株式等Tier1比率が4.5パーセントを上回っていること。

ロ 単体及び連結Tier1比率が6パーセントを上回っていること。

ハ 単体及び連結総自己資本比率が8パーセントを上回っていること。

(d) 国内基準行等にあつては、国内基準に係る単体及び連結自己資本比率が4パーセントを上回っていること。

(e) 保険会社にあつては、単体及び連結ソルベンシー・マージン比率が200パーセントを上回っていること。

(f) 当該資格取得申請者の親会社等から親会社等保証を受けること。

(2) 親会社等の財務基盤

国債店頭取引清算資格を取得すべき期日までに、当該資格取得申請者の親会社等（当該資格取得申請者のために親会社等保証を行う親会社等に限る。以下本号において同じ。）が次に適合すると見込まれること。

a 資本金の額又は出資の総額が3億円以上であること。

b 当該資格取得申請者の親会社等の純財産額（当該親会社等が金融商品取引業者でない場合には、純資産額又はこれに相当する額）が、50億円に親会社等保証を受ける清算参加者の数（当該親会社等が清算参加者である場合には当該数に1を加えた数）を乗じた額（ただし、当該額が200億円に満たない場合は、200億円）以上であること。

c 当該親会社等が金融商品取引業者である場合にあつては、自己資本規制比率が200パーセントを上回っていること、証券金融会社又は短資会社にあつては、これに準ずる場合に該当していること。

d 当該親会社等が特別金融商品取引業者である場合にあつては、連結自己資本規制比率が200パーセントを上回っていること。

- e 当該親会社等が国際統一基準行等である場合にあっては、次の(a)から(c)までに該当していること(外国銀行にあっては、これに準ずる場合に該当していること)。
 - (a) 単体及び連結普通株式等Tier1比率が4.5パーセントを上回っていること。
 - (b) 単体及び連結Tier1比率が6パーセントを上回っていること。
 - (c) 単体及び連結総自己資本比率が8パーセントを上回っていること。
- f 当該親会社等が国内基準行等である場合にあっては、国内基準に係る単体及び連結自己資本比率が4パーセントを上回っていること。
- g 当該親会社等が保険会社である場合にあっては、単体及び連結ソルベンシー・マージン比率が400パーセントを上回っていること。
- h 当該親会社等が金融商品取引業者、特別金融商品取引業者、国際統一基準行等、国内基準行等又は保険会社でない場合にあっては、cからgまでに準ずる場合に該当していること。

(3) 前項第1号及び第3号に掲げる事項

- 3 前条第3項の申請に係る同条第4項の審査は、資格取得申請者に関する次の各号に掲げる事項その他国債店頭取引清算業務の運営に関して必要と認める事項について行うものとする。

(1) 財務基盤

国債店頭取引清算資格を取得すべき期日までに、次に掲げる基準に適合すると見込まれ、かつ、清算参加者として安定した収益力が見込まれること。

- a 資本金の額が3億円以上であること。
- b 純財産額が25億円以上であること。
- c 自己資本規制比率が200パーセントを上回っていること。
- d 特別金融商品取引業者にあっては、連結自己資本規制比率が200パーセントを上回っていること。

- (2) その者が国債店頭取引清算資格を取得した場合において、当社が第44条第1項及び第45条第1項の規定により債務の引受けを行ったことにより負担する債務について、当社が定める比率以上の割合が対当することが見込まれること。

(3) 第1項第1号及び第3号に掲げる事項

(国債店頭取引清算資格の取得手続の履行)

第8条 当社が第6条第4項の規定により国債店頭取引清算資格の取得の承認を行ったときは、当社は、同条第6項の規定により当社が指定した期日の前日(休業日に当たると

きは、順次繰り上げる。第53条及び第54条第1項を除き以下同じ。)までに、資格取得申請者をして、当初証拠金及び国債店頭取引清算基金の預託その他当社が必要と認める国債店頭取引清算資格の取得手続を履行させるものとする。

- 2 資格取得申請者(特定承継金融機関等である者を除く。)が、第6条第6項の規定により当社が指定した期日の前日までに前項の手続を履行しないときは、その国債店頭取引清算資格の取得申請を取り下げたものとみなす。
- 3 当社が第6条第5項の規定により国債店頭取引清算資格の取得の承認を行ったときは、当社は、当社がその都度定める日までに、資格取得申請者をして、当初証拠金及び国債店頭取引清算基金の預託その他当社が必要と認める国債店頭取引清算資格の取得手続を履行させるものとする。

(国債店頭取引清算資格取得の日)

- 第9条 当社は、資格取得申請者が前条第1項又は第3項に規定する手続(同項の規定による手続にあつては、第6条第6項の規定により当社が指定した期日までの日を当社が履行の期日と定めたものに限る。)を履行したときは、第6条第6項の規定により当社が指定した期日に、国債店頭取引清算資格を付与する。
- 2 当社は、前項の規定により資格取得申請者に国債店頭取引清算資格を付与したときは、その旨を当該資格取得申請者及び各清算参加者に通知する。

(清算資格の区分の変更)

- 第9条の2 第6条第1項、第4項、第6項及び第7項、第7条第1項並びに前条の規定は、清算参加者がその有する清算資格の区分を変更する場合について準用する。この場合において、第6条第1項、第4項及び第7項中「清算資格の取得」とあるのは「清算資格の区分の変更」と、同条第4項中「清算資格の取得申請者(以下「清算資格取得申請者」)」とあるのは「清算資格の区分の変更申請者」と、同条第7項及び前条中「清算資格取得申請者」とあるのは「清算資格の区分の変更申請者」と、第6条第6項及び第7条第1項第2号中「清算資格を取得すべき期日」とあるのは「清算資格の区分を変更すべき期日」と、前条第1項中「清算資格を付与する」とあるのは「清算資格の区分を変更する」と、同条第2項中「清算資格を付与したとき」とあるのは「清算資格の区分を変更したとき」と、それぞれ読み替えるものとする。
- 2 国債店頭取引他社清算参加者がその有する清算資格の区分の変更申請をする場合には、当該国債店頭取引他社清算参加者の当社に対する国債店頭取引清算業務に係る未履行債務(当社がその都度定めるものを除く。以下本章において同じ。)のうち有価証券等清算取次ぎに基づくものを、あらかじめ、すべて履行しなければならない。

- 3 当社は、国債店頭取引他社清算参加者から清算資格の区分の変更申請を受理した翌日（休業日に当たるときは、順次繰り下げる。第23条第1項を除き以下同じ。）から、その国債店頭取引他社清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づく債務のうち有価証券等清算取次ぎに基づくものについて新たな債務の引受けを停止する。

（親会社等保証に係る手続）

第9条の3 第6条第1項又は第3項の申請により国債店頭取引清算資格を取得した清算参加者は、当該清算参加者の親会社等が第7条第2項第2号aからhまでに定める基準に適合する場合には、当該親会社等に、当社が定める様式による保証に関する書面（当社が当該書面と内容が同一であると認める書面を含む。）を当社に提出させることにより、当該親会社等から親会社等保証を受けることができる。

第2節 清算参加者の義務

（清算参加者契約の締結）

第10条 清算参加者は、当社との間で、当社が定める様式による清算参加者契約を締結しなければならない。

（清算参加者代表者）

第11条 清算参加者は、その代表取締役又は代表執行役（清算参加者が外国法人である金融商品取引業者又は外国銀行の場合は、日本における代表者で、かつ、取締役又は執行役と同等以上の地位にある者）のうちから、当社において当該清算参加者を代表するのに適当な者1人を、当社が定めるところにより、あらかじめ清算参加者代表者として当社に届け出なければならない。

- 2 清算参加者と当社との関係においては、清算参加者代表者のみが当該清算参加者を代表するものとする。ただし、日常業務に関しては、あらかじめその範囲を明確にして、当社に届け出た日常業務代行者をして行わせることができる。

（決済業務責任者）

第12条 清算参加者は、清算対象取引の決済に係る業務の統括に当たらせるため、その役員又は従業員のうちから決済業務責任者1人を選任し、当社が定めるところにより、当社に届け出なければならない。

（役員又は他の者との共同関係若しくは支配関係）

第13条 当社は、清算参加者の役員又は他の者との共同関係若しくは支配関係が当社の国債店頭取引清算業務の運営に鑑みて適当でないと認めるときは、当該清算参加者を審問のうえ、理由を示して、その変更を請求することができる。ただし、当該清算参加者が陳述書を提出したときは、その提出をもって、審問に代えることができる。

2 当社は、清算参加者が正当な理由がないにもかかわらず前項の審問に応じない場合には、審問を行わずに同項の変更請求を行うことができる。

3 清算参加者は、第1項の変更請求が不当であると認めるときは、変更請求の通知を受けた日から10日以内に、当社に対し書面をもって、理由を示して、異議の申立てを行うことができる。

4 当社は、前項の異議の申立てを受理したときは、遅滞なく、取締役会を開催する。

5 前項の取締役会において、第1項の変更請求を変更し、又は取り消すことが適当であると認められたときは、直ちに同項の変更請求を変更し、又は取り消すものとする。

(清算参加者による手数料の納入)

第14条 清算参加者は、当社が規則で定める手数料を、その定めるところにより、当社に納入しなければならない。

(当初証拠金及び国債店頭取引清算基金の預託)

第15条 清算参加者は、当社に対する国債店頭取引清算業務に係る債務の履行を確保するための当初証拠金及び国債店頭取引清算基金を、第9章の規定により、当社に預託しなければならない。

(権利の譲渡の禁止等)

第16条 清算参加者は、本業務方法書に基づく当社に対する権利又は請求権を、他の者に譲渡し、譲渡の予約をし、又は担保の目的に供することができない。

(国債店頭取引清算業務に関する責任の所在)

第17条 当社は、清算参加者が業務上、当社が行う国債店頭取引清算業務に関し損害を受けることがあっても、当社に故意又は重過失が認められる場合を除き、これを賠償する責めに任じない。

(届出事項)

第18条 清算参加者は、次に掲げる行為をしようとするときは、当社が定めるところにより、あらかじめその内容を当社に届け出なければならない。

- (1) 事業（当該事業が、その全部又は一部の廃止により、当該清算参加者が第6条第1項各号のいずれにも該当しなくなるものに限る。以下同じ。）の全部又は一部の廃止
 - (2) 当該清算参加者が他の会社と合併して消滅することとなる場合の当該合併及び当該清算参加者が他の会社と合併して会社を設立する場合の当該合併
 - (3) 合併及び破産手続開始の決定以外の事由による解散
 - (4) 分割による事業の全部又は一部の他の会社への承継
 - (5) 事業の全部又は一部の譲渡
 - (6) 当該清算参加者が他の会社と合併して合併後存続することとなる場合の当該合併
 - (7) 分割による事業の全部又は一部の他の会社からの承継
 - (8) 事業の全部又は一部の譲受け
 - (9) 商号又は名称の変更（英文の商号又は名称の変更を含む。）
 - (10) 役員の変更
 - (11) 本店又は主たる事務所の所在地の変更
- 2 国債店頭取引他社清算参加者は、前項に規定するほか、有価証券等清算取次ぎに係る業務の廃止をしようとするときは、当社が定めるところにより、あらかじめその内容を当社に届け出なければならない。
- 3 清算参加者は、親会社等から親会社等保証を受けている場合には、第1項に規定するほか、当該親会社等が同項第1号から第9号まで及び第11号に掲げる行為をしようとするときは、当社が定めるところにより、あらかじめその内容を当社に届け出なければならない。

（報告事項）

第19条 清算参加者は、当社が定める場合に該当することとなったときは、直ちにその内容を当社に報告しなければならない。

（清算参加者等の調査）

第20条 当社は、清算参加者による本業務方法書等の遵守の状況の調査を行う場合、清算参加者の財務の状況の調査を行う場合、当社に対する債務の履行の確実性に関する調査を行う場合その他当社の国債店頭取引清算業務の運営上必要があると認める場合は、清算参加者に対し、当該清算参加者の業務又は財産に関して参考となるべき報告若しくは資料の提出を請求し、又は当社の職員をして当該清算参加者の業務若しくは財産の状況又は帳簿、書類その他の物件を検査させることができる。

- 2 前項の規定は、当社が清算参加者のために親会社等保証を行う親会社等の財務の状況の調査を行う場合その他当社の国債店頭取引清算業務の運営上必要があると認める場合に準用する。この場合において「清算参加者」とあるのは、「清算参加者の親会社等（当該清算参加者のために親会社等保証を行う親会社等に限る。）」と読み替えるものとする。

第3節 清算参加者の申請による国債店頭取引清算資格の喪失

（国債店頭取引清算資格の喪失申請）

- 第21条 清算参加者が国債店頭取引清算資格を喪失しようとするときは、当社が定めるところにより、国債店頭取引清算資格の喪失の申請を行わなければならない。
- 2 当社は、清算参加者から前項の規定による国債店頭取引清算資格の喪失の申請があった場合には、その旨を各清算参加者に通知する。

第22条 削除

（国債店頭取引清算資格の喪失）

- 第23条 清算参加者が第21条第1項の規定により国債店頭取引清算資格の喪失の申請をした場合、当該清算参加者は、その申請の日の翌日から起算して30日目の日の第44条第2項第1号に規定する当社が債務の引受けを行う時点又は当該清算参加者の未履行債務のすべてが解消された時点のいずれか遅い時点（当該申請が破綻処理単位期間中に行われた場合又は当該申請の日から当該清算参加者について国債店頭取引清算資格の喪失の効力が生じるまでの間に破綻処理単位期間が開始した場合には、破綻処理単位期間が終了する日の当社が定める時点又は当該清算参加者の未履行債務のすべてが解消された時点のいずれか遅い時点）において、国債店頭取引清算資格を喪失する。
- 2 当社は、清算参加者が前項の規定により国債店頭取引清算資格を喪失した場合は、その旨を当該国債店頭取引清算資格の喪失申請者及び各清算参加者に通知する。

（国債店頭取引清算資格の喪失申請者の合併等の特例）

- 第24条 国債店頭取引清算資格の喪失申請者が国債店頭取引清算資格の喪失と同時に、国債店頭取引清算資格を取得する者又は国債店頭取引清算資格を有する者に合併され、分割により事業を承継させ又は事業を譲渡する等の場合において、当該清算参加者の未履行債務のすべてを解消させる必要がないと当社が認めるときは、前条第1項の規定にかかわらず、当該喪失申請者は、当社がその都度定める時点において、国債店頭取引清算資格を喪失する。

(国債店頭取引清算資格喪失以降の業務方法書の適用)

第25条 清算参加者が国債店頭取引清算資格を喪失した場合において、当該喪失前の原因に基づいて生じた権利義務があるときは、当該権利義務について、本業務方法書等の定めが適用されるものとする。

(国債店頭取引清算資格の喪失の際の当初証拠金及び国債店頭取引清算基金の返還)

第26条 当社は、清算参加者が国債店頭取引清算資格を喪失(取消しによる喪失を含む。以下この条及び次条において同じ。)したときは、その喪失の日以降当初証拠金及び国債店頭取引清算基金の返還を行うものとする。ただし、当該国債店頭取引清算資格を喪失した者の未履行債務がある場合その他当社が必要と認める場合は、その事由の消滅するまでの間、当初証拠金及び国債店頭取引清算基金の返還を停止することができる。

(国債店頭取引清算資格の喪失の際の債務弁済)

第27条 国債店頭取引清算資格を喪失した者は、当社から返還を受ける金銭又は有価証券をもって、その者が清算参加者として当社に対して負担した一切の債務の弁済に充てなければならない。

第4節 清算参加者に対する措置等

(清算参加者が業務方法書に違反した場合等の措置)

第28条 当社は、清算参加者が次の各号のいずれかに該当することとなったと認める場合には、あらかじめ当該清算参加者を審問のうえ、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づく債務の引受けの全部若しくは一部の停止又は当該清算参加者の国債店頭取引清算資格の取消しの措置を行うことができる。この場合において、国債店頭取引清算資格の取消しについては、取締役会の決議を要するものとする。

- (1) 第18条の規定による届出若しくは第19条の規定による報告をせず、又は虚偽の届出若しくは報告をしたとき。
- (2) 第20条の規定による検査を拒否し、妨げ若しくは忌避したとき、同条の規定による報告若しくは資料を提出せず又は虚偽の報告若しくは資料を提出したとき。
- (3) 業務執行体制に不備があると認められるとき。
- (4) 前3号のほか、清算参加者が本業務方法書等若しくはこれらに基づく措置に違反したとき、又は清算参加者が当社若しくは清算参加者の信用を失墜させた場合において当社の国債店頭取引清算業務の運営に鑑みて必要であると認めるとき。

- 2 当社は、清算参加者が次の各号のいずれかに該当することとなったときは、当該清算参加者を審問のうえ、理由を示して、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づく債務の引受けの全部又は一部の停止その他当社が必要かつ適当と認める措置を行うことができる。
- (1) 第13条の規定による役員又は他の者との共同関係若しくは支配関係の変更請求に応じないとき。
 - (2) 総株主の議決権又は出資に係る議決権の過半数が当社の国債店頭取引清算業務の運営に鑑みて適当でないと認められる者によって保有されるに至ったとき。
 - (3) 相談役、顧問その他いかなる名称を有する者であるかを問わず、清算参加者に対し取締役又は執行役と同等以上の支配力を有する者が、当社の国債店頭取引清算業務の運営に鑑みて適当でないと認められるとき。
- 3 当社は、清算参加者が次の各号のいずれかに該当することとなったときは、当該清算参加者を審問のうえ、その事由の消滅するまで、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づく債務の引受けの全部又は一部の停止の措置を行うことができる。
- (1) 資本金の額又は出資の総額が3億円を下回り、速やかな回復が見込めないとき。
 - (2) 純財産額（金融商品取引業者以外の者にあつては、純資産額）が10億円を下回り、速やかな回復が見込めないとき。
 - (3) 金融商品取引業者について、自己資本規制比率が140パーセントを下回り、速やかな回復が見込めないとき、証券金融会社又は短資会社にあつては、これに準ずる場合に該当したとき。
 - (4) 特別金融商品取引業者について、連結自己資本規制比率が140パーセントを下回り、速やかな回復が見込めないとき。
 - (5) 国際統一基準行等について、次のaからcまでのいずれかに該当することとなったとき（外国銀行にあつては、これに準ずる場合において当社が必要と認めるとき）。
 - a 単体又は連結普通株式等Tier1比率が4.5パーセントを下回り、速やかな回復が見込めないとき。
 - b 単体又は連結Tier1比率が6パーセントを下回り、速やかな回復が見込めないとき。
 - c 単体又は連結総自己資本比率が8パーセントを下回り、速やかな回復が見込めないとき。
 - (6) 国内基準行等について、国内基準に係る単体又は連結自己資本比率が4パーセントを下回り、速やかな回復が見込めないとき。
 - (7) 保険会社について、単体又は連結ソルベンシー・マージン比率が200パーセントを下回り、速やかな回復が見込めないとき。

4 当社は、清算参加者が国債店頭取引他社清算参加者である場合において、当該清算参加者が次の各号のいずれかに該当することとなったときは、当該清算参加者を審問のうえ、その事由の消滅するまで、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づく債務（有価証券等清算取次ぎに係るものに限る。）の引受けの全部又は一部の停止の措置を行うことができる。

- (1) 資本金の額又は出資の総額が3億円を下回り、速やかな回復が見込めないとき。
- (2) 純財産額（金融商品取引業者以外の者にあつては、純資産額）が、200億円を下回り、速やかな回復が見込めないとき。
- (3) 金融商品取引業者について、自己資本規制比率が200パーセントを下回り、速やかな回復が見込めないとき、証券金融会社又は短資会社にあつては、これに準ずる場合において当社が必要と認めるとき。
- (4) 特別金融商品取引業者について、連結自己資本規制比率が200パーセントを下回り、速やかな回復が見込めないとき。
- (5) 国際統一基準行等について、次のaからcまでのいずれかに該当することとなったとき（外国銀行にあつては、これに準ずる場合において当社が必要と認めるとき）。
 - a 単体又は連結普通株式等Tier1比率が4.5パーセントを下回り、速やかな回復が見込めないとき。
 - b 単体又は連結Tier1比率が6パーセントを下回り、速やかな回復が見込めないとき。
 - c 単体又は連結総自己資本比率が8パーセントを下回り、速やかな回復が見込めないとき。
- (6) 国内基準行等について、国内基準に係る単体又は連結自己資本比率が4パーセントを下回り、速やかな回復が見込めないとき。
- (7) 保険会社について、単体又は連結ソルベンシー・マージン比率が400パーセントを下回り、速やかな回復が見込めないとき。

5 当社は、清算参加者が次の各号のいずれかに該当することとなったときは、当該清算参加者を審問のうえ、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引（第1号に定めるときにあつては信託口で処理すべき取引を除き、第2号に定めるときにあつては信託口で処理すべき取引に限る。）に基づく債務の引受けの全部又は一部の停止の措置を行うことができる。

- (1) 清算参加者（当該清算参加者がその親会社等から親会社等保証を受けている場合には、当該清算参加者の親会社等（当該清算参加者のために親会社等保証を行う親会社等に限る。）の純財産額（親会社等が金融商品取引業者でない場合には、純資産額又はこれに相当する額）が、当社が定める額を下回り、速やかな回復が見込めない

とき。

(2) 信託の受託者である清算参加者が受託する信託財産残高における国債残高に当社が定める数値を乗じた額が、当社が定める額を下回り、速やかな回復が見込めないとき。

- 6 当社は、清算参加者が第18条第1項第1号から第5号までのいずれかに掲げる行為（同項第4号にあっては事業の全部の承継、同項第5号にあっては事業の全部の譲渡に限る。）をしようとする場合において、国債店頭取引清算資格の喪失申請を行わないときは、当該清算参加者を審問のうえ、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づく債務の引受けの全部又は一部の停止の措置を行うことができる。
- 7 当社は、国債店頭取引他社清算参加者が有価証券等清算取次ぎに係る業務の廃止をしようとする場合において、国債店頭取引清算資格の喪失申請を行わないときは、当該清算参加者を審問のうえ、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づく債務（有価証券等清算取次ぎに係るものに限る。）の引受けの全部又は一部の停止の措置を行うことができる。
- 8 当社は、清算参加者のために親会社等保証を行う親会社等が第4項各号のいずれかに該当することとなったときは、当該清算参加者を審問のうえ、その事由の消滅するまで、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づく債務の引受けの全部又は一部の停止の措置を行うことができる。
- 9 当社は、清算参加者のために親会社等保証を行う親会社等が親会社等保証を解消しようとする場合又は第18条第1項第1号及び第3号から第5号までのいずれかに掲げる行為（同項第4号にあっては事業の全部の承継、同項第5号にあっては事業の全部の譲渡に限る。）をしようとする場合において、当該清算参加者が国債店頭取引清算資格の喪失申請を行わないときは、当該清算参加者を審問のうえ、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づく債務の引受けの全部又は一部の停止の措置を行うことができる。
- 10 当社は、第6条第3項の申請により国債店頭取引清算資格を取得した清算参加者について当社が第44条第1項及び第45条第1項の規定により債務の引受けを行ったことにより負担する債務に関し当社が定める比率以上の割合が対当しなかったときは、当該清算参加者を審問のうえ、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づく債務の引受けの全部又は一部の停止の措置を行うことができる。
- 11 当社は、清算参加者がスポンサー利用参加者である場合において、当該清算参加者が第90条の4第2項に規定する預託をしないときは、当該清算参加者を審問のうえ、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づく債務の引受けの全部若しくは一部の停止の措置を行うことができる。

(事業の廃止等において国債店頭取引清算資格喪失申請を行わないことにより債務の引受けの停止を受けた清算参加者に対する措置)

第29条 当社は、前条第6項の規定により清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づく債務の引受けの停止を行った場合には、当社が必要と認める整理を当該清算参加者に行わせることができる。

2 当社は、前項の規定による整理を行うためその他当社が必要と認める限度において、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づく債務の引受けを行うことができる。

(信用状況に応じた清算参加者に対する当初証拠金の割増措置)

第29条の2 当社は、次の各号に掲げる場合に依りて、清算参加者が当該各号のいずれかの事由に該当することとなつたと認める場合には、当該清算参加者に対し、当社の定めるところにより当初証拠金所要額の引上げの措置を行うことができる。

(1) 当該清算参加者が第6条第1項又は第3項の申請により国債店頭取引清算資格を取得した清算参加者(第9条の3の規定により親会社等保証を受けた清算参加者を除く。)である場合

a 当該清算参加者が金融商品取引業者である場合にあっては、その自己資本規制比率(特別金融商品取引業者である場合については自己資本規制比率及び連結自己資本規制比率。以下この条において同じ。)が当社の定める水準を下回るとともに、その信用力が十分でないおそれがあると当社が定める場合に該当するとき(当該清算参加者が証券金融会社又は短資会社である場合にあっては、これらに準じる場合に該当するとき)。

b 当該清算参加者が銀行等である場合にあっては、その単体又は連結自己資本比率が当社の定める水準を下回るとともに、その信用力が十分でないおそれがあると当社が定める場合に該当するとき。

c 当該清算参加者が保険会社である場合にあっては、その単体又は連結ソルベンシー・マージン比率が当社の定める水準を下回るとともに、その信用力が十分でないおそれがあると当社が定める場合に該当するとき。

d 当該清算参加者の信用力が十分でないとき。

(2) 当該清算参加者がその親会社等から親会社等保証を受けている場合

a 当該清算参加者が金融商品取引業者である場合にあっては、その自己資本規制比率が当社の定める水準を下回るとともに、当該清算参加者の親会社等(当該清算参加者のために親会社等保証を行う親会社等に限る。以下本号において同じ。)の信用力が十分でないおそれがあると当社が定める場合に該当するとき(当該清算参加者が証券金融会社又は短資会社である場合にあっては、これらに準じる場合に該当す

るとき)。

- b 当該清算参加者が銀行等である場合にあっては、その単体又は連結自己資本比率が当社の定める水準を下回るとともに、当該清算参加者の親会社等の信用力が十分でないおそれがあると当社が定める場合に該当するとき。
- c 当該清算参加者が保険会社である場合にあっては、その単体又は連結ソルベンシー・マージン比率が当社の定める水準を下回るとともに、当該清算参加者の親会社等の信用力が十分でないおそれがあると当社が定める場合に該当するとき。
- d 当該清算参加者の親会社等の信用力が十分でない当社が定める場合に該当するとき。

(スポンサー利用参加者に対するポジション改善指示の措置)

第29条の3 当社は、清算参加者がスポンサー利用参加者である場合において、当該清算参加者が第90条の4第2項に規定する預託をしないときは、当該清算参加者を審問のうえ、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づくポジションの改善指示の措置を行うことができる。

(債務の引受けの停止等の措置の解除)

第30条 当社が第28条の規定により期間を定めずに債務の引受けの停止（有価証券等清算取次ぎに係る債務に限って行うものを除く。）を行った場合には、対象清算参加者は、その事由を除去したときは、説明書を添付して停止の解除を申請することができる。

- 2 当社は、前項の申請に基づく停止の解除が適当であると認めるときは、その申請を承認する。
- 3 第1項の対象清算参加者が、同項の停止を受けた日から1年以内に、前項の承認を受けられない場合は、当社は、取締役会の決議により、当該対象清算参加者の国債店頭取引清算資格を取り消すことができる。
- 4 前3項の規定は、当社が第28条の規定により期間を定めずに債務の引受けの停止（有価証券等清算取次ぎに係る債務に限って行うものに限る。）を行った場合について準用する。この場合において、前項中「国債店頭取引清算資格を取り消す」とあるのは「国債店頭取引他社清算資格を取り消し、国債店頭取引自社清算資格を付与する」と読み替えるものとする。

(異議の申立て等)

第31条 第13条第1項ただし書及び第2項の規定は第28条及び第29条の3の審問

について、第13条第3項から第5項までの規定は第28条及び第29条の3の措置について、それぞれ準用する。

(金融商品取引業者等に該当しないこととなった清算参加者に対する措置)

第32条 清算参加者は、次の各号のいずれかの事由が生じた場合には、国債店頭取引清算資格を喪失する。

- (1) 第6条第1項各号のいずれにも該当しないこととなること
- (2) 解散

(措置評価委員会)

第33条 当社は、第28条又は第29条の3に規定する措置を清算参加者に対し行おうとするときは、あらかじめ、当該措置を行うことの適否につき、措置評価委員会に諮問し、その意見を尊重するものとする。

- 2 前項の規定にかかわらず、当社は、緊急の必要があるときは、措置評価委員会に諮問しないことができる。
- 3 前2項に定めるもののほか、措置評価委員会に関する事項は当社が規則で定める。

(措置の通知等)

第34条 当社は、本業務方法書に基づき債務の引受けの全部若しくは一部の停止を行おうとするとき又は国債店頭取引清算資格を取り消そうとするときは、その対象清算参加者に対し、あらかじめその旨を通知する。

- 2 前項の規定は、第32条の規定により清算参加者が国債店頭取引清算資格を喪失した場合について準用する。この場合において、同項中「あらかじめ」とあるのは「直ちに」と読み替えるものとする。
- 3 当社は、本業務方法書に基づき債務の引受けの全部若しくは一部の停止を行ったとき、国債店頭取引清算資格の取消しを清算参加者に対して行ったとき又は第32条の規定により清算参加者が国債店頭取引清算資格を喪失したときは、各清算参加者に対し、その旨を通知する。

(国債店頭取引清算資格を取り消された者等の未決済約定の取扱い)

第35条 当社は、本業務方法書に基づき国債店頭取引清算資格の取消しを清算参加者に対して行ったとき又は第32条の規定により清算参加者が国債店頭取引清算資格を喪失したときは、当社が必要と認める整理を行わせることができる。

- 2 前項の清算参加者であった者は、その者の未履行債務の履行又は整理を行うためその

他当社が必要と認める範囲内において、なお清算参加者とみなす。

(清算参加者に対する勧告)

第36条 当社は、清算参加者の業務又は財産の状況が、当社の国債店頭取引清算業務の運営に鑑みて、適当でないと認めるときは、当該清算参加者に対し、適切な措置を講ずることを勧告することができる。

2 当社は前項の勧告を行った場合において必要があると認めるときは、当該清算参加者に対し、その対応について報告を求めることができる。

第3章 有価証券等清算取次ぎ

(有価証券等清算取次ぎの対象取引)

第37条 国債店頭取引他社清算参加者が行うことができる有価証券等清算取次ぎの対象取引は、第4条第2項第5号に掲げる取引とする。

(委託の際の特定事項)

第38条 清算参加者は、前条に規定する有価証券等清算取次ぎを受託する場合には、その顧客から、あらかじめ、一の対象取引ごとに次の各号に掲げる事項について特定を受けていることを確認するものとする。

- (1) 当該対象取引の相手方となる清算参加者
- (2) 当該対象取引の基となる取引について、国債証券の売買、現金担保付債券貸借取引、銘柄先決め現先取引又は銘柄後決め現先取引の別
- (3) 国債証券の受取り又は引渡しの区別
- (4) 国債証券の銘柄及び数量（銘柄後決め現先取引にあつては、バスケット）
- (5) 当該対象取引に係る金銭の額
- (6) 国債証券及び金銭を授受する日

(清算対象取引に係る区分管理)

第39条 国債店頭取引他社清算参加者は、その清算対象取引について、有価証券等清算取次ぎによるものとそれ以外のものとを、区分して管理しなければならない。

2 国債店頭取引他社清算参加者は、有価証券等清算取次ぎに基づく取引については、その顧客ごとにネットティング口座を開設し、当該ネットティング口座により区分して管理しなければならない。

(有価証券等清算取次ぎに関する報告)

第39条の2 当社は、国債店頭取引他社清算参加者に対し、有価証券等清算取次ぎに基づく取引に関し、その顧客の名称その他当社がリスク管理上必要と認める事項について報告を求めることができる。

(顧客ポジションの移管の申込み)

第39条の3 国債店頭取引他社清算参加者に有価証券等清算取次ぎを委託している顧客は、当社が定めるところにより、当該顧客に係る顧客ポジションを他の国債店頭取引他社清算参加者に移管することができる。

- 2 前項に規定する移管は、ネットィング口座ごとに行うものとする。
- 3 顧客は、第1項に規定する移管を行う場合には、当社が定めるところにより、移管先として指定することができるネットィング口座を、国債店頭取引他社清算参加者を通じて、あらかじめ当社に届け出なければならない。
- 4 顧客は、第1項に規定する移管を行う場合には、移管先清算参加者に対して当該移管の申込みをし、承諾を得るものとする。
- 5 移管先清算参加者は、前項に規定する移管の申込みを承諾する場合には、当社が定めるところにより、当該移管を希望する日の正午までに、当社に対して当該移管の申込みを行うものとする。
- 6 第4項に規定する承諾を得た場合には、顧客は、移管元清算参加者に対して当該移管を行おうとする旨を通知するものとする。

(顧客ポジションの移管の成立)

第39条の4 当社は、前条第5項に規定する移管の申込みを受領し、当該申込みの内容その他当社が定める事項が適当と認めた場合には、当該移管を希望する日の午後2時までに、当該申込みを承諾するものとする。

- 2 当社が前項に規定する承諾を行った場合には、当該移管を希望する日の午後5時以降の当社が定める時点において、当該顧客ポジションについて、移管先清算参加者への移管を行うものとし、その時点をもって当該移管が成立するものとする。
- 3 前項の規定により顧客ポジションの移管が成立した場合には、当該顧客ポジションに係る次の各号に掲げる金銭及び代用国債証券のうち、移管元清算参加者を代理人として当社に預託されていたものについては、移管先清算参加者を代理人として当社に預託されたものとみなす。

- (1) 当初証拠金
- (2) 国債店頭取引清算基金

- (3) 変動証拠金
 - (4) 破綻時証拠金
 - (5) 特別清算料担保金
- 4 第2項の規定により顧客ポジションの移管が成立した場合には、当該移管に係る移管元口座は、当該移管が成立した日に廃止されるものとする。
- 5 第2項の規定により顧客ポジションの移管が成立した場合には、当該移管に係る移管先口座は、当該移管が成立した日に開設されるものとする。

第4章 債務の引受け

(債務の引受けの申込み)

- 第40条 清算参加者は、自らが当事者となる清算対象取引に基づく債務を当社に引き受けさせようとする場合には、当社が定めるところにより、一の清算対象取引ごとに、当社が定める方法により、当社に対し債務の引受けの申込みを行わなければならない。
- 2 前項に規定する当社への申込みは、次の各号に掲げる取引ごとに、当該各号に定める事項を内容として、当該取引の当事者が当社に対して共同して行うものとする。

- (1) 国債証券の売買等
 - a 売方清算参加者及び買方清算参加者の名称
 - b 売方清算参加者及び買方清算参加者のネットィング口座
 - c 約定日
 - d 国債証券の銘柄及び数量
 - e 売買決済日に授受する金銭の額
 - f 売買決済日
 - g 有価証券等清算取次ぎによるものである場合はその旨
- (2) 現金担保付債券貸借取引等
 - a 貸方清算参加者及び借方清算参加者の名称
 - b 貸方清算参加者及び借方清算参加者のネットィング口座
 - c 約定日
 - d 国債証券の銘柄及び数量
 - e 取引実行日に授受する金銭の額及び取引決済日に授受する金銭の額
 - f 取引実行日及び取引決済日
 - g 有価証券等清算取次ぎによるものである場合はその旨
- (3) 銘柄先決め現先取引等
 - a 現先売方清算参加者及び現先買方清算参加者の名称

- b 現先売方清算参加者及び現先買方清算参加者のネットティング口座
 - c 約定日
 - d 国債証券の銘柄及び数量
 - e スタート受渡金額及びエンド受渡金額
 - f スタート取引受渡日及びエンド取引受渡日
 - g 有価証券等清算取次ぎによるものである場合はその旨
- (4) 銘柄後決め現先取引等
- a 現先売方清算参加者及び現先買方清算参加者の名称
 - b 現先売方清算参加者及び現先買方清算参加者のネットティング口座 (現先売方清算参加者のネットティング口座又は現先買方清算参加者のネットティング口座が信託口座である場合にあってはネットティング口座及びネットティングの単位を区分する事項)
 - c 約定日
 - d バスケット
 - e スタート受渡金額及びエンド受渡金額
 - f スタート取引受渡日及びエンド取引受渡日
 - g 有価証券等清算取次ぎによるものである場合はその旨
- 3 清算参加者は、当社に清算対象取引に基づく債務の引受けを行わせようとする場合は、第1項に規定する申込みを、次の各号に掲げる取引ごとに、当該各号に定める時間内に行わなければならない。ただし、当該申込みを行うために必要な当社又は当社以外の機関が設置するシステムの稼動に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により債務の引受けの申込みを行うことが不可能又は困難であると当社が認める場合は、当社は、その時間を変更することができる。この場合において、当社は、あらかじめその旨を清算参加者に通知する。
- (1) 個別銘柄取引 債務の引受けを行わせる日の前日の午後6時30分から債務の引受けを行わせる日の午後6時30分まで
 - (2) 銘柄後決め現先取引等のうち約定日の翌日がスタート取引受渡日であるもの 債務の引受けを行わせる日の前日の午後2時から債務の引受けを行わせる日の午後2時まで
 - (3) 銘柄後決め現先取引等のうち約定日がスタート取引受渡日であるもの 債務の引受けを行わせる日の午前7時から午後2時まで
- 4 清算参加者は、当社が定めるところによりあらかじめ当社の承認を得た場合には、第1項に規定する申込みを、代理人を通じて行うことができる。
- 5 銘柄後決め現先取引等 (スタート取引受渡日の翌日をエンド取引受渡日とするものを除く。)に係る第1項に規定する申込みは、当該銘柄後決め現先取引等に基づきUnwi

nd金銭支払債務、Unwind国債引渡債務（バスケット）、Rewind金銭支払債務及びRewind国債引渡債務（バスケット）を負担する旨の現先売方清算参加者及び現先買方清算参加者の間の合意とみなす。当該合意において、当該債務は、第44条第2項第2号から第4号までに掲げる取引ごとに当該各号に定める時刻（同項ただし書の規定により時刻が変更された場合は当該変更後の時刻）に発生する。

（サブスティテューションに係る債務の引受けの申込み）

第41条 前条の規定にかかわらず、清算参加者は、銘柄先決め現先取引等について、サブスティテューションに係る債務を当社に引き受けさせようとするときは、当社が定める方法により、当社に対し債務の引受けの申込みを行わなければならない。

2 前項に規定する当社へのサブスティテューションに係る債務の引受けの申込みは、次の各号に規定する事項を内容として、当該サブスティテューションの当事者が当社に対して共同して行うものとする。

- （1） 当初現先取引等
- （2） サブスティテューション実行日に授受する金銭の額
- （3） サブスティテューション実行日
- （4） 変更後銘柄現先取引等に係る国債証券の銘柄及び数量

3 前条第3項及び第4項の規定は、第1項に規定する債務の引受けの申込みについて準用する。

（決済日等を条件とする債務の引受けの申込み）

第42条 前2条の規定にかかわらず、清算参加者は、あらかじめ特定した清算対象取引（銘柄後決め現先取引等を除く。）について、特定した日（以下「債務引受基準日」という。）以降を決済日等とする債務のみを対象として当社に引き受けさせることとして、債務の引受けの申込みを、当社が定める方法により、特定した期間行うことができる。

2 清算参加者は、前項に規定する債務の引受けの申込みをしようとするときは、当社が定めるところにより、次の各号に掲げる事項をあらかじめ届け出るものとする。この場合において、前項に規定する債務の引受けの申込みを行うことができる期間は、第3号に掲げる債務引受申込開始日の前日の午後6時30分（第40条第3項ただし書の規定により申込みを行う時間が変更された場合は当該変更後の時間の開始時刻）から第2号に掲げる債務引受基準日の前日の午後6時30分（第40条第3項ただし書の規定により申込みを行う時間が変更された場合は当該変更後の時間の最終時刻）までとする。

- （1） 前項に規定する債務の引受けの申込みの対象とする清算対象取引であることを識別するための事項

(2) 債務引受基準日

(3) 債務引受申込開始日（前項に規定する申込みにより債務の引受けを行わせようとする期間の開始日をいう。以下同じ。）

- 3 第1項に規定する債務の引受けの申込み（サブスティテューションに係る債務の引受けの申込みを除く。）は、第40条第2項第1号から第3号までに規定する事項のほか、前項の定めるところにより届け出た清算対象取引を識別するための事項を内容として、当該取引の当事者が当社に対して共同して行うものとする。
- 4 第1項に規定する債務の引受けの申込み（サブスティテューションに係る債務の引受けの申込みに限る。）は、前条第2項各号に規定する事項のほか、第2項の定めるところにより届け出た清算対象取引を識別するための事項を内容として、当該取引の当事者が当社に対して共同して行うものとする。
- 5 第1項に規定する債務の引受けの申込みが清算参加者から行われた場合は、当該申込みに係る清算対象取引について、その相手方である清算参加者から第2項に規定する届出が行われていたものとみなす。ただし、当該相手方清算参加者が、当該清算対象取引について第2項に規定する届出を別途行っていたときは、同項第2号及び第3号に掲げる日については、それぞれ後に到来する日を内容として届出が行われていたものとみなす。
- 6 第40条第3項及び第4項の規定は、第1項に規定する債務の引受けの申込みについて準用する。

（債務の引受けの申込みの取消し）

- 第43条 清算参加者は、第40条第1項、第41条第1項及び前条第1項に規定する債務の引受けの申込みを取り消そうとするときは、当社が定める方法により行わなければならない。
- 2 当社は、前項の債務の引受けの申込みの取消しについては、次条及び第45条の定めるところにより当該申込みに係る清算対象取引に基づく債務の引受けを行う前に限り、当該債務の引受けの申込みの取消しを認めるものとする。
 - 3 清算参加者は、当社が定めるところによりあらかじめ当社の承認を得た場合には、第1項に規定する取消しを、代理人を通じて行うことができる。

（債務の引受け）

- 第44条 第40条第1項及び第41条第1項に規定する債務の引受けの申込みについて当社が国債店頭取引清算業務として行う債務の引受けは、次の各号に掲げる区分に従い、当該各号に定めるところによる。

(1) 国債証券の売買等

国債証券の売買等について第40条第1項に規定する債務の引受けの申込みが売買決済日の前日の午後6時30分まで(同条第3項ただし書の規定により申込みを行う時間が変更された場合は当該変更後の時間内)に行われた場合には、当社は、当該国債証券の売買等について、当該申込みの内容に基づき、売方清算参加者がその相手方である買方清算参加者に対し負担する債務(売買決済日における国債証券の引渡債務をいう。)を免責的に引き受け、当該売方清算参加者は当社により引き受けられた当該債務と同一内容の債務を新たに当社に対し負担し、かつ、当社は買方清算参加者がその相手方である売方清算参加者に対し負担する債務(売買決済日に授受する金銭の額に係る支払債務をいう。)を免責的に引き受け、当該買方清算参加者は当社により引き受けられた当該債務と同一内容の債務を新たに当社に対し負担するものとする。

(2) 現金担保付債券貸借取引等

- a 現金担保付債券貸借取引等について第40条第1項に規定する債務の引受けの申込みが取引実行日の前日の午後6時30分まで(同条第3項ただし書の規定により申込みを行う時間が変更された場合は当該変更後の時間内)に行われた場合

当社は、当該現金担保付債券貸借取引等について、当該申込みの内容に基づき、貸方清算参加者がその相手方である借方清算参加者に対し負担する債務(取引実行日における国債証券の引渡債務及び取引決済日に授受する金銭の額に係る支払債務をいう。)を免責的に引き受け、当該貸方清算参加者は当社により引き受けられた当該債務と同一内容の債務を新たに当社に対し負担し、かつ、当社は借方清算参加者がその相手方である貸方清算参加者に対し負担する債務(取引実行日に授受する金銭の額に係る支払債務、取引決済日における国債証券の引渡債務及び現金担保付債券貸借取引等に係る利金相当額支払債務をいう。)を免責的に引き受け、当該借方清算参加者は当社により引き受けられた当該債務と同一内容の債務を新たに当社に対し負担するものとする。

- b 現金担保付債券貸借取引等について第40条第1項に規定する債務の引受けの申込みが取引実行日の前日の午後6時30分まで(同条第3項ただし書の規定により申込みを行う時間が変更された場合は当該変更後の時間内)から取引実行日の午後6時30分まで(同項ただし書の規定により申込みを行う時間が変更された場合は当該変更後の時間内)に行われた場合

当社は、当該現金担保付債券貸借取引等について、当該申込みの内容に基づき、貸方清算参加者がその相手方である借方清算参加者に対し負担する債務(取引決済日に授受する金銭の額に係る支払債務をいう。)を免責的に引き受け、当該貸方清算参加者は当社により引き受けられた当該債務と同一内容の債務を新たに当社に対し負担

し、かつ、当社は借方清算参加者がその相手方である貸方清算参加者に対し負担する債務（取引決済日における国債証券の引渡債務及び現金担保付債券貸借取引等に係る利金相当額支払債務をいう。）を免責的に引き受け、当該借方清算参加者は当社により引き受けられた当該債務と同一内容の債務を新たに当社に対し負担するものとする。

(3) 銘柄先決め現先取引等

- a 銘柄先決め現先取引等について第40条第1項に規定する債務の引受けの申込みがスタート取引受渡日の前日の午後6時30分まで（同条第3項ただし書の規定により申込みを行う時間が変更された場合は当該変更後の時間内）に行われた場合

当社は、当該銘柄先決め現先取引等について、当該申込みの内容に基づき、現先売方清算参加者がその相手方である現先買方清算参加者に対し負担する債務（スタート取引受渡日における国債証券の引渡債務及びエンド金銭支払債務をいう。）を免責的に引き受け、当該現先売方清算参加者は当社により引き受けられた当該債務と同一内容の債務を新たに当社に対し負担し、かつ、当社は現先買方清算参加者がその相手方である現先売方清算参加者に対し負担する債務（スタート金銭支払債務、エンド取引受渡日における国債証券の引渡債務及び現先取引等に係る利金相当額支払債務をいう。）を免責的に引き受け、当該現先買方清算参加者は当社により引き受けられた当該債務と同一内容の債務を新たに当社に対し負担するものとする。

- b 銘柄先決め現先取引等について第40条第1項に規定する債務の引受けの申込みがスタート取引受渡日の前日の午後6時30分まで（同条第3項ただし書の規定により申込みを行う時間が変更された場合は当該変更後の時間内）からスタート取引受渡日の午後6時30分まで（同項ただし書の規定により申込みを行う時間が変更された場合は当該変更後の時間内）に行われた場合

当社は、当該銘柄先決め現先取引等について、当該申込みの内容に基づき、現先売方清算参加者がその相手方である現先買方清算参加者に対し負担する債務（エンド金銭支払債務をいう。）を免責的に引き受け、当該現先売方清算参加者は当社により引き受けられた当該債務と同一内容の債務を新たに当社に対し負担し、かつ、当社は現先買方清算参加者がその相手方である現先売方清算参加者に対し負担する債務（エンド取引受渡日における国債証券の引渡債務及び現先取引等に係る利金相当額支払債務をいう。）を免責的に引き受け、当該現先買方清算参加者は当社により引き受けられた当該債務と同一内容の債務を新たに当社に対し負担するものとする。

- c 銘柄先決め現先取引等に係るサブスティテューションについて第41条第1項に規定する債務の引受けの申込みがサブスティテューション実行日の前日の午後6時30分まで（同条第3項において準用される第40条第3項ただし書の規定により

申込みを行う時間が変更された場合は当該変更後の時間内)に行われた場合

当社は、当該サブステーションについて、当該申込みの内容及び、当初現先取引等に係る現先売方清算参加者がその相手方である当初現先取引等に係る現先買方清算参加者に対し負担する債務(第2条第38号a(a)に掲げる債務、同号a(d)に掲げる債務、同号a(e)に掲げる債務、サブステーション実行日における変更後銘柄現先取引等に係る国債証券の引渡債務及び変更後銘柄現先取引等のエンド金銭支払債務をいう。)を免責的に引き受け、当該現先売方清算参加者は当社により引き受けられた当該債務と同一内容の債務を新たに当社に対し負担し、かつ、当社は当初現先取引等に係る現先買方清算参加者がその相手方である当初現先取引等に係る現先売方清算参加者に対し負担する債務(第2条第38号a(b)に掲げる債務、同号a(c)に掲げる債務、サブステーション実行日に変更後銘柄現先取引等について授受する金銭の額に係る支払債務、変更後銘柄現先取引等のエンド取引受渡日における変更後銘柄現先取引等に係る国債証券の引渡債務及び変更後銘柄現先取引等に関する現先取引等に係る利金相当額支払債務をいう。)を免責的に引き受け、当該現先買方清算参加者は当社により引き受けられた当該債務と同一内容の債務を新たに当社に対し負担するものとする。

(4) 銘柄後決め現先取引等

当社は、当該銘柄後決め現先取引等について、当該申込みの内容及び、現先売方清算参加者がその相手方である現先買方清算参加者に対し負担する債務(スタート国債引渡債務(バスケット)、Unwind金銭支払債務、Rewind国債引渡債務(バスケット)及びエンド金銭支払債務をいう。)を免責的に引き受け、当該現先売方清算参加者は当社により引き受けられた当該債務と同一内容の債務を新たに当社に対し負担し、かつ、当社は現先買方清算参加者がその相手方である現先売方清算参加者に対し負担する債務(スタート金銭支払債務、Unwind国債引渡債務(バスケット)、Rewind金銭支払債務、エンド国債引渡債務(バスケット)及び現先取引等に係る利金相当額支払債務をいう。)を免責的に引き受け、当該現先買方清算参加者は当社により引き受けられた当該債務と同一内容の債務を新たに当社に対し負担するものとする。

- 2 前項に規定する債務の引受けは、次の各号に掲げる取引ごとに、当該各号に定める時刻に行う。ただし、債務の引受けを行うために必要な当社又は当社以外の機関が設置するシステムの稼動に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により債務の引受けの申込みを行うことが不可能又は困難であると当社が認める場合は、当社は、その時刻を変更することができる。この場合において、当社は、あらかじめその旨を清算参加者に通知する。

- (1) 個別銘柄取引 債務の引受けを行う日の午後6時30分
 - (2) 銘柄後決め現先取引等のうち債務の引受けの申込みが午後2時から午後9時までに行われたもの 債務の引受けの申込みが行われた日の翌日の午前7時
 - (3) 銘柄後決め現先取引等のうち債務の引受けの申込みが午前7時から午前11時までに行われたもの 債務の引受けの申込みが行われた日の午前11時
 - (4) 銘柄後決め現先取引等のうち債務の引受けの申込みが午前11時から午後2時までに行われたもの 債務の引受けの申込みが行われた日の午後2時
- 3 当社は、第1項の規定により引き受けた債務の内容及びその履行について、必要な事項を当該清算参加者に通知するものとする。
- 4 清算参加者が第40条第4項（第41条第3項の規定により準用される場合を含む。）の定めるところにより当社への債務の引受けの申込みを、代理人を通じて行った場合は、当社は、前項に規定する清算参加者への通知を、当該代理人を通じて行うものとする。
- 5 清算参加者は、前2項の通知を受けたときは、その内容を確認するものとする。
- 6 清算参加者は、清算対象取引について第1項の規定により債務の引受けが行われたときは、当該清算対象取引及びその債務の引受けに係る無効、取消、解除その他一切の抗弁を当社に対して主張することができない。

(決済日等を条件とする債務の引受け)

第45条 第42条第1項に規定する債務の引受けの申込みについて当社が国債店頭取引清算業務として行う債務の引受けは、次の各号に掲げる区分に従い、当該各号に定めるところによる。

(1) 国債証券の売買等

売買決済日が債務引受基準日以降に到来する場合は、当社が行う債務の引受けは、前条第1項第1号の規定に準じるものとする。

(2) 現金担保付債券貸借取引等

a 現金担保付債券貸借取引等について、取引実行日が債務引受基準日以降に到来する場合

当社が行う債務の引受けは、前条第1項第2号の規定に準じるものとする。

b 現金担保付債券貸借取引等について、取引実行日が債務引受基準日前日までに到来し、取引決済日が債務引受基準日以降に到来する場合であって、第42条第1項に規定する債務の引受けの申込みが取引実行日の午後6時30分まで（第42条第6項において準用する第40条第3項ただし書の規定により申込みを行う時間が変更された場合は当該変更後の時間内）に行われたとき

当社は、当該現金担保付債券貸借取引等について、当該申込みの内容及び、

貸方清算参加者がその相手方である借方清算参加者に対し負担する債務（取引決済日に授受する金銭の額に係る支払債務をいう。）を免責的に引き受け、当該貸方清算参加者は当社により引き受けられた当該債務と同一内容の債務を新たに当社に対し負担し、かつ、当社は借方清算参加者がその相手方である貸方清算参加者に対し負担する債務（取引決済日における国債証券の引渡債務及び現金担保付債券貸借取引等に係る利金相当額支払債務をいう。）を免責的に引き受け、当該借方清算参加者は当社により引き受けられた当該債務と同一内容の債務を新たに当社に対し負担するものとする。

(3) 銘柄先決め現先取引等

- a 銘柄先決め現先取引等についてスタート取引受渡日が、銘柄先決め現先取引等に係るサブステイテューションについてサブステイテューション実行日が、債務引受基準日以降に到来する場合

当社が行う債務の引受けは、前条第1項第3号の規定に準じるものとする。

- b 銘柄先決め現先取引等について、スタート取引受渡日が債務引受基準日前日までに到来し、エンド取引受渡日が債務引受基準日以降に到来する場合であって、第42条第1項に規定する債務の引受けの申込みがスタート取引受渡日の午後6時30分まで（第42条第6項において準用する第40条第3項ただし書の規定により申込みを行う時間が変更された場合は当該変更後の時間内）に行われたとき

当社は、当該銘柄先決め現先取引等について、当該申込みの内容に基づき、現先売方清算参加者がその相手方である現先買方清算参加者に対し負担する債務（エンド金銭支払債務をいう。）を免責的に引き受け、当該現先売方清算参加者は当社により引き受けられた当該債務と同一内容の債務を新たに当社に対し負担し、かつ、当社は現先買方清算参加者がその相手方である現先売方清算参加者に対し負担する債務（エンド取引受渡日における国債証券の引渡債務及び現先取引等に係る利金相当額支払債務をいう。）を免責的に引き受け、当該現先買方清算参加者は当社により引き受けられた当該債務と同一内容の債務を新たに当社に対し負担するものとする。

- 2 前条第2項から第6項までの規定は、前項に規定する債務の引受けについて準用する。

第5章 清算対象取引の決済

第1節 個別銘柄取引の決済

（個別銘柄取引に係る国債証券のネットィング）

第46条 当社は、清算参加者ごとに、第44条第1項第1号から第3号まで及び前条第

1項の規定により当社及び当該清算参加者が負担する国債証券の引渡債務について、当社又は当該清算参加者が債務を負担する都度、銘柄及び決済日等を同一とする債務について、差引計算し残数量を得るものとする。この場合において、当該国債証券の引渡債務に係る差引計算における対当数量については自動的に弁済され、各清算参加者と当社との間におけるそれぞれ一の残数量の証券引渡債務（以下「個別銘柄取引に係る証券決済債務」という。）に新たに置き換わるものとする。

（個別銘柄取引に係る金銭のネットィング）

第46条の2 当社は、清算参加者ごとに、第44条第1項第1号から第3号まで及び第45条第1項の規定により当社及び当該清算参加者が負担する金銭の支払債務（現金担保付債券貸借取引等に係る利金相当額支払債務、現先取引等に係る利金相当額支払債務及び当初現先取引等の終了に係る利金相当額支払債務を除き、同一銘柄の国債証券についての個別銘柄取引に係るものに限る。）について、当社又は当該清算参加者が債務を負担する都度、決済日等を同一とする債務について、差引計算し残額を得るものとする。この場合において、当該金銭の支払債務に係る差引計算における対当額相当額については自動的に弁済され、各清算参加者と当社との間におけるそれぞれ一の残額の金銭支払債務（以下「個別銘柄取引に係る金銭決済債務」という。）に新たに置き換わるものとする。

（個別銘柄取引に係る利金相当額のネットィング）

第46条の3 当社は、清算参加者ごとに、第44条第1項第2号及び第3号並びに第45条第1項の規定により当社及び当該清算参加者が負担する現金担保付債券貸借取引等に係る利金相当額支払債務、現先取引等に係る利金相当額支払債務及び当初現先取引等の終了に係る利金相当額支払債務について、当社又は当該清算参加者が債務を負担する都度、支払日を同一とする債務について、差引計算し残額を得るものとする。この場合において、当該金銭支払債務に係る差引計算における対当額相当額については自動的に弁済され、各清算参加者と当社との間におけるそれぞれ一の残額の金銭支払債務（以下「個別銘柄取引に係る利金相当額決済債務」という。）に新たに置き換わるものとする。

（個別銘柄取引に係る金銭決済債務の履行方法）

第47条 清算参加者と当社との間の個別銘柄取引に係る金銭決済債務の履行については、次項に規定する個別銘柄取引に係る証券決済債務時価評価額の金銭の授受及び第3項に規定する個別銘柄取引に係る受渡調整金額の金銭の授受により行う。

2 個別銘柄取引に係る証券決済債務時価評価額は、個別銘柄取引に係る証券決済債務に

ついて、当社が定めるところにより時価評価した額とする。

- 3 個別銘柄取引に係る受渡調整金額は、個別銘柄取引に係る金銭決済債務の額と個別銘柄取引に係る証券決済債務時価評価額との差額とする。

第48条 削除

(個別銘柄取引に係る受渡調整金額の金銭の授受)

第49条 個別銘柄取引に係る受渡調整金額の金銭の授受は、次の各号に掲げる区分に従い、当該各号に定めるところにより当社と清算参加者との間において行う。

- (1) 個別銘柄取引に係る金銭決済債務の額が個別銘柄取引に係る証券決済債務時価評価額を上回っている場合

国債証券の受方清算参加者は、個別銘柄取引に係る受渡調整金額の金銭を当社に支払うものとし、国債証券の渡方清算参加者は、個別銘柄取引に係る受渡調整金額の金銭を当社から受領するものとする。

- (2) 個別銘柄取引に係る金銭決済債務の額が個別銘柄取引に係る証券決済債務時価評価額を下回っている場合

国債証券の渡方清算参加者は、個別銘柄取引に係る受渡調整金額の金銭を当社に支払うものとし、国債証券の受方清算参加者は、個別銘柄取引に係る受渡調整金額の金銭を当社から受領するものとする。

(個別銘柄取引に係る利金相当額決済債務の額の金銭の授受)

第50条 個別銘柄取引に係る利金相当額決済債務の支払方清算参加者は個別銘柄取引に係る利金相当額決済債務の額の金銭を当社に支払うものとし、個別銘柄取引に係る利金相当額決済債務に係る受領方清算参加者は個別銘柄取引に係る利金相当額決済債務の額の金銭を当社から受領するものとする。

第2節 銘柄後決め現先取引等の決済

(バスケットネットティング)

第50条の2 当社は、清算参加者ごとに、第44条第1項第4号の規定により当社及び当該清算参加者が負担する国債引渡債務(バスケット)について、当社又は当該清算参加者が債務を負担する都度、次の各号に掲げる債務ごとに、バスケット及び決済日等を同一とする債務について、差引計算し残額相当分を得るものとする。この場合において、当該国債引渡債務(バスケット)に係る差引計算における対当額相当分については自動

的に弁済され、各清算参加者と当社との間におけるそれぞれ一の残額相当分の国債引渡債務（バスケット）に新たに置き換わるものとする。この場合において、置き換わった国債引渡債務（バスケット）のうち、第1号に掲げる債務に係るものを「スタート/Rewind国債引渡債務（バスケット）」と、第2号に掲げるものを「エンド/Unwind国債引渡債務（バスケット）」という。

(1) スタート国債引渡債務（バスケット）及びRewind国債引渡債務（バスケット）

(2) エンド国債引渡債務（バスケット）及びUnwind国債引渡債務（バスケット）

2 当社は、清算参加者ごとに、第44条第1項第4号の規定により当社及び当該清算参加者が負担する金銭の支払債務（現先取引等に係る利金相当額支払債務を除く。）について、当社又は当該清算参加者が債務を負担する都度、次の各号に掲げる債務ごとに、バスケット及び決済日等を同一とする債務について、差引計算し残額を得るものとする。この場合において、当該金銭の支払債務に係る差引計算における対当額相当額については自動的に弁済され、各清算参加者と当社との間におけるそれぞれ一の残額の金銭の支払債務に新たに置き換わるものとする。この場合において、置き換わった金銭の支払債務のうち、第1号に掲げる債務に係るものを「スタート/Rewind金銭支払債務」と、第2号に掲げるものを「エンド/Unwind金銭支払債務」という。

(1) スタート金銭支払債務及びRewind金銭支払債務

(2) エンド金銭支払債務及びUnwind金銭支払債務

(割当可能残高通知)

第50条の3 銘柄割当てにおいて国債証券の渡方となる清算参加者は、当社が定めるところにより、銘柄後決め現先取引等において引き渡すことができる国債証券の銘柄及び数量を、当社が定める方法により、当社に通知しなければならない。

2 清算参加者は、当社が定めるところによりあらかじめ当社の承認を得た場合には、前項に規定する国債証券の銘柄及び数量の通知を、代理人を通じて行うことができる。

(銘柄割当て)

第50条の4 当社は、第50条の2第1項の規定により新たに置き換えられたスタート/Rewind国債引渡債務（バスケット）のうちバスケットネットティングが行われた日を決済日等とするもの及びエンド/Unwind国債引渡債務（バスケット）のうちバスケットネットティングが行われた日の翌日を決済日等とするものに対し、前条に規定する通知に基づき、当社が定めるところにより、国債証券の銘柄及び数量を割り当てる。

- 2 前項の規定により国債証券の銘柄及び数量が割り当てられた場合には、前項に規定するスタート／R e w i n d 国債引渡債務（バスケット）から、前項の規定による国債証券の銘柄及び数量の割当てが行われた部分（以下「スタート／R e w i n d 国債引渡債務（個別銘柄）」という。）を控除する。
- 3 第1項の規定により国債証券の銘柄及び数量が割り当てられた場合には、第1項に規定するエンド／U n w i n d 国債引渡債務（バスケット）から、第1項の規定による国債証券の銘柄及び数量の割当てが行われた部分（以下「エンド／U n w i n d 国債引渡債務（個別銘柄）」という。）を控除する。
- 4 第44条第3項から第6項までの規定は、第1項に規定する銘柄割当てについて準用する。

（銘柄後決め現先取引等に係る国債証券のネットィング）

第50条の5 当社は、清算参加者ごとに、前条の規定による銘柄割当てが行われた場合、当日を決済日等とするスタート／R e w i n d 国債引渡債務（個別銘柄）及びエンド／U n w i n d 国債引渡債務（個別銘柄）について、銘柄を同一とする国債証券の引渡債務について、差引計算し残数量を得るものとする。この場合において、当該国債証券の引渡債務に係る差引計算における対当数量については自動的に弁済され、各清算参加者と当社との間におけるそれぞれ一の残数量の証券引渡債務（以下「銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務」という。）に新たに置き換わるものとする。

（銘柄後決め現先取引等に係る金銭のネットィング）

第50条の6 当社は、清算参加者ごとに、第50条の4の規定による銘柄割当てが行われた場合、当日を決済日等とするスタート／R e w i n d 金銭支払債務及びエンド／U n w i n d 金銭支払債務のうち当該銘柄割当てに係るものとして当社が定める部分について、差引計算し残額を得るものとする。この場合において、当該金銭の支払債務に係る差引計算における対当額相当額については自動的に弁済され、各清算参加者と当社との間におけるそれぞれ一の残額の金銭支払債務（以下「銘柄後決め現先取引等に係る金銭決済債務」という。）に新たに置き換わるものとする。

（銘柄後決め現先取引等に係る利金相当額のネットィング）

第50条の7 当社は、清算参加者ごとに、第50条の4の規定による銘柄割当てが行われた場合、現先取引等に係る利金相当額支払債務のうち翌日を支払日とする債務について、差引計算し残額を得るものとする。この場合において、当該金銭支払債務に係る差引計算における対当額相当額については自動的に弁済され、各清算参加者と当社との間

におけるそれぞれ一の残額の金銭支払債務（以下「銘柄後決め現先取引等に係る利金相当額決済債務」という。）に新たに置き換わるものとする。

（銘柄後決め現先取引等に係る金銭決済債務の履行方法）

第50条の8 清算参加者と当社との間の銘柄後決め現先取引等に係る金銭決済債務の履行については、次項に規定する銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務時価評価額の金銭の授受及び第3項に規定する銘柄先後決め現先取引等に係る受渡調整金額の金銭の授受により行う。

- 2 銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務時価評価額は、銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務について、当社が定めるところにより時価評価した額とする。
- 3 銘柄後決め現先取引等に係る受渡調整金額は、銘柄後決め現先取引等に係る金銭決済債務の額と銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務時価評価額との差額とする。

（銘柄後決め現先取引等に係る受渡調整金額の金銭の授受）

第50条の9 銘柄後決め現先取引等に係る受渡調整金額の金銭の授受は、次の各号に掲げる区分に従い、当該各号に定めるところにより当社と清算参加者との間において行う。

（1） 銘柄後決め現先取引等に係る金銭決済債務の額が銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務時価評価額を上回っている場合

国債証券の受方清算参加者は、銘柄後決め現先取引等に係る受渡調整金額の金銭を当社に支払うものとし、国債証券の渡方清算参加者は、銘柄後決め現先取引等に係る受渡調整金額の金銭を当社から受領するものとする。

（2） 銘柄後決め現先取引等に係る金銭決済債務の額が銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務時価評価額を下回っている場合

国債証券の渡方清算参加者は、銘柄後決め現先取引等に係る受渡調整金額の金銭を当社に支払うものとし、国債証券の受方清算参加者は、銘柄後決め現先取引等に係る受渡調整金額の金銭を当社から受領するものとする。

（銘柄後決め現先取引等に係る利金相当額決済債務の額の金銭の授受）

第50条の10 銘柄後決め現先取引等に係る利金相当額決済債務に係る支払方清算参加者は銘柄後決め現先取引等に係る利金相当額決済債務の額の金銭を当社に支払うものとし、銘柄後決め現先取引等に係る利金相当額決済債務に係る受領方清算参加者は銘柄後決め現先取引等に係る利金相当額決済債務の額の金銭を当社から受領するものとする。

第3節 国債DVP決済

(国債DVP決済の方法及び時限)

第50条の11 個別銘柄取引に係る証券決済債務に係る数量の国債証券及び個別銘柄取引に係る証券決済債務時価評価額の金銭の授受並びに銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務に係る数量の国債証券及び銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務時価評価額の金銭の授受は、日本銀行金融ネットワークシステムを利用した国債資金同時受渡により、次の各号に掲げる取引の種類ごとに当該各号に規定するところにより、当社との間において行う。

(1) 個別銘柄取引

- a 国債証券を引き渡す清算参加者は、決済日等の午後1時30分までに、当社が定めるところにより、国債証券を引き渡し、金銭を受領しなければならない。
- b 金銭を支払う清算参加者は、決済日等の午後2時までに、当社が定めるところにより、金銭を支払い、国債証券を受領しなければならない。

(2) 銘柄後決め現先取引等(第44条第2項第2号に定める時刻に第50条の5及び第50条の6の規定により新たに置き換えられた債務に係るものに限る。)

- a 国債証券を引き渡す清算参加者は、決済日等の午前10時30分までに、当社が定めるところにより、国債証券を引き渡し、金銭を受領しなければならない。
- b 金銭を支払う清算参加者は、決済日等の午前11時までに、当社が定めるところにより、金銭を支払い、国債証券を受領しなければならない。

(3) 銘柄後決め現先取引等(第44条第2項第3号に定める時刻に第50条の5及び第50条の6の規定により新たに置き換えられた債務に係るものに限る。)

- a 国債証券を引き渡す清算参加者は、決済日等の午後1時30分までに、当社が定めるところにより、国債証券を引き渡し、金銭を受領しなければならない。
- b 金銭を支払う清算参加者は、決済日等の午後2時までに、当社が定めるところにより、金銭を支払い、国債証券を受領しなければならない。

(4) 銘柄後決め現先取引等(第44条第2項第4号に定める時刻に第50条の5及び第50条の6の規定により新たに置き換えられた債務に係るものに限る。)

- a 国債証券を引き渡す清算参加者は、決済日等の午後3時30分までに、当社が定めるところにより、国債証券を引き渡し、金銭を受領しなければならない。
- b 金銭を支払う清算参加者は、決済日等の午後4時までに、当社が定めるところにより、金銭を支払い、国債証券を受領しなければならない。

2 清算参加者は、当社が定めるところによりあらかじめ当社の承認を得た場合には、前項に規定する国債証券の授受及び金銭の授受を、当社が定めるところにより、代理人を通じて行うことができる。

- 3 清算参加者は、前2項の規定により決済を行う場合には、円滑な決済の確保に努めるものとする。

(国債先物ペアオフネットィング)

第50条の12 前条の規定にかかわらず、次項に定めるところにより成立した国債先物ペアオフネットィングの組合せに係る決済については、当該決済の開始予定時点において、前条第1項第1号に定める国債証券及び金銭の授受が行われたものとみなす。ただし、国債先物受渡決済（証券取引等業務方法書第73条の11に規定する受渡決済をいう。以下この条において同じ。）に係る受渡決済代金と個別銘柄取引に係る証券決済債務時価評価額に相違が生じた場合における差額の金銭の授受については当社と清算参加者との間において行う。

- 2 当社は、ペアオフネットィング利用申請参加者の国債先物受渡決済及び個別銘柄決済（個別銘柄取引に係る証券決済債務に係る数量の国債証券及び個別銘柄取引に係る証券決済債務時価評価額の金銭の授受をいう。）を対象として、当社が定めるところにより、国債先物ペアオフネットィングの組合せを成立させる。ただし、国債先物ペアオフネットィングの組合せ成立の計算に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、当社が国債先物ペアオフネットィングの組合せを成立させることが適当でないとする場合には、この限りでない。
- 3 前項の規定により国債先物ペアオフネットィングの組合せが成立した場合であっても、第1項の規定によって決済が行われたものとみなされるまでに当社がペアオフネットィング利用申請参加者の破綻等を認定した場合又は証券取引等業務方法書第76条第5項の定めるところにより支払不能等の認定を行った場合は、当社は成立した国債先物ペアオフネットィングの組合せを取り消すことができる。
- 4 清算参加者（国債先物等清算参加者（証券取引等業務方法書第5条第3項に規定する国債先物等清算参加者をいう。）である清算参加者に限る。）は、国債先物ペアオフネットィングの利用を希望するときは、当社が定めるところにより、あらかじめ国債先物ペアオフネットィングの利用の申請を行わなければならない。

第4節 フェイル

(フェイルの取扱い)

第51条 第50条の11に規定する決済について、国債証券の渡方清算参加者がフェイルを発生させた場合は、当該決済はその翌日以降の日に繰り延べる。

- 2 前項の規定により国債証券の渡方清算参加者と当社との間における決済が繰り延べら

れた場合には、当社と国債証券の受方清算参加者との間における決済のうち当社が指定するものについて、フェイルの場合における決済日に行うものとする。

3 フェイルに係る決済に関する国債証券の授受及び金銭の授受については、次の各号に掲げる取引の種類に応じて、当該各号に定める規定を準用する。

(1) 個別銘柄取引 第50条の11の規定（第1項第2号から第4号までの規定を除く。）

(2) 銘柄後決め現先取引等 第50条の11の規定（第1項第1号、第3号及び第4号の規定を除く。）

4 前項の規定にかかわらず、フェイルに係る決済について、円滑な決済の確保のために当社が特に必要と認める場合は、当社がその都度定める方法により決済を行うことができる。

(フェイルチャージの授受)

第52条 フェイルに係る決済の渡方清算参加者は、当社が定める金額のフェイルチャージを当社に支払うものとし、当社は、当社が定める金額のフェイルチャージをフェイルに係る決済の受方清算参加者に支払うものとする。

2 前項に規定する事項のほか、フェイルチャージに関し必要な事項は、当社が定める。

(フェイルに係る国債証券について利払期日が到来した場合の取扱い)

第53条 フェイルに係る決済について、当該決済に係る国債証券の利払期日の前日（銀行休業日に当たるときは、順次繰り上げる。）においても当該決済が行われない場合は、当該フェイルに係る決済の渡方清算参加者は、当該利払期日に、受領する利金相当額の金銭を当社に支払うものとし、当該フェイルに係る決済の受方清算参加者は、受領する利金相当額の金銭を、当該利払期日に、当社から受領するものとする。

(フェイルに係る国債証券について償還期日が到来した場合の取扱い)

第54条 フェイルに係る決済について、当該決済に係る国債証券の償還期日（当該国債証券が当社が定める国債証券である場合にあつては、利払期日。以下この条において同じ。）の前日（銀行休業日に当たるときは、順次繰り上げる。）においても当該決済が行われない場合は、当該フェイルに係る決済の渡方清算参加者は、償還期日に、受領する償還金相当額（当該国債証券が当社が定める国債証券である場合にあつては、利金相当額。以下この条において同じ。）の金銭を当社に支払うものとし、当該フェイルに係る決済の受方清算参加者は、当該償還金相当額の金銭を、償還期日に、当社から受領するものとする。

- 2 前項の場合は、当該フェイルに係る決済の受方清算参加者は、償還期日に、当該フェイルに係る決済における支払額の金銭を当社に支払うものとし、当該フェイルに係る決済の渡方清算参加者は、当該金銭を、償還期日に、当社から受領するものとする。
- 3 第51条第3項の規定にかかわらず、前2項の規定により金銭の授受が行われた場合は、当該金銭の授受をもってフェイルに係る決済が行われたものとみなす。

第6章 バイ・イン等

第1節 バイ・イン

(バイ・イン)

第55条 当社は、バイ・インを行うことができる。

- 2 バイ・インによる売買に係る決済は、バイ・インが行われた日から起算して4日目（休業日を除外する。以下日数計算において同じ。）の日までの間の当社がその都度定める日に決済を行うものとする。

(バイ・インに対する売付けを行った清算参加者と当社との間の決済)

第56条 バイ・インによる売買に係る決済のために、バイ・インに対する売付けを行った清算参加者が当社との間で授受する金銭の額及び国債証券の数量は、バイ・インによる売買ごとの売買代金（決済日等までの日数に応じた経過利子（額面総額に当該国債証券の利率を乗じて算出した額について決済を行う日までの分を日割をもって計算した額をいう。）を含む（円位未満は切り捨てる。）。以下同じ。）の額及び国債証券の数量とする。

- 2 第50条の11の規定（第1項第2号から第4号までの規定を除く。）は、バイ・インに対する売付けを行った清算参加者と当社との間の決済に係る国債証券の授受及び金銭の授受について準用する。
- 3 バイ・インによる売買に係る決済については、バイ・インに対する売付けを行った清算参加者は、前項において準用する第50条の11第1項第1号aに規定する時限において、フェイルを発生させてはならない。
- 4 当社は、第1項及び第2項の規定によりバイ・インによる売買に係る決済が行われた場合には、当該バイ・インの対象であるフェイルに係る決済の受方清算参加者との間において、第51条第3項の規定により準用される第50条の11の規定（第1項第2号から第4号までの規定を除く。）により当該フェイルに係る決済に関する国債証券の授受及び金銭の授受を行う。

(バイ・インの対象であるフェイルに係る決済の渡方清算参加者と当社との間の決済)

第57条 第55条の規定によりバイ・インが行われた場合には、当該バイ・インの対象であるフェイルに係る決済の渡方清算参加者は、当社との間において、当該バイ・インに係る売買代金の額と当該バイ・インの対象であるフェイルに係る個別銘柄取引に係る証券決済債務時価評価額又は銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務時価評価額との差額及び当社が当該バイ・インを行うための資金調達に要した費用相当額を授受するものとする。

- 2 第69条の規定（第1項第2号の規定を除く。）は、前項に規定する金銭の授受について準用する。
- 3 第51条第3項の規定にかかわらず、前2項の規定により金銭の授受が行われた場合には、当該バイ・インの対象であるフェイルに係る決済の渡方清算参加者と当社との間の当該バイ・インによる売買に係る決済及び当該フェイルに係る決済が行われたものとみなす。

第2節 参加者バイ・イン

(参加者バイ・イン)

第58条 フェイルに係る決済の受方清算参加者は、参加者バイ・インを行うことができる。

- 2 参加者バイ・インによる売買に係る決済は、参加者バイ・インが行われた日から起算して4日目の日までの間の参加者バイ・インを行う清算参加者と当該清算参加者に売付けを行う者との間で合意した日に決済を行うものとする。

(参加者バイ・インを行った清算参加者と当社との間の決済)

第59条 前条の規定により参加者バイ・インが行われた場合には、当該参加者バイ・インを行った清算参加者は、当社との間において、当該参加者バイ・インに係る売買代金の額と当該参加者バイ・インの対象であるフェイルに係る個別銘柄取引に係る証券決済債務時価評価額又は銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務時価評価額との差額及び当該清算参加者が当該参加者バイ・インを行うための資金調達に要した費用相当額を授受するものとする。

- 2 第69条の規定（第1項第2号の規定を除く。）は、前項に規定する金銭の授受について準用する。
- 3 第51条第3項の規定にかかわらず、前2項の規定により金銭の授受が行われた場合

には、参加者バイ・インを行った清算参加者との当社との間の当該参加者バイ・インによる売買に係る決済及び当該参加者バイ・インの対象であるフェイルに係る決済が行われたものとみなす。

(参加者バイ・インの対象であるフェイルに係る決済の渡方清算参加者と当社との間の決済)

第60条 第58条の規定により参加者バイ・インが行われた場合には、当該参加者バイ・インの対象であるフェイルに係る決済の渡方清算参加者は、当該参加者バイ・インの決済が行われる日に、当該参加者バイ・インに係る売買代金の額と当該参加者バイ・インの対象であるフェイルに係る個別銘柄取引に係る証券決済債務時価評価額又は銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務時価評価額との差額及び当該参加者バイ・インを行った清算参加者が当該参加者バイ・インを行うための資金調達に要した費用相当額を当社との間で授受するものとする。

2 第69条の規定（第1項第2号の規定を除く。）は、前項に規定する金銭の授受について準用する。

3 第51条第3項の規定にかかわらず、前2項の規定により金銭の授受が行われた場合には、当該参加者バイ・インの対象であるフェイルに係る決済の渡方清算参加者と当社との間の当該フェイルに係る決済が行われたものとみなす。

第3節 統一慣習バイ・イン通知

(統一慣習バイ・イン通知)

第61条 フェイルに係る決済の受方清算参加者は、当該フェイルを起因として統一慣習バイ・インの通知又は再通知を日本証券業協会の協会員又は顧客から受けた場合には、当該受方清算参加者は、当社に対し当該統一慣習バイ・インについて通知又は再通知を受けた旨通知（以下「統一慣習バイ・イン通知」という。）を行うことができる。

(統一慣習バイ・イン通知を行った清算参加者と当社との間の決済)

第62条 前条に規定する統一慣習バイ・イン通知が行われた場合において統一慣習バイ・インが行われたときは、統一慣習バイ・イン通知を行った清算参加者は、当該統一慣習バイ・インの決済が行われる日に、当社との間において、当該統一慣習バイ・インに係る売買代金の額と当該統一慣習バイ・イン通知の対象であるフェイルに係る個別銘柄取引に係る証券決済債務時価評価額又は銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務時価評価額との差額及び統一慣習バイ・インに係る費用相当額（統一慣習規則に基づき当

該統一慣習バイ・インを行った者が統一慣習バイ・インを行うための資金調達に要した費用相当額をいう。)を授受するものとする。

- 2 第69条の規定(第1項第2号の規定を除く。)は、前項に規定する金銭の授受について準用する。
- 3 第51条第3項の規定にかかわらず、前2項の規定により金銭の授受が行われた場合には、統一慣習バイ・イン通知を行った清算参加者と当社との間の当該統一慣習バイ・イン通知の対象であるフェイルに係る決済が行われたものとみなす。

(統一慣習バイ・イン通知の対象であるフェイルに係る決済の渡方清算参加者との当社との間の決済)

第63条 第61条に規定する統一慣習バイ・イン通知が行われた場合において統一慣習バイ・インが行われたときは、当該統一慣習バイ・イン通知の対象であるフェイルに係る決済の渡方清算参加者は、当該統一慣習バイ・インの決済が行われる日に、当該統一慣習バイ・インに係る売買代金の額と当該統一慣習バイ・イン通知の対象であるフェイルに係る個別銘柄取引に係る証券決済債務時価評価額又は銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務時価評価額との差額及び統一慣習バイ・インに係る費用相当額を当社との間で授受するものとする。

- 2 第69条の規定(第1項第2号の規定を除く。)は、前項に規定する金銭の授受について準用する。
- 3 第51条第3項の規定にかかわらず、前2項の規定により金銭の授受が行われた場合には、統一慣習バイ・イン通知の対象であるフェイルに係る決済の渡方清算参加者と当社との間の当該統一慣習バイ・イン通知の対象であるフェイルに係る決済が行われたものとみなす。

第4節 雑則

(規則への委任)

第64条 この章に規定する事項のほか、バイ・イン、参加者バイ・イン及び統一慣習バイ・イン通知に関し必要な事項は、当社が規則により定める。

第7章 変動証拠金

(変動証拠金の預託)

第65条 清算参加者は、清算対象取引に係る金銭の受領額(現金担保付債券貸借取引等

に係る利金相当額支払債務、現先取引等に係る利金相当額支払債務及び当初現先取引等の終了に係る利金相当額支払債務に係る金銭の受領額を除く。以下この条において同じ。)の当社が定める現在価値と国債証券の受領数量の当社が定める時価評価額の合計額が当該取引に係る金銭の支払額(現金担保付債券貸借取引等に係る利金相当額支払債務、現先取引等に係る利金相当額支払債務及び当初現先取引等の終了に係る利金相当額支払債務に係る金銭の支払額を除く。以下この条において同じ。)の当社が定める現在価値と国債証券の引渡数量の当社が定める時価評価額の合計額に満たない場合には、その不足額を、変動証拠金として、不足額が生じた日の翌日に当社に預託しなければならない。

- 2 清算参加者は、清算対象取引に係る金銭の受領額の当社が定める現在価値と国債証券の受領数量の当社が定める時価評価額の合計額が当該取引に係る金銭の支払額の当社が定める現在価値と国債証券の引渡数量の当社が定める時価評価額の合計額を上回る場合には、その余剰額について、変動証拠金として、余剰額が生じた日の翌日に当社より預託を受けるものとする。

(フェイルに係る変動証拠金の預託)

第66条 清算参加者は、フェイルに係る決済に関する金銭の受領額(第53条の規定により受領する金銭の額を除く。以下この条において同じ。)の当社が定める現在価値と国債証券の受領数量の当社が定める時価評価額の合計額が当該決済に係る金銭の支払額(第53条の規定により支払う金銭の額を除く。以下この条において同じ。)の当社が定める現在価値と国債証券の引渡数量の当社が定める時価評価額の合計額に満たない場合には、その不足額を、フェイルに係る変動証拠金として、不足額が生じた日の翌日に当社に預託しなければならない。

- 2 清算参加者は、フェイルに係る決済に関する金銭の受領額の当社が定める現在価値と国債証券の受領数量の当社が定める時価評価額の合計額が当該決済に係る金銭の支払額の当社が定める現在価値と国債証券の引渡数量の当社が定める時価評価額の合計額を上回る場合には、その余剰額について、変動証拠金として、余剰額が生じた日の翌日に当社より預託を受けるものとする。

(変動証拠金の返還)

第67条 清算参加者は、前2条の定めるところにより当社から預託を受けた変動証拠金について、預託を受けた日の翌日に、当社に返還しなければならない。この場合において、当該変動証拠金については、当社が定める利率により利息を付すものとする。

- 2 清算参加者は、前2条の定めるところにより当社に預託した変動証拠金について、預託を行った日の翌日に、当社より返還を受けるものとする。この場合において、当該変

動証拠金については、当社が定める利率により利息を付すものとする。

第8章 FOS決済

(FOS決済)

第68条 次の各号に掲げる金銭の授受は、当該各号に掲げる金銭ごとに、同一清算参加者の総支払金額と総受領金額の差引額の授受(以下「FOS決済」という。)により行う。

- (1) 第49条、第50条、第50条の10、第50条の12第1項ただし書、第52条から第54条まで、第65条から第67条まで及び第70条の8第4項の規定により行う金銭の授受
- (2) 第50条の9の規定により行う金銭の授受

(FOS決済の方法及び時限)

第69条 FOS決済は、日本銀行当座預金取引における清算参加者の当座勘定と当社の当座勘定との間の振替により、次の各号に掲げる金銭ごとに、当該各号に定めるところにより、当社との間において行う。

- (1) 前条第1号に掲げる金銭
 - a 支払方清算参加者は、決済日等の午前10時までに、当社が定めるところにより、金銭を支払わなければならない。
 - b 受領方清算参加者は、決済日等の午前10時30分以降速やかに、当社が定めるところにより、金銭を受領するものとする。
 - (2) 前条第2号に掲げる金銭
 - a 支払方清算参加者は、決済日等の午後3時30分までに、当社が定めるところにより、金銭を支払わなければならない。
 - b 受領方清算参加者は、決済日等の午後4時以降速やかに、当社が定めるところにより、金銭を受領するものとする。
- 2 清算参加者は、当社が定めるところによりあらかじめ当社の承認を得た場合には、前項に規定する金銭の授受を、当社が定めるところにより、代理人を通じて行うことができる。

第9章 当初証拠金及び国債店頭取引清算基金

第1節 当初証拠金

(当初証拠金の預託義務)

第70条 清算参加者は、当社に対する国債店頭取引清算業務に係る債務の履行を確保する目的の当初証拠金を、当社が定めるところにより、当社に預託しなければならない。

- 2 清算参加者は、当社に預託している当初証拠金の額が当初証拠金所要額に満たない場合は、その不足額以上の額の金銭を、当社が定めるところにより、当社に追加預託しなければならない。

(当初証拠金の所要額)

第70条の2 当初証拠金所要額に関する事項は、当社が規則で定める。

(当初証拠金の返還)

第70条の3 清算参加者は、当社に預託している当初証拠金のうち、当初証拠金所要額を超える額を限度として、当社に返還を請求することができる。

- 2 前項の請求があった場合において、当社が特に必要があると認めるときは、当該清算参加者の当初証拠金の全部又は一部の返還を停止することができる。

(緊急当初証拠金による当初証拠金所要額の変更)

第70条の4 当社は、国債証券先物取引（株式会社大阪取引所における国債証券に係る法第2条第21項第1号に掲げる取引をいう。）の相場が当社が定める基準を超えて変動した場合その他当社が必要と認めた場合には、当社が定めるところにより、緊急当初証拠金による当初証拠金所要額の引上げを行う。

- 2 当社は、前項の規定により当初証拠金所要額の引上げを行う場合には、当社が定める時刻以降速やかに清算参加者に通知する。

第2節 国債店頭取引清算基金

(国債店頭取引清算基金の預託義務)

第70条の5 清算参加者は、当社に対する国債店頭取引清算業務に係る債務の履行を確保する目的及び当社が他の清算参加者の破綻等を認定した場合において本業務方法書等の定めるところにより当社に生じた損失の補填に充てる目的の国債店頭取引清算基金を、当社が定めるところにより、当社に預託しなければならない。

- 2 清算参加者は、当社に預託している国債店頭取引清算基金の額（当社が他の清算参加者の破綻等を認定した場合において本業務方法書等の定めるところにより国債店頭取引清算基金の全部又は一部が当社に生じた損失の補填を目的として取り崩された場合には、

その取り崩された額を減じた額。以下同じ。)が国債店頭取引清算基金所要額に満たない場合は、その不足額以上の額の金銭を、当社が定めるところにより、当社に追加預託しなければならない。

(国債店頭取引清算基金の所要額)

第70条の6 国債店頭取引清算基金所要額に関する事項は、当社が規則で定める。

(国債店頭取引清算基金の返還)

第70条の7 清算参加者は、当社に預託している国債店頭取引清算基金のうち、国債店頭取引清算基金所要額を超える額を限度として、当社に返還を請求することができる。

第3節 代用国債証券

(代用国債証券)

第70条の8 当初証拠金(当社が定める額を超える額に限る。)及び国債店頭取引清算基金は、当社が定めるところにより、国債証券(当社が定めるものに限る。)をもって代用預託することができる。

- 2 前項に規定する国債証券の代用価格は、当該国債証券の当社が定める時価に当社が定める率を乗じた額とする。ただし、当社は、相場に著しい変動を生じた場合等特に必要があると認めた場合には、代用価格を臨時に変更することができる。
- 3 預託を受けた当初証拠金及び国債店頭取引清算基金の代用国債証券について、当社はこれを消費することができる。
- 4 預託を受けた当初証拠金又は国債店頭取引清算基金の代用国債証券について、利払期日(当社が定める国債証券に係る利払期日を除く。)が到来した場合には、当社は、当該代用国債証券に係る利金相当額について、当該利払期日に、当該代用国債証券を預託した清算参加者に対し支払うものとし、償還期日(当社が定める国債証券である場合にあっては、利払期日。以下この項において同じ。)が到来した場合には、当該代用国債証券(当社が定める国債証券を除く。)に係る利金相当額について、償還期日に、当社が当該代用国債証券を預託した清算参加者に対し支払い、当該代用国債証券に係る償還金相当額(当該国債証券が当社が定める国債証券である場合にあっては、利金相当額)について、償還期日に、当該代用国債証券を預託した清算参加者が当社に当初証拠金又は国債店頭取引清算基金として金銭で預託したものとみなす。
- 5 前4項の規定のほか、当初証拠金及び国債店頭取引清算基金の代用国債証券に関する事項については、当社が定める。

第4節 代理人を通じた当初証拠金及び国債店頭取引清算基金の授受

(代理人を通じた当初証拠金及び国債店頭取引清算基金の授受)

第70条の9 清算参加者は、当社が定めるところによりあらかじめ当社の承認を得た場合には、第70条、第70条の3から第70条の5まで、第70条の7及び第70条の8に規定する金銭又は国債証券の授受を、当社が定めるところにより、代理人を通じて行うことができる。

第5節 当初証拠金の利用

(当初証拠金の利用)

第71条 当社は、当初証拠金として預託を受けた金銭及び代用国債証券をもって、次の各号に掲げる行為を行うことができる。

- (1) 当社の清算参加者に対する参加者決済に係る支払債務その他本業務方法書に基づき当社が清算参加者に対して負担する債務の履行
- (2) 第74条の規定により資金調達を行う場合における担保の提供又は調達した資金の返済

2 前項に規定する行為を行った場合において、当社が当初証拠金として現に有している金銭の額が、当社が当初証拠金として現に預託を受けている金銭の額を下回ったとき、又は、当社が当初証拠金として現に有している代用国債証券の数量が、当社が当初証拠金として現に預託を受けている代用国債証券の数量を下回ったときは、当社は、第77条の3の規定による国債証券の換価又は担保供与によって得られる金銭、第10章第5節の規定による損失の補填のための金銭その他の金銭により、当社が当初証拠金として有する金銭の額又は代用国債証券の数量を、当社が当初証拠金として預託を受けている金銭の額又は代用国債証券の数量以上に回復させるものとする。

第9章の2 清算預託金

(清算預託金)

第72条 当社が、債務の履行を確保するためのものとして清算参加者から預託を受ける当初証拠金、国債店頭取引清算基金、第三階層特別清算料担保金及び破綻時証拠金は、法第156条の11に規定する清算預託金とする。

(清算預託金の管理)

第73条 当社は、前条の清算預託金については、他の財産と分別し、かつ、清算参加者ごとに区分して帳簿により管理するものとする。

第10章 清算参加者の決済不履行時の措置

第1節 決済不履行時の資金調達

(決済不履行時の資金調達)

第74条 当社は、清算参加者が参加者決済に係る支払債務、個別銘柄取引に係る証券決済債務及び銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務の全部若しくは一部を履行しないとき又はそのおそれがあると認めるときその他債務の履行状況により当社が必要と認めるときは、次の各号に規定する方法その他当社が適当と認める資金調達の方法により得られる金銭をもって、第50条の11（第51条第3項及び第56条第2項により準用される場合を含む。次条において同じ。）又は第69条（第57条第2項、第59条第2項、第60条第2項、第62条第2項及び第63条第2項により準用される場合を含む。次条において同じ。）の規定により当社の清算参加者に対する債務を履行するものとする。

(1) 清算参加者その他の者からの資金の借入れ

(2) 清算参加者その他の者を相手方とした銘柄先決め現先取引

- 2 当社は、前項各号に規定する方法によってもなお必要な金銭の全部又は一部の調達が困難であると認める場合には、資金調達の起因となった債務の当事者である清算参加者以外の清算参加者から銘柄先決め現先取引により当社が必要と認める額の金銭を調達することができる。この場合において、当社は、資金調達の起因となった債務の当事者である清算参加者以外の清算参加者に対し、当社が定めるところにより、当社が調達すべき額を割り当てるものとし、割当てを受けた清算参加者は、自己に対する割当額について当社との銘柄先決め現先取引の相手方とならなければならない。
- 3 当社は、第1項各号及び前項に規定する方法によってもなお必要な金銭の全部又は一部の調達が困難であると認める場合には、第15条の規定により金銭により預託を受けた当初証拠金により、当社が必要と認める額の金銭を調達することができる。

(資金調達を行った場合における当社の債務の履行等)

第75条 前条第1項の場合において、第50条の11又は第69条に規定する当社の債務の履行は、その日の当社がその都度定める時限までに行うものとする。

- 2 当社は、前条に規定する資金調達を行った場合であっても、前項に規定する時限まで

に清算参加者に対する債務を履行するために必要な金銭の全部又は一部の調達が困難であると認めるときは、前項の規定にかかわらず、別途当社が債務を履行する日時を定めることができる。この場合において、当社が必要と認めるときは、当社が当該債務を履行するまでの間、当社は、国債証券の渡方清算参加者からの国債証券の受領を停止することができる。

3 前2項の場合において、当社は、速やかにその旨を清算参加者に通知するものとする。

(調達資金の返済等)

第76条 第74条第1項又は第2項の規定により当社が資金調達を行った場合には、当該資金調達の起因となった債務の当事者である清算参加者は、当該債務の履行状況に応じて、当社が当該資金調達に要した費用相当額を当社に支払わなければならない。

2 当社は、第74条第1項又は第2項の規定により資金調達を行ったときは、次の各号に掲げる場合の区分に応じ当該各号に定める行為を行うものとする。

(1) 当該資金調達の起因となった債務の当事者である清算参加者から債務の履行が行われた場合

当該債務の履行により得られた金銭の全部又は一部による第74条第1項及び第2項の規定により調達した資金の返済

(2) 当該資金調達の起因となった債務の当事者である清算参加者が第79条又は第80条の適用を受けた場合

第77条の3の規定による国債証券の処分代金又は第5節の規定による損失の補填のための金銭の全部又は一部による第74条第1項及び第2項の規定により調達した資金の返済

3 当社は、第74条第3項の規定により資金調達を行ったときは、次の各号に掲げる場合の区分に応じ当該各号に定める行為を行うものとする。

(1) 当該資金調達の起因となった債務の当事者である清算参加者から債務の履行が行われた場合

当該債務の履行により得られた金銭の全部又は一部による当社が当初証拠金として有する金銭の額の当社が当初証拠金として預託を受けている金銭の額以上への回復

(2) 当該資金調達の起因となった債務の当事者である清算参加者が第79条又は第80条の適用を受けた場合

第71条第2項に定める行為

第2節 決済不履行の場合における措置

(決済不履行の場合における措置)

第77条 当社は、清算参加者が参加者決済に係る支払債務その他本業務方法書に基づく当社に対する債務を履行しないとき又はそのおそれがあると認めるときは、当社が必要と認める範囲において当社が必要と認める期間、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づく債務の引受けの停止並びに当社から受けるべき国債証券及び金銭の全部又は一部の引取りの停止の措置を行うことができる。

2 当社は、前項の規定により引取りを停止した金銭については、当該清算参加者の当社に対する債務の弁済に充当することができる。

(債務引受けの停止の措置等の通知)

第77条の2 当社は、前条第1項の措置を行った場合は、直ちにその旨（当社が清算参加者の破綻等を認定した場合には、その旨及び破綻認定日）をすべての清算参加者に通知する。

(確保資産の処分)

第77条の3 当社は、清算参加者の破綻等を認定した場合は、破綻処理入札のほか、当該清算参加者の当初証拠金代用預託残高、国債店頭取引清算基金代用預託残高、破綻時証拠金代用預託残高、当該清算参加者に対する個別銘柄取引に係る証券決済債務、銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務、バイ・インに係る国債証券引渡債務又は第80条の3第3項に規定する入札対象取引に係る国債証券引渡債務に係る国債証券と同種、同量の国債証券について、売却その他当社が適当と認める方法による換価又は担保供与を行うことができる。

2 当社は、前項の規定による換価又は担保供与により得られる金銭をもって、次の各号に掲げる行為を行うものとする。

- (1) 参加者決済に係る支払債務その他当社が清算参加者に対して負担する債務の履行
- (2) 第71条第2項に規定する当初証拠金に係る残高の回復
- (3) 第74条第1項及び第2項の規定により調達した資金の返済

第3節 差引計算等による債務の履行

(期限の利益の喪失)

第78条 清算参加者について、次の各号のいずれかに該当した場合には、当社からの通知又は催告等がなくても、当該清算参加者は当社に対する本業務方法書に基づく一切の

債務について当然に期限の利益を喪失し、直ちに債務を弁済するものとする。

- (1) 破産手続開始、再生手続開始、更生手続開始、清算開始又は特別清算開始の申立てがあったとき。
 - (2) 解散の決議を行いその他解散の効力が生じたとき（合併及び破産手続開始の決定による場合を除く。）。
 - (3) 手形交換所又は電子記録債権法（平成19年法律第102号）第2条第2項に規定する電子債権記録機関の取引停止処分を受けたとき。
 - (4) 前3号のほか、当該清算参加者が債務整理に関して裁判所の関与する手続を申し立てたとき又は支払不能若しくは廃業の表明その他債権者に対する支払いを一般的に停止したと認められる事実が発生したとき。
 - (5) 本業務方法書に基づく当社の清算参加者に対する債務に対して仮差押え、保全差押え又は差押えの命令が発送されたとき若しくはこれらの債務につき譲渡若しくは質権設定の通知が発送されたとき。
 - (6) 外国の法令に基づく前各号のいずれかに相当又は類する事由に該当したとき。
 - (7) 当社と清算参加者との間の参加者決済に係る支払債務の全部又は一部を履行しないとき。
- 2 清算参加者が、次の各号のいずれかに該当した場合には、当社が当該清算参加者に対して通知することによって、当該清算参加者は当社に対する本業務方法書に基づく一切の債務について当然に期限の利益を喪失し、直ちに、債務を弁済するものとする。
- (1) 書面により、本業務方法書に基づく当社に対する債務の存在を一部でも否認し、又はこれを支払う能力若しくは意思がないことを認めたとき。
 - (2) 当該清算参加者が本業務方法書に違反し、それが当社の債権保全を必要とする相当の事由に該当すると当社が認めたとき。
- 3 前項の場合において、当該清算参加者が所在地の変更の届出を怠る又は当社からの通知を受領しない等、清算参加者の責めに帰すべき事由により、通知が延着し又は到達しなかった場合には、通常到達すべきときに期限の利益が失われたものとする。

（破綻清算参加者のポジションの一括清算）

第79条 清算参加者について、一括清算事由があった場合には、当該清算参加者と当社との間に存在するすべての金銭支払返還債務及び国債証券引渡返還債務の一括清算事由発生時における債務不履行評価額を合算して得られる純合計額が、当該清算参加者に対する当社の一の債務又は当社に対する当該清算参加者の一の債務となるものとする。

- 2 前項に規定する債務不履行評価額は次の各号に規定するところによる。
 - (1) 金銭支払返還債務については、当該債務の額とする。

- (2) 国債証券引渡返還債務については、次の a から c までに掲げる債務ごとに、当該 a から c までに定める額とする。
- a 当社が負担する国債証券引渡返還債務（スタート／R e w i n d 国債引渡債務（バスケット））及びエンド／U n w i n d 国債引渡債務（バスケット）を除く。）
 次の（a）及び（b）に規定する額の合計額
- (a) 一括清算事由が発生した日から起算して3日目の日までに、当社が当該国債証券引渡返還債務に関して引き渡すべき又は返還すべき同種、同量の国債証券を売却した場合には、その売却代金総額から当該売却に要した費用を控除した額。
- (b) 一括清算事由が発生した日から起算して3日目の日までに、当社が当該国債証券引渡返還債務に関して引き渡すべき又は返還すべき同種、同量の国債証券を売却しなかった場合には、当社が定める時価総額
- b 清算参加者が負担する国債証券引渡返還債務（スタート／R e w i n d 国債引渡債務（バスケット））及びエンド／U n w i n d 国債引渡債務（バスケット）を除く。）
 次の（a）及び（b）に規定する額の合計額
- (a) 一括清算事由が発生した日から起算して3日目の日までに、清算参加者の当該国債証券引渡返還債務に関して引き渡すべき同種、同量の国債証券を当社が購入した場合には、その購入代金総額に当該購入に要した費用を加算した額。
- (b) 一括清算事由が発生した日から起算して3日目の日までに、清算参加者の当該国債証券引渡返還債務に関して引き渡すべき同種、同量の国債証券を当社が購入しなかった場合には、当社が定める時価総額
- c スタート／R e w i n d 国債引渡債務（バスケット）及びエンド／U n w i n d 国債引渡債務（バスケット）
 破綻処理入札の結果に基づき、当社が定める金額
- 3 第1項の規定に基づく一の債務の額について、当社は、債務不履行評価額の確定後、速やかに計算し、当該清算参加者に対して通知するものとする。この場合において、当社は、当該一の債務について履行すべき日時を指定するものとする。
- 4 当該清算参加者と当社との間の金銭支払返還債務及び国債証券引渡返還債務は、第1項の規定により一の債務となるときに、履行され消滅したものとする。この場合、国債証券引渡返還債務について、当社及び清算参加者は、国債証券引渡返還債務の一括清算事由発生時における債務不履行評価額（第2項第2号の規定により算定される金額をいう。）を支払うことによっても履行することができ、かつ、かかる履行を選択したとみなされるものとする。
- 5 第2項第2号 a（b）に規定する場合において、当該（b）の3日目の日以降に当社が当該国債証券引渡返還債務に関して引き渡すべき又は返還すべき同種、同量の国債証券

を売却した場合において、その売却代金総額から当該売却に要した費用を控除した額が当該（b）の時価総額に不足するときは、第1項の清算参加者は、その差額の支払いを負担するものとする。

6 第2項第2号b（b）に規定する場合において、当該（b）の3日目の日以降に清算参加者の当該国債証券引渡返還債務に関して引き渡すべき同種、同量の国債証券を当社が購入した場合において、その購入代金総額に当該購入に要した費用を加算した額が当該（b）の時価総額を越えるときは、第1項の清算参加者は、その差額の支払いを負担するものとする。

7 第2項、第5項及び第6項の規定にかかわらず、次の各号に掲げる場合における国債証券引渡返還債務に係る評価額は、当社が規則で定めるところによる。

- (1) 第80条の4に規定する合意が成立した場合
- (2) 第80条の5に規定する未決済ポジションの一括清算が行われた場合

8 第1項の規定にかかわらず、当社が国債店頭取引他社清算参加者について破綻等を認定した場合において、第81条第1項に規定する移管の申込みが行われたときは、当該移管の成立又は不成立が確定するまでの間は、第1項に規定する純合計額の算定及び一の債務の成立を行わないものとする。

(差引計算)

第80条 清算参加者の参加者決済に係る支払債務及びその他の本業務方法書に基づく清算参加者の当社に対する債務が履行期限にある場合には、当社は当該債務と本業務方法書に基づく当社の当該清算参加者に対する債務とを、その債務の履行期限のいかんにかかわらず、相殺することができる。

2 前項の場合において、債務の充当の順序については、次の各号に規定するところによるものとする。ただし、当社が当社の債権保全の観点から必要と認める場合はこの限りでない。

- (1) 本業務方法書に基づく清算参加者の当社に対する債務は、次に掲げる順序に従い充当するものとする。
 - a 清算参加者の参加者決済に係る支払債務
 - b 前aに掲げるもの以外の本業務方法書に基づく清算参加者の当社に対する債務
- (2) 本業務方法書に基づく当社の当該清算参加者に対する債務は、次に掲げる順序に従い充当するものとする。
 - a 当社の金銭支払返還債務
 - b 当初証拠金代用預託残高に係る返還債務
 - c 国債店頭取引清算基金代用預託残高に係る返還債務

- d 破綻時証拠金代用預託残高に係る返還債務
 - e 個別銘柄取引に係る証券決済債務、銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務、スタート/Rewind国債引渡債務（バスケット）及びエンド/Uncwind国債引渡債務（バスケット）
 - f 第74条第1項第2号及び第2項に規定する清算参加者を相手方とした銘柄先決め現先取引に関し当社が負担する国債証券引渡債務
 - g 第80条の7第2項の規定により当社が負担する入札対象取引に係る国債証券引渡債務
- 3 第1項の相殺における当社が負担する国債証券引渡返還債務について、当社は、当該返還債務及び当該引渡債務の評価額総額（当社が当該返還する又は引き渡す国債証券と同種、同量の国債証券を売却した場合の、その売却代金（スタート/Rewind国債引渡債務（バスケット）及びエンド/Uncwind国債引渡債務（バスケット）にあつては破綻処理入札の結果に基づき、当社が定める金額）の総額から当該売却に要した費用を差し引いた額の合計額をいう。）を支払うことによつても履行することができ、かつ、かかる履行を選択して、相殺するものとする。
 - 4 第1項の相殺における清算参加者が負担する国債証券引渡返還債務について、当社は、当該引渡債務の評価額総額（当社が当該引渡国債証券と同種、同量の国債証券を購入した場合の、その購入代金（スタート/Rewind国債引渡債務（バスケット）及びエンド/Uncwind国債引渡債務（バスケット）にあつては破綻処理入札の結果に基づき、当社が定める金額）の総額に当該購入に要した費用を加算した額の合計額をいう。）を清算参加者に支払わせることによつても履行させることができ、かつ、かかる履行を選択して、相殺するものとする。
 - 5 前2項の適用に際し、次の各号に掲げる場合における証券決済債務及び第80条の7第2項の規定により当社が負担する入札対象取引に係る国債証券引渡債務に係る評価額は、当社が規則で定めるところによる。
 - (1) 第80条の4に規定する合意が成立した場合
 - (2) 第80条の5に規定する未決済ポジションの一括清算が行われた場合
 - 6 第1項の相殺に係る差引計算を行う場合における遅延損害金その他支払うべき金銭の計算については、その期間を当社による計算実行の日までとする。
 - 7 第1項の規定による相殺の意思表示は、書面による通知により行うものとする。
 - 8 当社は、第1項の相殺における債権又は債務の充当の順序及び方法については、前項の通知において指定することができるものとし、当該清算参加者は、これに対し異議を述べることはできないものとする。
 - 9 清算参加者が当社に預託した他の清算業務に係る余剰担保（当該清算参加者が他の清

算業務について当社に預託した証拠金、清算基金その他の担保（当該清算参加者が返還請求権を有するものに限る。）のうち、他の清算業務に係る業務方法書の定めるところにより当該清算参加者の債務の弁済に充当した残額に係るものをいう。）がある場合には、当社の当該清算参加者に対する当該余剰担保に係る返還債務と第1項の当該清算参加者の当社に対する債務とを、その債務の履行期限のいかんにかかわらず、相殺することができる。この場合において、第2項から前項までの規定を準用する。

10 当社は、前条の規定により清算参加者に対して有することになった一の残額債務又は債権と、当該清算参加者に対する支払債権又は債務（前項に規定する当社の当該清算参加者に対する余剰担保に係る返還債務及び本業務方法書に基づかない支払債権又は債務を含む。）とを、その期限のいかんにかかわらず、いつでも相殺することができる。この場合において、第2項から第8項までの規定を準用する。

11 前各項に規定する相殺について必要な事項は、当社がその都度定める。

第4節 破綻清算参加者の未決済約定の処理

（国債店頭取引破綻管理委員会）

第80条の2 当社は、清算参加者の破綻等を認定した場合における破綻処理入札の実施その他の当社が規則で定める事項（次項において「諮問事項」という。）に関し助言を受けることを目的として、国債店頭取引破綻管理委員会を設置する。

2 当社は、諮問事項について国債店頭取引破綻管理委員会に諮問し、その助言を尊重するものとする。

3 当社は、当社が規則で定めるところにより指定した清算参加者を、国債店頭取引破綻管理委員会の委員に任命するものとする。この場合において、当社は、国債店頭取引破綻管理委員会の委員に対し、守秘義務を負わせるものとする。

4 前3項に規定するほか、国債店頭取引破綻管理委員会の権限、組織、委員の任期、運営方法その他の必要な事項は、当社が規則で定める。

（破綻処理入札の実施）

第80条の3 当社は、清算参加者の破綻等を認定した場合には、当該破綻清算参加者を当事者とする破綻処理対象ポジションの処理を目的とする破綻処理入札を実施することができる。

2 破綻処理入札は、次の各号に掲げる破綻処理入札に区分し、当該各号に掲げる破綻処理入札の対象とする破綻処理対象ポジション及び入札対象者は当該各号に定めるところによる。

(1) バスケット破綻処理入札

スタート／R e w i n d 国債引渡債務（バスケット）（当社が規則で定めるものを除く。）及びエンド／U n w i n d 国債引渡債務（バスケット）（当社が規則で定めるものを除く。）を破綻処理対象ポジションとし、全生存清算参加者を入札対象者とする。

(2) 第一段階破綻処理入札

個別銘柄取引に係る証券決済債務及び銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務を破綻処理対象ポジションとし、当社が規則で定める清算参加者を入札対象者とする。

(3) 第二段階破綻処理入札

個別銘柄取引に係る証券決済債務及び銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務を破綻処理対象ポジションとし、全生存清算参加者を入札対象者とする。

- 3 当社は、破綻処理入札の実施に先立ち、当社が規則で定めるところにより、入札対象取引（破綻処理入札により成立させるべき銘柄後決め現先取引並びに国債証券の売買及び銘柄先決め現先取引をいう。以下同じ。）の内容その他の破綻処理入札の実施条件を定め、清算参加者に通知する。
- 4 前3項に規定するほか、破綻処理入札の手順、運営方法その他必要な事項は当社が規則で定める。

（損失を補填することができないおそれがある場合の協議）

第80条の4 破綻処理入札が実施された場合において、入札対象取引を成立させた場合に破綻清算参加者の破綻等により生じる損失（第79条又は第80条の規定による当社の破綻清算参加者に対する債権に対応する当社の損失をいう。）を、第83条から第83条の7までの規定に定めるところにより補填することができないおそれがあるときは、当社及び清算参加者は、当該損失の処理に関し、規則で定めるところにより対応を協議する。

- 2 前項の規定による協議の結果、同項の損失の処理について当社とすべての生存清算参加者の間において規則で定めるところにより合意が成立した場合には、当社は、当該合意の定めるところにより当該損失の処理を行う。この場合において、当該処理の内容は、当該損失の全部が補填され、かつ、当社による国債店頭取引清算業務の継続が可能なものであることを要する。

（協議が不調となった場合における未決済ポジションの一括清算）

第80条の5 前条第1項の規定により協議が行われた場合において、当社が規則で定める期間内に同条第2項の合意が成立しないときは、当該期間が経過する日において生存清算参加者と当社との間に存在するすべての未決済資金ポジション及び未決済証券ポジ

ションのその時点における当社が規則で定めるところにより算出する評価額を合算して得られる純合計額が、当該生存清算参加者に対する当社の一の債務又は当社に対する当該生存清算参加者の一の債務となる（以下「未決済ポジションの一括清算」という。）ものとする。

- 2 前項の規定により未決済ポジションの一括清算が行われた場合、その時点で履行期が到来していない個別銘柄取引に係る利金相当額決済債務及び銘柄後決め現先取引等に係る利金相当額決済債務は、当該一括清算が行われた時点で消滅するものとする。
- 3 第1項により未決済ポジションの一括清算が行われた場合において、第56条第1項に規定するバイ・インに係る売買代金の支払債務及び第55条の規定により清算参加者が負担するバイ・インに係る国債証券引渡債務が当該一括清算の対象となるときは、当該バイ・インの対象であるフェイルに係る個別銘柄取引に係る証券決済債務時価評価額又は銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務時価評価額に係る支払債務及び個別銘柄取引に係る証券決済債務又は銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務は、第1項の規定にかかわらず当該一括清算の対象外とし、当該一括清算が行われた時点で消滅するものとする。
- 4 前3項の規定による未決済ポジションの一括清算に関し必要な事項は、当社が規則で定める。

（協議に関する通知等）

第80条の6 当社は、第80条の4第2項の合意が成立し、又は前条第1項の規定によりすべての未決済ポジションの一括清算が行われた場合には、直ちにその旨をすべての清算参加者に通知する。

（入札対象取引の成立等）

第80条の7 清算参加者が破綻処理入札において入札対象取引を落札した場合には、当社が規則で定めるところにより、当社及び当該清算参加者の間において、当該落札に係る入札対象取引が成立するものとする。

- 2 第一段階破綻処理入札及び第二段階破綻処理入札に関し、前項の規定による入札対象取引が成立した場合には、当社及び前項の清算参加者は、当該入札対象取引の決済のための国債証券及び金銭の授受を行う。
- 3 バスケット破綻処理入札に関し、第1項の規定による入札対象取引が成立した場合における第50条の2の規定の適用については、同条第1項中「第44条第1項第4号の規定により当社及び当該清算参加者が負担する国債引渡債務（バスケット）」とあるのは「第44条第1項第4号の規定により当社及び当該清算参加者が負担する国債引渡債務（バスケット）並びに第80条の7第1項の規定による入札対象取引の成立により当社

及び当該清算参加者が負担する国債引渡債務（バスケット）」と、「当社又は当該清算参加者が債務を負担する都度」とあるのは「当該入札対象取引が成立した日の翌日の第44条第2項第2号に定める時刻に」と、同条第2項中「第44条第1項第4号の規定により当社及び当該清算参加者が負担する金銭の支払債務（現先取引等に係る利金相当額支払債務を除く。）」とあるのは「第44条第1項第4号の規定により当社及び当該清算参加者が負担する金銭の支払債務（現先取引等に係る利金相当額支払債務を除く。）並びに第80条の7第1項の規定による入札対象取引の成立により当社及び当該清算参加者が負担する金銭の支払債務（現先取引等に係る利金相当額支払債務を除く。）」と、「当社又は当該清算参加者が債務を負担する都度」とあるのは「当該入札対象取引が成立した日の翌日の第44条第2項第2号に定める時刻に」とする。

- 4 前3項に規定するほか、第1項の規定により成立した入札対象取引については、これを清算対象取引とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。
- 5 前各項に規定するほか、入札対象取引が成立した場合の手続については、当社が規則で定める。

（国債店頭取引他社清算参加者破綻時における顧客ポジションの移管の申込み）

第81条 当社が国債店頭取引他社清算参加者について破綻等を認定した場合において、当該国債店頭取引他社清算参加者に有価証券等清算取次ぎを委託している顧客は、当社が定めるところにより、当該顧客に係る顧客ポジションを他の国債店頭取引他社清算参加者（当社が本業務方法書で定める国債店頭取引他社清算参加者のうち、第78条に規定する期限の利益の喪失の事由が発生していない者に限る。以下本条及び次条において同じ。）に移管することができる。

- 2 前項に規定する移管は、ネットィング口座ごとに行うものとする。
- 3 顧客は、第1項に規定する移管を行う場合には、当社が定めるところにより、移管先として指定することができるネットィング口座を、国債店頭取引他社清算参加者を通じて、あらかじめ当社に届け出なければならない。
- 4 顧客は、第1項に規定する移管を行う場合には、移管先清算参加者に対して当該移管の申込みをし、承諾を得るものとする。
- 5 前項に規定する承諾を得た場合には、顧客は、当該破綻認定日の正午までに、移管先清算参加者を通じて、当社が定めるところにより、当社に対して移管の申込みを行うものとする。

（国債店頭取引他社清算参加者破綻時における顧客ポジションの移管の成立）

第81条の2 当社は、前条第5項に規定する移管の申込みを受領し、当該申込みの内容その他当社が定める事項が適当と認めた場合には、当該破綻認定日の午後2時までに、

当該申込みを承諾するものとする。

- 2 当社が前項に規定する承諾を行った場合には、当該破綻認定日の午後5時以降の当社が定める時点において、当該顧客ポジションについて、移管先清算参加者への移管を行うものとし、その時点をもって当該移管が成立するものとする。
- 3 前項の規定により顧客ポジションの移管が成立した場合には、当該顧客ポジションに係る次の各号に掲げる金銭及び代用国債証券のうち、移管元清算参加者を代理人として当社に預託されていたものについては、移管先清算参加者を代理人として当社に預託されたものとみなす。
 - (1) 当初証拠金
 - (2) 国債店頭取引清算基金
 - (3) 変動証拠金
 - (4) 破綻時証拠金
 - (5) 特別清算料担保金
- 4 第2項の規定により顧客ポジションの移管が成立した場合には、当該移管に係る移管元口座は、当該移管が成立した日に廃止されるものとする。
- 5 第2項の規定により顧客ポジションの移管が成立した場合には、当該移管に係る移管先口座は、当該移管が成立した日に開設されるものとする。
- 6 移管が成立した顧客ポジションについて、破綻認定から移管成立までの間に第74条の規定により当社が資金調達を行った場合には、当社が当該資金調達に要した費用相当額は、第79条第1項の算定の対象外として、移管先清算参加者が当社に支払うものとする。

第5節 他の清算参加者による損失の負担

(損失負担方式の区分)

第82条 破綻処理損失の生存清算参加者による補填は、次の各号に定める方式に区分して行う。

(1) 原取引按分方式

原取引按分清算参加者が、原取引按分方式損失総額について、破綻処理損失の起因となった破綻清算参加者を当事者とする清算対象取引（当該清算対象取引に係る決済が未了のものに限る。）に占める当該原取引按分清算参加者の有する信託口を一方当事者とする取引の割合に応じて按分した額を負担する方式。

(2) 清算基金按分方式

清算基金按分清算参加者が、清算基金按分方式損失総額について、各清算基金按分

清算参加者の国債店頭取引清算基金所要額（清算参加者が信託口を有する場合は信託口に係る額を除く。）に応じて按分した額を負担する方式。

- 2 前項の破綻処理損失は、当社が規則で定める日（以下「当初損失確定日」という。）に算出することとし、その算出に際して額の確定していない債権債務又は担保があるときは、当社は、債権債務又は担保の額と見込まれる額として当社が暫定的に定める額を当該債権債務又は担保の額とみなして算出を行う。

（第一階層国債店頭取引決済保証準備金による損失の補填）

- 第83条 当社は、破綻処理損失（第90条の5の規定による破綻処理損失の補填が先に行われた場合においては、当該補填により補填された損失を除く。以下第83条の7までにおいて同じ。）を、第一階層国債店頭取引決済保証準備金の取崩しにより補填する。
- 2 前項の規定による第一階層国債店頭取引決済保証準備金の取崩しは、原取引按分方式及び清算基金按分方式ごとに、原取引按分方式損失総額及び清算基金按分方式損失総額の割合に応じて按分して行う。

（国債店頭取引清算基金及び第二階層国債店頭取引決済保証準備金による損失の補填）

- 第83条の2 破綻処理損失について、前条に定めるところによってもなお補填することができない損失がある場合には、当社は、当該損失を、各生存清算参加者が当社に預託した国債店頭取引清算基金及び第二階層国債店頭取引決済保証準備金の取崩しにより補填する。この場合における各生存清算参加者が当社に預託した国債店頭取引清算基金及び第二階層国債店頭取引決済保証準備金から取崩しをする額は、次に定めるとおりとする。

- (1) 第二階層国債店頭取引決済保証準備金の取崩しは、第二階層国債店頭取引決済保証準備金の額に、本条及び第83条の5の規定により清算参加者が当社に預託した国債店頭取引清算基金の取崩しをする額の合計額の第二階層清算参加者負担限度額（原取引按分）及び第二階層清算参加者負担限度額（清算基金按分）の合計額に対する割合を乗じた額を、本条の規定により取崩しをすべき額（以下「第二階層国債店頭取引決済保証準備金一次取崩額」という。）及び第83条の5の規定により取崩しをすべき額（以下「第二階層国債店頭取引決済保証準備金二次取崩額」という。）に按分した場合の第二階層国債店頭取引決済保証準備金一次取崩額とする。この場合において、第二階層国債店頭取引決済保証準備金一次取崩額は、原取引按分方式において取崩しをすべき額と清算基金按分方式において取崩しをすべき額に按分するものとする。
- (2) 第二階層清算参加者負担総額（原取引按分）は、原取引按分方式損失総額から前条の規定による第一階層国債店頭取引決済保証準備金の取崩額のうち原取引按分方

式分として按分された額及び前号に規定する原取引按分方式において取崩しをすべき第二階層国債店頭取引決済保証準備金一次取崩額を控除した額とする。

(3) 原取引按分方式における各原取引按分清算参加者が当社に預託した国債店頭取引清算基金から取崩しをする額は、第二階層清算参加者負担総額（原取引按分）に当社が規則で定める方法により算出した各原取引按分清算参加者の負担割合を乗じた額（当該清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額（原取引按分）を上限とする。ただし、同一の破綻処理単位期間において認定された他の破綻等について生じた当社の損失を補填するために、本条及び第83条の5の規定により当該清算参加者が当社に預託した国債店頭取引清算基金から取り崩された額があるときは、当該額を、第90条の5の規定により当該清算参加者が当社に預託した国債店頭取引清算基金から取り崩された額があるときは、当該額のうち当該清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額（原取引按分）に含まれている額を、それぞれ当該清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額（原取引按分）から控除した残額を上限とする。）とする。

(4) 第二階層清算参加者負担総額（清算基金按分）は、清算基金按分方式損失総額から前条の規定による第一階層国債店頭取引決済保証準備金の取崩額のうち清算基金按分方式分として按分された額及び第1号に規定する清算基金按分方式において取崩しをすべき第二階層国債店頭取引決済保証準備金一次取崩額を控除した額とする。

(5) 清算基金按分方式における各清算基金按分清算参加者が当社に預託した国債店頭取引清算基金から取崩しをする額は、次のaからcまでに掲げる国債店頭取引清算基金の順序に従い、当該aからcまでに定める額とする。

a 当該破綻清算参加者に係る第一段階破綻処理入札又は当該破綻清算参加者に係る破綻認定日の属する破綻処理単位期間中に実施された他の第一段階破綻処理入札（当該破綻清算参加者に係る破綻処理入札までに実施されたものに限る。）のいずれかにおいて参加申請後に応札しなかった清算基金按分清算参加者（これらの第一段階破綻処理入札のいずれかにおいて入札対象取引を落札し、かつその後に実施されたすべての第一段階破綻処理入札に参加している清算参加者を除く。以下このaにおいて「対象清算参加者」という。）が当社に預託した国債店頭取引清算基金 第二階層清算参加者負担総額（清算基金按分）を各対象清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額（清算基金按分）に応じて按分した額（第二階層清算参加者負担総額（清算基金按分）が対象清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額（清算基金按分）の総額以上である場合には、各対象清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額（清算基金按分）（同一の破綻処理単位期間において認定された他の破綻等について生じた当社の損失を補填するために、本条の規定により当該清算参加者が当社に預託した国債店頭取引清算基金から取り崩された額があるときは、当該額を、第9

- 0条の5の規定により当該清算参加者が当社に預託した国債店頭取引清算基金から取り崩された額があるときは、当該額のうち当該清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額（清算基金按分）に含まれている額を、それぞれ控除した残額）
- b 当該各清算基金按分清算参加者（前aに掲げる清算参加者を除く。）が当社に預託した国債店頭取引清算基金（当社が規則で定める額を控除した部分） 第二階層清算参加者負担総額（清算基金按分）から前aに定める取崩し額の総額を控除した残額を当該各清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額（清算基金按分）（当社が規則で定める額を控除する。以下このbにおいて同じ。）に応じて按分した額（当該残額が当該各清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額（清算基金按分）の総額以上である場合には、当該各清算基金按分清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額（清算基金按分）（同一の破綻処理単位期間において認定された他の破綻等について生じた当社の損失を補填するために、本条の規定により当該清算参加者が当社に預託した国債店頭取引清算基金から取り崩された額があるときは、当該額を、第90条の5の規定により当該清算参加者が当社に預託した国債店頭取引清算基金から取り崩された額があるときは、当該額のうち当該清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額（清算基金按分）に含まれている額を、それぞれ控除した残額）
- c 当該破綻清算参加者に係る第一段階破綻処理入札において入札対象取引を落札した清算基金按分清算参加者（aに掲げる清算参加者及び当該破綻清算参加者に係る破綻認定日の属する破綻処理単位期間中に認定された破綻等であって、当該破綻清算参加者に係る第一段階破綻処理入札までに第一段階破綻処理入札が実施されたもののうち、直近に第一段階破綻処理入札が実施されたものにおいて、aの適用を受けていた清算参加者及び国債店頭取引清算基金の取崩しを受けていたとすればaの適用を受けていた清算参加者を除く。）が当社に預託した国債店頭取引清算基金（当社が規則で定める額に相当する部分） 第二階層清算参加者負担総額（清算基金按分）からa及び前bに定める取崩し額の総額を控除した残額を当社が規則で定める額で按分した額（当該残額が当該各清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額（清算基金按分）（当社が規則で定める額に相当する部分に限る。以下このcにおいて同じ。）の総額以上である場合には、当該各清算基金按分清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額（清算基金按分）（同一の破綻処理単位期間において認定された他の破綻等について生じた当社の損失を補填するために、本条の規定により当該清算参加者が当社に預託した国債店頭取引清算基金から取り崩された額があるときは、当該額を、第90条の5の規定により当該清算参加者が当社に預託した国債店頭取引清算基金から取り崩された額があるときは、当該額のうち当該清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額（清算基金按分）に含まれている額を、それぞれ控除した残額）

- 2 各生存清算参加者は、前項の規定により自己が当社に預託した国債店頭取引清算基金から取り崩されるべき金額を当社に支払う義務を負うものとし、前項の規定による国債店頭取引清算基金の取崩しは、当初損失確定日において、当社及び各生存清算参加者から別段の意思表示を要することなく、当然に、当該義務に対応する当社の債権と、当該義務を負う清算参加者が当社に対して有する国債店頭取引清算基金の返還請求権とを対当額で相殺する方法により行う。

(破綻処理単位期間における国債店頭取引清算基金に関する特則)

第83条の3 破綻処理単位期間における各清算参加者の国債店頭取引清算基金所要額は、第70条の6の規定による規則の定めにかかわらず、当該破綻処理単位期間の開始日の前日における当該各清算参加者の国債店頭取引清算基金所要額とする。

- 2 破綻処理単位期間において前条第1項の規定により国債店頭取引清算基金の全部又は一部が取り崩された場合には、第70条の5の規定にかかわらず、当該破綻処理単位期間が終了するまでの間、清算参加者は、当該取崩しに対応する額の国債店頭取引清算基金の追加預託義務を負わない。

- 3 第1項の規定にかかわらず、破綻処理単位期間の終了日における各清算参加者の国債店頭取引清算基金所要額は、当該破綻処理単位期間の終了日において算出した当該各清算参加者の国債店頭取引清算基金所要額とし、第70条の5の規定による規則の定めにより新たに国債店頭取引清算基金所要額を算出する日の前日まで適用する。この場合において、破綻処理単位期間の終了日において各清算参加者が当社に預託している国債店頭取引清算基金及び破綻時証拠金の額が、第1項の規定により算出した破綻処理単位期間の終了日における国債店頭取引清算基金所要額に満たない場合には、当該各清算参加者は、不足額以上の国債店頭取引清算基金を、当社が定めるところにより、当社に追加預託しなければならない。

(第三階層特別清算料による損失の補填)

第83条の4 破綻処理損失について、第83条の2に定めるところによってもなお補填することができない損失がある場合には、破綻認定日における生存清算参加者（以下この条において「第三階層特別清算料負担参加者」という。）は、当社が規則で定めるところにより、当社が規則で定める額の第三階層特別清算料を当社に支払う義務を負う。この場合において、当社は、第三階層特別清算料負担参加者から支払いを受けた第三階層特別清算料をもって、当該損失を補填する。

(第二階層清算参加者負担限度額（原取引按分）の未負担額及び第二階層国債店頭取引決

済保証準備金による損失の補填)

第83条の5 破綻処理損失について、前条に定めるところによってもなお補填することができない損失がある場合には、当社は、その残損失額を、原取引按分清算参加者が当社に預託した国債店頭取引清算基金（当該清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額（原取引按分）の未負担額（当該清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額（原取引按分）のうち第83条の2及び第90条の5の規定による国債店頭取引清算基金の取崩しがされていない部分をいう。以下この条において同じ。）を上限とする。）及び第二階層国債店頭取引決済保証準備金の取崩しにより補填する。

2 原取引按分清算参加者が当社に預託した国債店頭取引清算基金から取崩しをする額は、次の各号に掲げる国債店頭取引清算基金の順序に従い、当該各号に定める額とする。

(1) 当該各原取引按分清算参加者が当社に預託した国債店頭取引清算基金 前項の残損失額から第二階層国債店頭取引決済保証準備金二次取崩額を控除した残額を当社が規則で定める方法により当該各清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額（原取引按分）の未負担額（当社が規則で定める額を控除する。）に応じて割り当てた額（当該清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額（原取引按分）の未負担額（当社が規則で定める額を控除する。）を上限とする。）

(2) 当該破綻清算参加者に係る第二段階破綻処理入札において入札対象取引を落札した原取引按分清算参加者が当社に預託した国債店頭取引清算基金 前項の残損失額から第二階層国債店頭取引決済保証準備金二次取崩額及び前号に定める取崩し額の総額を控除した残額を当社が規則で定める額に応じて按分した額（当該清算参加者について当社が規則で定める額を上限とする。ただし、当該額が、第二階層清算参加者負担限度額（原取引按分）から同一の破綻処理単位期間において認定された他の破綻等について生じた当社の損失を補填するために第83条の2及び本条の規定により当該清算参加者が当社に預託した国債店頭取引清算基金から取り崩された額を控除した額以上である場合は、当該控除した額を上限とする。）

(原取引按分清算参加者の第三階層特別清算料の未負担額による損失の補填)

第83条の6 破綻処理損失について、前条に定めるところによってもなお補填することができない損失がある場合には、原取引按分清算参加者のうち、第83条の4の規定により当社が定めた第三階層特別清算料の額が、当該清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額（原取引按分）の未負担額（当該清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額（原取引按分）のうち第83条の2、前条及び第90条の5の規定による国債店頭取引清算基金の取崩し及び前条の規定による第三階層特別清算料による補填がされていない部分をいう。以下この条において同じ。）を下回る清算参加者（以下第90条の6におい

て「第三階層特別清算料（追加分）負担参加者」という。）は、当社が規則で定めるところにより、当社が規則で定める額の第三階層特別清算料（追加分）を当社に支払う義務を負う。この場合において、当社は、原取引按分清算参加者から支払いを受けた第三階層特別清算料（追加分）をもって、当該損失を補填する。

（第四階層特別清算料による損失の補填）

第83条の7 破綻処理損失について、前条に定めるところによってもなお補填することができない損失がある場合には、破綻認定日における生存清算参加者のうち、破綻認定日から当初損失確定日までのすべての清算対象取引（破綻認定日後に債務の引受けが行われた清算対象取引及び当初損失確定日までに決済が完了した清算対象取引を含む。以下同じ。）に係る変動証拠金等（当社が規則で定めるものをいう。以下同じ。）の受け取るべき額の総額が支払うべき額の総額を上回る者（以下この条及び第90条の6において「第四階層特別清算料負担参加者」という。）は、当社が規則で定めるところにより、第四階層特別清算料を当社に支払う義務を負う。この場合において、当社は、第四階層特別清算料負担参加者から支払いを受けた第四階層特別清算料をもって、当該損失を補填する。

2 前項の第四階層特別清算料の額は、破綻処理対象ポジションに係る損失相当額（破綻認定日（当該破綻認定日に当社と破綻清算参加者との間で破綻処理対象ポジションに係る決済が終了している場合には、当該破綻認定日の翌日。以下本項について同じ。）から当初損失確定日までの各日において、破綻処理対象ポジションに対応する未決済ポジションについて、当社が清算参加者に支払うべき変動証拠金等の総額から当社が当該清算参加者から受け取るべき変動証拠金等の総額を控除した額が正数である場合の当該額をいう。）を、各第四階層特別清算料負担参加者に係る利益相当額（破綻認定日から当初損失確定日までの間に、各第四階層特別清算料負担参加者を当事者とするすべての清算対象取引に係る変動証拠金等の受け取るべき額から支払うべき額を控除した額が正数である場合の当該額をいう。）で按分した額を上限として当社が規則で定める額とする。

（特別清算料担保金の預託）

第83条の8 清算参加者は、次の各号に掲げる特別清算料担保金の区分に応じて、当該各号に掲げる債務（第2項において「被担保債務」という。）を担保する目的で、当社が規則で定めるところにより、特別清算料担保金を当社に預託しなければならない。

- （1） 第三階層特別清算料担保金 第三階層特別清算料の支払債務
- （2） 第四階層特別清算料担保金 第四階層特別清算料の支払債務

2 当社は、本業務方法書等の定めるところにより、特別清算料担保金を被担保債務の弁

済に充当することができる。

(破綻時証拠金の預託)

第83条の9 生存清算参加者は、当該生存清算参加者が清算対象取引に関して当社に対して負担する債務を担保する目的で、破綻時証拠金を当社に預託しなければならない。

- 2 生存清算参加者の破綻時証拠金所要額は、当社が規則で定める。
- 3 破綻処理単位期間が終了した時点において、生存清算参加者が当社に現に預託している破綻時証拠金があるときは、当該時点をもって、当該破綻時証拠金の全額が当該清算参加者に返還されたものとみなされるとともに、当該破綻時証拠金と同額の国債店頭取引清算基金が当該清算参加者から当社に預託されたものとみなされるものとする。
- 4 第70条の5第2項及び第70条の8の規定（第70条の8第1項中「当社が定める額を超える額に限る。」とあるのを除く。）は、破綻時証拠金について準用する。

(特別清算料担保金の未払い)

第83条の10 清算参加者が、第83条の8第1項の規定による特別清算料担保金の預託をしない場合には、当該清算参加者について破綻等が認定されたものとみなして、本章の規定を適用する。

(最終損失確定時の調整)

第83条の11 破綻清算参加者の当社に対する金銭支払返還債務及び国債証券引渡返還債務について、第79条又は第80条の規定により当社の破綻清算参加者に対する債権の額が確定した場合において、当該債権の額が破綻処理損失の額を上回るときは、当社は、当該債権の額が確定した日において、その超過額に対応する当社の損失を、第90条の5、第83条、第83条の2及び第83条の4から第83条の7までの順序に従い、当該各条に定める方法に準じて補填する。

- 2 前項の規定による補填に関し必要な事項は、当社が規則で定める。

(破綻清算参加者からの回収金等の分配)

第84条 当社は、破綻清算参加者の破綻処理を行った場合において、次の各号に掲げる場合に依りて、当該各号に掲げる額を、当社が規則で定めるところにより清算参加者（当社が規則で定める者に限る。）に分配する。

- (1) 第79条又は第80条の規定による当社の当該破綻清算参加者に対する債権について弁済又は配当を受けたとき 当該弁済又は配当を受けた額
- (2) 前号の債権の額が確定した場合において、破綻処理損失の額が当該債権の額を

上回るとき その超過額

- 2 当社は、前項各号に掲げる額の分配を受ける清算参加者が存在しない場合には、当社が規則で定めるところにより当該額の処理を行う。

第6節 雑則

(破綻等の認定を行った場合のフェイルの取扱い)

第84条の2 当社が国債証券の渡方清算参加者の破綻等を認定した場合には、第50条の11の当社と国債証券の受方清算参加者との間における決済のうち当社が指定するものについて、当社が定める日に行うものとする。

- 2 前項の渡方清算参加者は、前項の規定により当社が指定した決済に関して当社が当該決済の受方清算参加者に支払う次の各号に掲げる金銭の額に相当する金銭を、当該金銭の額の確定後直ちに当社に支払うものとする。

- (1) フェイルチャージ
- (2) 第53条に規定する利金相当額の金銭
- (3) 第66条に規定するフェイルに係る変動証拠金についての第67条第1項に規定する利息

(破綻処理入札により成立した入札対象取引に係るフェイルの取扱い)

第84条の3 第80条の7第2項に規定する決済について、当該決済の決済日に入札対象取引の落札者となった清算参加者から当社への国債証券の引渡しが行われなかった場合、第50条の11の当社と国債証券の受方清算参加者との間における決済のうち当社が指定するものについては、当社が定める日に行うものとする。

(支払債務の不履行の特例)

第85条 当社は、清算参加者が、あらかじめ書面により、当該清算参加者のシステム障害又は災害の発生その他やむを得ない事由に起因して当該清算参加者の参加者決済に係る支払債務を当該債務の決済時限までに履行することが困難である旨及び当該支払債務の全額の履行につき支障がない旨の届出を行い、かつ、当社が適当と認めた場合には、当該支払債務の不履行につき翌日の当社がその都度定める時限まで、破綻等の認定は行わないものとする。ただし、第78条第1項又は第2項各号(第1項第7号を除く。)のいずれかに該当すると当社が認めた場合には、この限りでない。

- 2 前項の届出が行われた場合には、当社は、前項の規定に係る適用の諾否及び適当と認めたときの前項の時限について、当該清算参加者に対して通知する。

(債券等の現先取引に関する基本契約書等との関係)

第85条の2 当社と清算参加者との間で締結された債券等の現先取引に関する基本契約書その他の契約の条項と本業務方法書等の規定が抵触する場合には、本業務方法書等の規定が優先する。

(規則への委任)

第85条の3 本章に定めるもののほか、清算参加者の破綻処理に関し必要な事項は、当社が規則で定める。

第11章 ネットティング口座

(ネットティング口座)

第86条 清算参加者は、参加者決済に係る支払債務の履行に伴う金銭の授受その他本業務方法書に基づき当社との間で行う金銭又は国債証券の授受について、すべてネットティング口座で処理するものとする。

- 2 ネットティング口座は、通常口座、レポ専用口座及び後決めレポ専用口座の3種類とし、それぞれ次の各号に定めるものとする。
 - (1) 通常口座は、すべての清算対象取引に関し、前項に規定する処理を行うことのできる口座とする。
 - (2) レポ専用口座は、現金担保付債券取引等及び現先取引等（第44条第1項第2号b、同項第3号b若しくはc又は第45条第1項第2号b若しくは同項第3号bの規定により債務の引受けが行われる取引を除く。）に関し、前項に規定する処理を行うことのできる口座とする。
 - (3) 後決めレポ専用口座は、銘柄後決め現先取引等に関し、前項に規定する処理を行うことのできる口座とする。
- 3 清算参加者は、ネットティング口座の開設に際し、当社の定めるところにより、ネットティング口座ごとにネットティング口座の種類を当社に届け出なければならない。
- 4 信託の受託者である清算参加者は、自己が受託する信託に係る取引については、信託口で処理しなければならない。

(ネットティング口座の追加の申請)

第87条 清算参加者のうち複数のネットティング口座を当社に開設している者は、参加者決済に係る支払債務の履行に伴う金銭の授受その他本業務方法書に基づき当社との間で行う金銭又は国債証券の授受について、当該ネットティング口座ごとに分割して行う。

- 2 清算参加者は、ネットィング口座を追加して当社に開設しようとするときは、あらかじめ当社が定めるところにより、前条第2項に規定するネットィング口座の種類を特定してネットィング口座の追加の申請を行わなければならない。
- 3 当社は、前項の申請を受けた場合には、当該清算参加者に対し、当該ネットィング口座の利用開始日を指定して、その利用を承認するものとする。

(ネットィング口座の廃止の申請)

- 第88条 前条第3項の規定によりネットィング口座の追加の承認を受けた清算参加者が当該ネットィング口座を廃止しようとするときは、当社が定めるところにより、あらかじめ当社にネットィング口座の廃止の申請を行わなければならない。
- 2 前条第3項の規定は、前項のネットィング口座の廃止の申請について準用する。

(信託口の特例)

- 第89条 第78条第1項の規定は、信託口を開設している清算参加者については、信託口と信託口以外のネットィング口座とを区分して適用するものとし、信託口については、同項第7号に該当した場合に限り適用するものとする。
- 2 第78条第2項の規定は、信託口を開設している清算参加者については、信託口と信託口以外のネットィング口座とを区分して適用するものとする。
 - 3 第79条の規定は、信託口には適用しない。

(複数のネットィング口座を開設している清算参加者の特例)

第90条 複数のネットィング口座を開設している清算参加者について、次の表の上欄に掲げる規定（本業務方法書において引用する場合を含む。）を適用する場合には、これらの規定の同表の中欄に掲げる字句は、それぞれ同表の下欄に掲げる字句に読み替えるものとする。

第2条第16号	金銭支払返還債務	ネットィング口座ごとの金銭支払返還債務
	当社と清算参加者との間の	当社と清算参加者との間のネットィング口座ごとの
第2条第29号	国債証券引渡返還債務	ネットィング口座ごとの国債証券引渡返還債務
	当社と清算参加者との間の	当社と清算参加者との間のネットィング口座ごとの
第2条第31号	国債店頭取引清算基金所要	ネットィング口座ごとの国債店頭取引

	額	清算基金所要額
	清算参加者が	清算参加者がネットイングごとに
第2条第40号	参加者決済に係る支払債務	ネットイング口座ごとの参加者決済に係る支払債務
	当社と清算参加者との間の	当社と清算参加者との間のネットイング口座ごとの
第2条第60号	第二階層清算参加者負担限度額（原取引按分）	ネットイング口座ごとの第二階層清算参加者負担限度額（原取引按分）
	国債店頭取引清算基金所要額	ネットイング口座ごとの国債店頭取引清算基金所要額
第2条第61号	第二階層清算参加者負担限度額（清算基金按分）	ネットイング口座ごとの第二階層清算参加者負担限度額（清算基金按分）
	当社に預託した国債店頭取引清算基金	当社に預託したネットイング口座ごとの国債店頭取引清算基金
第2条第73号	当初証拠金所要額	ネットイング口座ごとの当初証拠金所要額
	清算参加者が	清算参加者がネットイングごとに
第2条第99号	未決済資金ポジション	ネットイング口座ごとの未決済資金ポジション
	当社と清算参加者との間の	当社と清算参加者との間のネットイング口座ごとの
第2条第100号	未決済証券ポジション	ネットイング口座ごとの未決済証券ポジション
	当社と清算参加者との間の	当社と清算参加者との間のネットイング口座ごとの
第46条	清算参加者ごとに	清算参加者のネットイング口座ごとに
第46条の2	清算参加者ごとに	清算参加者のネットイング口座ごとに
第46条の3	清算参加者ごとに	清算参加者のネットイング口座ごとに
第50条の2	清算参加者ごとに	清算参加者のネットイング口座ごとに
第50条の3第1項	清算参加者は、	清算参加者は、ネットイング口座ごとに
第50条の4	当社が定めるところにより、	当社が定めるところにより、ネットイング口座ごとに
第50条の5	清算参加者ごとに	清算参加者のネットイング口座ごとに

第50条の6	清算参加者ごとに	清算参加者のネットイング口座ごとに
第50条の7	清算参加者ごとに	清算参加者のネットイング口座ごとに
第65条	清算参加者は	清算参加者は、ネットイング口座ごとに
第66条	清算参加者は	清算参加者は、ネットイング口座ごとに
第67条	清算参加者は、	清算参加者は、ネットイング口座ごとに
第68条	同一清算参加者の	同一清算参加者の同一ネットイング口座ごとの
第70条	清算参加者は	清算参加者は、ネットイング口座ごとに
	当初証拠金の額が	ネットイング口座ごとの当初証拠金の額が
	当初証拠金所要額	ネットイング口座ごとの当初証拠金所要額
第70条の3第1項	清算参加者は	清算参加者は、ネットイング口座ごとに
	当初証拠金のうち	ネットイング口座ごとの当初証拠金のうち
	当初証拠金所要額	ネットイング口座ごとの当初証拠金所要額
第70条の3第2項	当初証拠金	ネットイング口座ごとの当初証拠金
第70条の5	清算参加者は	清算参加者は、ネットイング口座ごとに
第70条の7	清算参加者は	清算参加者は、ネットイング口座ごとに
	国債店頭取引清算基金のうち	ネットイング口座ごとの国債店頭取引清算基金のうち
	国債店頭取引清算基金所要額	ネットイング口座ごとの国債店頭取引清算基金所要額
第70条の8第1項	当社が定める額	ネットイング口座ごとに当社が定める額

第73条	清算参加者ごと	清算参加者ごとネットイング口座ごと
第78条第1項	一切の債務	一切の債務（第7号に該当した場合には、当該ネットイング口座に関する債務に限る。）
	参加者決済に係る支払債務	ネットイング口座ごとの参加者決済に係る支払債務
第79条第1項	すべての金銭支払返還債務及び国債証券引渡返還債務	ネットイング口座ごとのすべての金銭支払返還債務及び国債証券引渡返還債務
	一の債務	ネットイング口座ごとの一の債務
第80条第1項	参加者決済に係る支払債務	ネットイング口座ごとの参加者決済に係る支払債務
	清算参加者の当社に対する債務	ネットイング口座ごとの清算参加者の当社に対する債務
	当該清算参加者に対する債務	当該ネットイング口座ごとの当該清算参加者に対する債務
同条第2項	清算参加者の当社に対する債務	ネットイング口座ごとの清算参加者の当社に対する債務
	参加者決済に係る支払債務	ネットイング口座ごとの参加者決済に係る支払債務
	当該清算参加者に対する債務	当該ネットイング口座ごとの当該清算参加者に対する債務
	当社の金銭支払返還債務	ネットイング口座ごとの清算参加者に対する当社の金銭支払返還債務
	当初証拠金代用預託残高に係る返還債務	ネットイング口座ごとの清算参加者に対する当初証拠金代用預託残高に係る返還債務
	国債店頭取引清算基金代用預託残高に係る返還債務	ネットイング口座ごとの清算参加者に対する国債店頭取引清算基金代用預託残高に係る返還債務
	破綻時証拠金代用預託残高に係る返還債務	ネットイング口座ごとの清算参加者に対する破綻時証拠金代用預託残高に係る返還債務
	個別銘柄取引に係る証券決	ネットイング口座ごとの個別銘柄取引

	済債務	に係る証券決済債務
	銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務	ネットイング口座ごとの銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務
	スタート/Rewind国債引渡債務(バスケット)	ネットイング口座ごとのスタート/Rewind国債引渡債務(バスケット)
	エンド/Unwind国債引渡債務(バスケット)	ネットイング口座ごとのエンド/Unwind国債引渡債務(バスケット)
	国債証券引渡債務	ネットイング口座ごとの国債証券引渡債務
第80条の5第1項	未決済資金ポジション及び未決済証券ポジション	ネットイング口座ごとの未決済資金ポジション及び未決済証券ポジション
	一の債務	ネットイング口座ごとの一の債務
第83条の2第1項第3号	当社に預託した国債店頭取引清算基金	当社に預託したネットイング口座ごとの国債店頭取引清算基金
	負担割合	ネットイング口座ごとの負担割合
	第二階層清算参加者負担限度額(原取引按分)	ネットイング口座ごとの第二階層清算参加者負担限度額(原取引按分)
同条第1項第5号	当社に預託した国債店頭取引清算基金	当社に預託したネットイング口座ごとの国債店頭取引清算基金
	第二階層清算参加者負担限度額(清算基金按分)	ネットイング口座ごとの第二階層清算参加者負担限度額(清算基金按分)
	国債店頭取引清算基金所要額	ネットイング口座ごとの国債店頭取引清算基金所要額
同条第2項	当社に預託した国債店頭取引清算基金	当社に預託したネットイング口座ごとの国債店頭取引清算基金
第83条の3	国債店頭取引清算基金所要額	ネットイング口座ごとの国債店頭取引清算基金所要額
	当社に預託している国債店頭取引清算基金	当社に預託しているネットイング口座ごとの国債店頭取引清算基金
	当該各清算参加者は	当該各清算参加者は、ネットイング口座ごとに
第83条の4	当社が規則で定める額	ネットイング口座ごとに当社が規則で定める額
第83条の5	当社に預託した国債店頭取	当社に預託したネットイング口座ごと

	引清算基金	の国債店頭取引清算基金
	第二階層清算参加者負担限度額（原取引按分）	ネットィング口座ごとの第二階層清算参加者負担限度額（原取引按分）
第83条の6	当社が定めた	ネットィング口座ごとに当社が定めた
	第二階層清算参加者負担限度額（原取引按分）	ネットィング口座ごとの第二階層清算参加者負担限度額（原取引按分）
第83条の7	変動証拠金等	ネットィング口座ごとの変動証拠金等
	利益相当額	ネットィング口座ごとの利益相当額
	当社が規則で定める額	当社がネットィング口座ごとに規則で定める額
第83条の8	清算参加者は	清算参加者は、ネットィング口座ごとに
第83条の9第1項	生存清算参加者は	生存清算参加者は、ネットィング口座ごとに
同条第2項	破綻時証拠金所要額	ネットィング口座ごとの破綻時証拠金所要額
同条第3項	終了した時点において	終了した時点において、ネットィング口座ごとに

- 2 清算参加者が信託口を開設している場合には、第50条の2から第50条の7までの規定は、一のネットィング単位（ネットィング口座及び第40条第2項第4号bに規定するネットィングの単位を区分する事項により特定される単位をいう。）を一のネットィング口座とみなして適用する。
- 3 信託口を開設している清算参加者は、当初証拠金グループを設定し、一の当初証拠金グループに一又は二以上の信託口を割り当てることができる。
- 4 清算参加者は、当初証拠金グループの設定又は設定の解除をしようとするときは、あらかじめ当社が定めるところにより、当社に届出を行わなければならない。
- 5 清算参加者が当初証拠金グループを設定している場合には、第70条から第70条の8まで、第73条、第78条、第80条、第83条の2から第83条の9まで並びに第86条第2項及び第3項の規定は、一の当初証拠金グループを一のネットィング口座とみなして適用する。

第11章の2 清算基金スポンサー制度

(清算基金スポンサー制度)

第90条の2 第70条の5の規定にかかわらず、清算参加者は、開設するネットティング口座のうち当社が定めるものに係る国債店頭取引清算基金を、清算基金スポンサー制度を利用して、他の一又は二以上の清算参加者に預託させることができる。

(清算基金スポンサー制度の利用の申請)

第90条の3 清算参加者は、清算基金スポンサー制度を利用しようとするときは、スポンサー参加者になろうとする清算参加者(第4号に規定するバックアップスポンサー参加者を指定する場合には、当該バックアップスポンサー参加者になろうとする清算参加者を含む。以下この条において同じ。)とともに、次の各号に掲げる事項を指定して、当社が定めるところにより、当社に申請しなければならない。

- (1) スポンサー利用ネットティング口座
 - (2) スポンサー参加者
 - (3) スポンサーネットティング口座
 - (4) 第2号で指定したスポンサー参加者が国債店頭取引清算基金の預託をできない状態となった場合に、新たにスポンサー参加者となる清算参加者(以下「バックアップスポンサー参加者」という。)をあらかじめ指定するときは、当該バックアップスポンサー参加者
 - (5) 複数のスポンサー参加者を指定する場合にあっては、スポンサー利用ネットティング口座に係る国債店頭取引清算基金所要額を各スポンサー参加者へ按分する際の比率(以下「スポンサー清算基金按分比率」という。)
- 2 当社は、前項の申請があった場合において、スポンサー参加者になろうとする清算参加者が次の各号(当該清算参加者がその親会社等から親会社等保証を受けている場合には第1号を除く。)に掲げる要件を満たしていると認めるときは、当該申請を承認する。
- (1) 純財産額(金融商品取引業者以外の者にあつては、純資産額)が100億円以上であること。
 - (2) スポンサー利用参加者のために国債店頭取引清算基金の預託をすることに関し、適切な業務執行体制を備えていること。
- 3 スポンサー利用参加者は、指定するスポンサー参加者(バックアップスポンサー参加者を含む。以下この条において同じ。)を変更しようとする場合には、あらかじめ当社が定めるところにより、当社に申請しなければならない。
- 4 スポンサー利用参加者は、スポンサー参加者を指定していない状態となった場合は、速やかに新たなスポンサー参加者を指定する旨の申請をしなければならない。ただし、当該スポンサー利用参加者があらかじめバックアップスポンサー参加者を指定しているときは、当社は、当該スポンサー利用参加者が当該バックアップスポンサー参加者をスポンサー参加者と指定する旨の申請をしたものとみなす。

5 当社は、前2項の申請があった場合において、スポンサー参加者になろうとする清算参加者が第2項各号に掲げる要件を満たしていると認めるときは、当該申請を承認する。

(清算基金スポンサー制度を利用する場合の国債店頭取引清算基金の預託義務)

第90条の4 第70条の5第1項の規定にかかわらず、スポンサー利用ネット口座に係る国債店頭取引清算基金は、スポンサー参加者が預託しなければならない。

2 前項の場合において、スポンサー参加者が預託している国債店頭取引清算基金の額が国債店頭取引清算基金所要額に満たないにもかかわらず、当該スポンサー参加者がその不足額以上の額の金銭を当社に追加預託しないときは、スポンサー利用参加者は、当該不足額のうちスポンサー利用ネット口座に係る額として当社が定める額以上の金銭を、当社が定めるところにより、当社に預託しなければならない。この場合において、スポンサー利用参加者が預託した金銭は、当該スポンサー利用参加者の国債店頭取引清算基金とする。

(スポンサー参加者が預託する国債店頭取引清算基金による損失の補填)

第90条の5 当社は、スポンサー利用参加者が破綻清算参加者となった場合には、第83条第1項の規定にかかわらず、第一階層国債店頭取引決済保証準備金の取崩しによる補填の前に、スポンサー参加者が当社に預託した国債店頭取引清算基金の取崩しにより、破綻処理損失を補填する。この場合において、国債店頭取引清算基金の取崩しは、清算基金スポンサー制度を利用していなかったとした場合のスポンサー利用ネット口座の国債店頭取引清算基金所要額（当該スポンサー利用ネット口座について複数のスポンサー参加者を指定している場合にあつては、当該額にスポンサー清算基金按分比率（一部のスポンサー参加者の破綻等により、スポンサー利用ネット口座について残存するスポンサー参加者のスポンサー清算基金按分比率の合計が1に満たなくなった場合においては、各スポンサー参加者のスポンサー清算基金按分比率を残存するすべてのスポンサー参加者のスポンサー清算基金按分比率の合計で除した値をスポンサー清算基金按分比率とする。以下同じ。）を乗じて得た額）を限度として行う。

(清算基金スポンサー制度利用時の生存参加者の損失の補填の特例)

第90条の6 第83条の2、第83条の4及び第83条の5の規定にかかわらず、スポンサー利用参加者及びスポンサー参加者以外の清算参加者が破綻清算参加者である場合における、当該スポンサー利用参加者及び当該スポンサー参加者に係る次の表の上欄に掲げる額は、スポンサー利用ネット口座については0円とし、スポンサーネット口座については同表の下欄に掲げる額とする。この場合において、同表の下欄における第83条の2第1項、第83条の4及び第83条の5第2項の規定による算出は、

清算基金スポンサー制度を利用していなかったものとして行う。

<p>第83条の2第1項の規定により取崩しをする額</p>	<p>スポンサーネットイング口座について第83条の2第1項の規定により算出した額に、スポンサー利用ネットイング口座について同項の規定により算出した額（当該スポンサー利用ネットイング口座について複数のスポンサー参加者を指定している場合にあっては、当該額にスポンサー清算基金按分比率を乗じて得た額）を加算した額</p>
<p>第83条の4の規定により第三階層特別清算料として支払う額</p>	<p>スポンサーネットイング口座について第83条の4の規定により算出した額に、スポンサー利用ネットイング口座について同条の規定により算出した額（当該スポンサー利用ネットイング口座について複数のスポンサー参加者を指定している場合にあっては、当該額にスポンサー清算基金按分比率を乗じて得た額）を加算した額</p>
<p>第83条の5第2項の規定により取崩しをする額</p>	<p>スポンサーネットイング口座について第83条の5第2項の規定により算出した額に、スポンサー利用ネットイング口座について同項の規定により算出した額（当該スポンサー利用ネットイング口座について複数のスポンサー参加者を指定している場合にあっては、当該額にスポンサー清算基金按分比率を乗じて得た額）を加算した額</p>

- 2 第83条の6及び第83条の7の規定にかかわらず、前項に規定する場合における、スポンサー参加者及びスポンサー利用参加者の次の各号に掲げる特別清算料については、スポンサー利用ネットイング口座についてスポンサー利用参加者が支払い義務を負う額は0円とし、スポンサーネットイング口座についてスポンサー参加者が支払う額はそれぞれ当該各号に掲げる額とする。この場合において、第1号における第83条の6の規定による算出は、清算基金スポンサー制度を利用していなかったものとして行う。

(1) スポンサー利用参加者が第三階層特別清算料（追加分）負担参加者である場合における第三階層特別清算料（追加分） スポンサーネットイング口座について第83条の6の規定により算出した額に、スポンサー利用ネットイング口座について同条の規定により算出した額（当該スポンサー利用ネットイング口座について複数のスポンサー参加者を指定している場合にあっては、当該額にスポンサー清算基金按分比率を乗じて得た額）を加算した額

(2) スポンサー利用参加者が第四階層特別清算料負担参加者であるときにおける第四階層特別清算料 スポンサーネットイング口座について第83条の7第2項の規定により算出した額に、スポンサー利用ネットイング口座について同項の規定により算出した額（当該スポンサー利用ネットイング口座について複数のスポンサー参加者を

指定している場合にあつては、当該額にスポンサー清算基金按分比率を乗じて得た額)を加算した額

(清算基金スポンサー制度の利用の取りやめ)

第90条の7 スポンサー利用参加者は、清算基金スポンサー制度の利用を取りやめようとする場合は、当社が定めるところにより、あらかじめその内容を当社に届け出なければならない。

(清算基金スポンサー制度の利用の取消し等)

第90条の8 当社は、スポンサー参加者が第90条の3第2項に掲げる要件を満たさなくなつたときは、スポンサー参加者の指定を取り消すことができる。

2 当社は、スポンサー利用参加者が第90条の3第4項の規定による新たなスポンサー参加者を指定する旨の申請を速やかに行わないときは、清算基金スポンサー制度の利用の承認を取り消すことができる。

第12章 雑則

(決済時限の臨時変更)

第91条 当社は、必要があると認めるときは、当社と清算参加者との間の決済時限を臨時に変更することができる。この場合において、当社は、あらかじめその旨を清算参加者に通知する。

(システム障害時等における決済日の繰延べ)

第92条 当社は、本業務方法書に基づく当社と清算参加者との間の決済を行うために必要な当社又は当社以外の機関が設置するシステムの稼働に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、当該システムを利用して決済を行うことが不可能又は困難であると認める場合は、当該決済の全部又は一部につき決済日等をその翌日以降に繰り延べることができる。この場合において、当社は、あらかじめその旨を清算参加者に通知する。

2 前項に規定する決済日の繰延べに関し必要な事項は、当社がその都度定める。

(天災地変等の場合における非常措置)

第93条 当社は、本業務方法書に基づく当社と清算参加者との間の決済が、天災地変その他やむを得ない理由に基づいて、不可能又は著しく困難であると認められるに至ったときは、取締役会の決議により、決済の条件を改めて定めることができる。

- 2 前項の規定により当社が決済の条件を定めたときは、清算参加者は、これに従わなければならない。
- 3 第1項の場合において、緊急の必要があるときは、当社は、取締役会の決議を経ずに、決済の条件を改めて定めることができる。

(発行日前取引に基づく債権債務の解消等)

第94条 当社は、発行日前取引（国債証券の売買、現金担保付債券貸借取引又は銘柄先決め現先取引であって、当該国債証券が当初予定された発行日に発行されることを停止条件として当該発行日の前日以前に約定を行い、当該取引の決済を発行日以降に行うものをいう。）に基づく清算対象取引につき、当該取引の対象となる国債証券の発行条件が変更される場合又は当該取引の決済日等までに当該対象国債証券が発行されない場合若しくは発行されないと認められる場合には、当該取引に係る決済日等の変更又は当該取引に基づく債権債務の解消に関する措置を行うことができる。

(他の清算業務における国債店頭取引清算業務に係る余剰担保の利用)

第95条 当社は、破綻清算参加者から預託を受けた国債店頭取引清算業務に係る余剰担保（破綻清算参加者が国債店頭取引清算業務に関して当社に対して返還請求権を有する当初証拠金その他の担保のうち、本業務方法書等の定めるところにより破綻清算参加者の債務の弁済に充当した残額に係るものをいう。）を、他の清算業務に係る業務方法書の定めるところにより破綻清算参加者の当社に対する他の債務の弁済に充当することができる。

(事務の委任)

- 第96条 当社は、国債店頭取引清算業務に関し、当社が定める事務を、当社が指定する者に委任することができる。
- 2 清算参加者は、本業務方法書に規定するほか、前項の事務に関して同項により指定する者が当社の承認を受けて定めるところによらなければならない。
 - 3 第17条の規定は、第1項の場合について準用する。

(国債店頭取引清算業務に関する必要事項の決定)

第97条 当社は、本業務方法書に規定する事項のほか、国債店頭取引清算業務に関して必要がある場合には、所要の取扱いについて規則により定めることができる。

(附帯業務)

第98条 当社は、金融商品債務引受業等（第3条に規定するものに限る。）に附帯する業務を行う。

（改正権限）

第99条 本業務方法書の変更は、当社の取締役会の決議をもって行う。ただし、変更の内容が軽微である場合は、この限りでない。

（国債店頭取引運営委員会）

第100条 当社は、前条に規定する本業務方法書の変更を行おうとする場合において、当該変更が次の各号に掲げる事項に該当するときは、当該変更を行うことの適否につき、国債店頭取引運営委員会に諮問し、その意見を尊重するものとする。ただし、当該変更の内容が軽微なものである場合は、この限りでない。

- （1） 第4条に規定する清算対象取引に関する事項
- （2） 第7条に規定する国債店頭取引清算資格の要件に関する事項
- （3） 第2章第3節に規定する清算参加者の申請による国債店頭取引清算資格の喪失に関する事項
- （4） 第2章第4節に規定する清算参加者に対する措置等に関する事項
- （5） 第3章に規定する有価証券等清算取次ぎに関する事項
- （6） 第7章に規定する変動証拠金に関する事項
- （7） 第9章に規定する当初証拠金及び国債店頭取引清算基金に関する事項
- （8） 第10章に規定する清算参加者の決済不履行時の措置に関する事項
- （9） 前条に規定する本業務方法書の変更の方法に関する事項
- （10） 国債店頭取引運営委員会への諮問に関する事項

2 前項に定めるもののほか、国債店頭取引運営委員会に関する事項は当社が規則で定める。

（準拠法及び合意管轄）

第101条 本業務方法書等の準拠法は、日本法とする。

2 当社と清算参加者との間で本業務方法書等から生じる権利義務について紛議が生じた場合の争訟については、東京地方裁判所を専属管轄裁判所とする。ただし、当社は、管轄が認められる国外の裁判所において清算参加者に対し訴訟を提起することを妨げられない。

付 則

- 1 本業務方法書は、平成25年10月1日から施行する。ただし、第90条第2項から第4項までの規定は、当社が別に定める日から施行する。
- 2 本業務方法書の施行の日（以下「施行日」という。）から平成26年3月30日までの間における第7条第1項第2号bの(c)、同条第2項第1号bの(c)、同条第2項第2号bの(c)、第28条第3項第5号及び同条第4項第5号の規定の適用については、第7条第1項第2号bの(c)イ、同条第2項第1号bの(c)イ、同条第2項第2号bの(c)イ、第28条第3項第5号a及び同条第4項第5号a中「4.5パーセント」とあるのは「3.5パーセント」と、第7条第1項第2号bの(c)ロ、同条第2項第1号bの(c)ロ、同条第2項第2号bの(c)ロ、第28条第3項第5号b及び同条第4項第5号b中「6パーセント」とあるのは「4.5パーセント」とする。
- 3 平成26年3月31日から平成27年3月30日までの間における第7条第1項第2号bの(c)、同条第2項第1号bの(c)、同条第2項第2号bの(c)、第28条第3項第5号及び同条第4項第5号の規定の適用については、第7条第1項第2号bの(c)イ、同条第2項第1号bの(c)イ、同条第2項第2号bの(c)イ、第28条第3項第5号a及び同条第4項第5号a中「4.5パーセント」とあるのは「4パーセント」と、第7条第1項第2号bの(c)ロ、同条第2項第1号bの(c)ロ、同条第2項第2号bの(c)ロ、第28条第3項第5号b及び同条第4項第5号b中「6パーセント」とあるのは「5.5パーセント」とする。
- 4 施行日の前日において、株式会社日本国債清算機関が定める業務方法書（以下「国債清算機関業務方法書」という。）に基づく自社清算資格を有する者は当社の国債店頭取引自社清算資格を、国債清算機関業務方法書に基づく他社清算資格を有する者は当社の国債店頭取引他社清算資格を、それぞれ施行日において有するものとする。
- 5 前項のほか、施行日の前日において国債清算機関業務方法書等（国債清算機関業務方法書及び国債清算機関業務方法書に基づく規則をいう。以下この項において同じ。）に基づき株式会社日本国債清算機関と同社の清算参加者の間で生じている法律関係については、施行日以後は本業務方法書（本業務方法書に基づく規則を含む。）を適用し、国債清算機関業務方法書等は、廃止する。
- 6 施行日以前において株式会社日本国債清算機関の清算参加者が行った行為が本業務方法書第2章第5節に規定する清算参加者に対する措置等の起因となる行為に該当する場合には、当該行為を第2章第5節に規定する清算参加者に対する措置等の起因となる行為とみなして本業務方法書を適用する。
- 7 前3項の規定のほか、本業務方法書の施行時における国債取引清算業務の取扱いその他必要な事項については、当社がその都度定める。

（注）第1項の「当社が別に定める日」は平成26年1月14日。

付 則

この改正規定は、平成26年1月14日から施行する。

付 則

この改正規定は、当社が定める日から施行する。

(注)「当社が定める日」は平成26年3月7日。

付 則

- 1 この改正規定は、平成26年3月24日から施行する。
- 2 前項の規定にかかわらず、やむを得ない事由により改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、平成26年3月24日以後の当社が定める日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成26年3月31日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成26年6月2日から施行する。

付 則

- 1 この改正規定は、平成26年10月14日から施行する。
- 2 前項の規定にかかわらず、当社のシステムの稼働に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、平成26年10月14日以後の当社が定める日から施行する。この場合において、この改正規定の施行時における取扱いに関し必要な事項については、当社がその都度定める。

付 則

- 1 この改正規定は、平成27年10月13日から施行する。ただし、第51条第3項から第5項まで、第54条第3項、第56条第4項、第57条第3項、第59条第3項、第60条第3項、第62条第3項及び第63条第3項の改正規定は、平成27年10月14日から施行する。
- 2 前項の規定にかかわらず、やむを得ない事由により改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、平成27年10月13日以後の当社が定める日から

施行する。

付 則

- 1 この改正規定は、平成30年5月1日から施行する。
- 2 第6条第4項に規定する国債店頭取引清算資格の承認に際し同条第6項の規定に従い当社が指定した期日が、この改正規定の施行の日である場合には、同条第1項及び第2項の規定にかかわらず、当初証拠金及び国債店頭取引清算基金の預託その他当社が必要と認める国債店頭取引清算資格の取得手続に関しては別途当社が定めるところによる。
- 3 前2項の規定にかかわらず、当社のシステムの稼働に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、平成30年5月1日以後の当社が定める日から施行する。この場合において、この改正規定の施行時における取扱いに関し必要な事項については、当社がその都度定める。

付 則

この改正規定は、平成30年10月5日から施行する。

付 則

- 1 この改正規定は、令和4年1月11日から施行する。
- 2 前項の規定にかかわらず、当社のシステムの稼働に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、令和4年1月11日以後の当社が定める日から施行する。この場合において、この改正規定の施行時における取扱いに関し必要な事項については、当社がその都度定める。

付 則

- 1 この改正規定は、令和7年6月23日から施行する。
- 2 前項の規定にかかわらず、当社のシステムの稼働に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、令和7年6月23日以後の当社が定める日から施行する。この場合において、この改正規定の施行時における取扱いに関し必要な事項については、当社がその都度定める。
- 3 この改正規定の施行に関し必要な事項については、当社が別に定めるところによる。

付 則

- 1 この改正規定は、令和8年6月8日から施行する。
- 2 前項の規定にかかわらず、当社のシステムの稼働に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、

令和8年6月8日以後の当社が定める日から施行する。この場合において、この改正規定の施行時における取扱いに関し必要な事項については、当社がその都度定める。

付 則

- 1 この改正規定は、令和8年6月8日から施行する。
- 2 前項の規定にかかわらず、当社のシステムの稼働に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、令和8年6月8日以後の当社が定める日から施行する。この場合において、この改正規定の施行時における取扱いに関し必要な事項については、当社がその都度定める。