

国債店頭取引清算業務に関する業務方法書の取扱い

(目的)

第1条 この規則は、国債店頭取引清算業務に関する業務方法書（以下「業務方法書」という。）に基づき、当社が定める事項について規定する。

(保証に関する書面)

第1条の2 業務方法書第2条第1項第10号、第6条第2項及び第9条の3に規定する当社が定める様式は、別紙様式第1号の様式とする。

(清算対象取引)

第2条 業務方法書第4条第1項に規定する当社が定めるものは、次の各号に掲げる国債証券（流動性等を勘案し当社が適当でないと認めるものを除く。）とする。

- (1) 利付国債（個人向け国債（個人向け国債の発行等に関する省令（平成14年財務省令第68号）第2条に規定する個人向け国債をいう。）を除く。以下同じ。）
- (2) 割引国債（次号に掲げるものを除き、分離元本振替国債（社債、株式等の振替に関する法律（平成13年法律第75号。以下「振替法」という。）第90条第2項に規定する分離元本振替国債をいう。以下同じ。）及び分離利息振替国債（同法第90条第3項に規定する分離利息振替国債をいう。以下同じ。）を含む。以下同じ。）
- (3) 国庫短期証券

2 業務方法書第4条第2項に規定する当社が定めるものは、次の各号に掲げる取引ごとに、当該各号に定める事項に適合する取引とする。

- (1) 国債証券の売買等
 - a 売買決済日が約定日の1か月後の応当日（当該応当日がないときはその月の末日（休業日に当たるときは、順次繰り上げる。）、当該応当日が休業日に当たるときは翌日（休業日に当たるときは、順次繰り下げる。以下同じ。）（当該翌日が翌月となるときは当該応当日の前日（休業日に当たるときは、順次繰り上げる。第14条第2項第3号を除き、以下同じ。））とする。以下同じ。）の前日までに到来すること（発行日前取引においては、売買決済日が約定日の1か月後の応当日の前日まで、又は、発行日に到来すること）。
 - b 対象国債証券の数量が額面5万円（変動利付国債及び物価連動国債（物価連動国債の取扱いに関する省令（平成16年財務省令第7号）第1条に規定する物価連動国債をいう。以下同じ。）にあっては額面10万円）の整数倍であること。
 - c 変動利付国債について、当社に債務の引受けの申込みを行う時点で、売買決済日

が利率の確定している利子計算期間内（利率の確定している利子計算期間の最終日が休業日の場合は、当該最終日の翌営業日以前。以下同じ。）であること。

- d 物価連動国債について、当社に債務の引受けの申込みを行う時点で、売買決済日における連動係数（物価連動国債の連動係数として財務省が公表する数値をいう。以下同じ。）が確定していること。
- e 当社に債務の引受けの申込みを行う時点で、対象国債証券の銘柄及び利率が確定していること。

(2) 現金担保付債券貸借取引等

- a 取引決済日が約定日の1年後の応当日までに到来すること。
- b 当社に債務の引受けの申込みを行う時点で、取引決済日が確定していること。
- c 対象国債証券の数量が額面5万円（変動利付国債及び物価連動国債にあつては額面10万円）の整数倍であること。
- d 変動利付国債について、当社に債務の引受けの申込みを行う時点で、取引決済日が利率の確定している利子計算期間内であること。
- e 物価連動国債について、当社に債務の引受けの申込みを行う時点で、取引実行日における連動係数が確定していること。
- f 基準担保金率（借方清算参加者が維持すべき担保金の金額を算出するために時価総額に乗じる比率をいう。）が100パーセントであること。
- g 当社に債務の引受けの申込みを行う時点で、対象国債証券の銘柄及び利率が確定していること。

(3) 銘柄先決め現先取引等

- a エンド取引受渡日が約定日の1年後の応当日までに到来すること。
- b 当社に債務の引受けの申込みを行う時点で、エンド取引受渡日が確定していること。
- c エンド取引受渡日までの間に対象国債証券の償還期日が到来しないこと。
- d 対象国債証券の数量が額面5万円（変動利付国債及び物価連動国債にあつては額面10万円）の整数倍であること。
- e 変動利付国債について、当社に債務の引受けの申込みを行う時点で、エンド取引受渡日が利率の確定している利子計算期間内であること。
- f 物価連動国債について、当社に債務の引受けの申込みを行う時点で、スタート取引受渡日における連動係数が確定していること。
- g 利付国債の銘柄先決め現先取引等について、利含み現先取引等（現先取引等のうち、売買単価（額面100円あたりの価額をいう。以下この条において同じ。）にエンド取引受渡日までの日数に応じた経過利子（円位未満は切り捨てる。）が含ま

れるものであって、スタート取引受渡日翌日（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対象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現先買方清算参加者が現先売方清算参加者に利払期日に支払うものをいう。）であること。

- h 売買金額算出比率（銘柄先決め現先取引等において、スタート取引の売買単価を算出するために約定時点における対象国債証券の時価を除する数から1を減じた数をいう。）が0であること。
- i 当社に債務の引受けの申込みを行う時点で、対象国債証券の銘柄及び利率が確定していること。

(4) 銘柄後決め現先取引等

- a エンド取引受渡日が約定日の1年後の応当日までに到来すること。
- b 当社に債務の引受けの申込みを行う時点で、エンド取引受渡日が確定していること。
- c スタート受渡金額が1,000万円の整数倍であること。
- d スタート取引受渡日翌日（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銘柄割当てにより割り当てられた国債証券の銘柄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現先買方清算参加者が現先売方清算参加者に利払期日に支払う取引であること。

(バスケットの設定等)

- 第2条の2 当社は、業務方法書第4条第3項の規定に基づき、取引の対象となる国債証券の範囲として、一又は二以上の国債証券の名称を指定して、バスケットを設定する。
- 2 当社は、設定したバスケットを廃止し又は指定の内容を変更することができる。
 - 3 当社は、バスケットを設定し又は指定の内容を変更する場合において、当該バスケットに含まれる国債証券の名称の全部又は一部に関し、残存年限に係る条件を付し、又は特定の国債証券の銘柄を追加し若しくはこれを除外することができる。
 - 4 前3項の規定により当社がバスケットの設定等を行う場合には、当社はあらかじめ清算参加者に通知する。

(国債店頭取引清算資格の取得申請)

第3条 業務方法書第6条第1項から第3項まで又は第5項に規定する国債店頭取引清算資格の取得申請は、資格取得申請者が、次の各号に掲げる事項を記載した所定の国債店頭取引清算資格取得申請書を当社に提出して行うものとする。

- (1) 取得しようとする国債店頭取引清算資格の区分（業務方法書第6条第2項に規

定する国債店頭取引清算資格の取得の申請を行う場合にあっては、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する国債店頭取引自社清算資格である旨、同条第3項に規定する国債店頭取引清算資格の取得の申請を行う場合にあっては、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、当社が同第44条第1項及び同第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次条に規定す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である旨)

(2) 商号又は名称(英文の商号又は名称を含む。)

(3) 本店又は主たる事務所の所在地

(4) 代表者名

(5) 国債店頭取引清算資格の取得申請理由

2 前項に規定する国債店頭取引清算資格取得申請書には、当社が必要と認める書類を添付しなければならない。

(当社が定める比率)

第4条 業務方法書第6条第3項、同第7条第3項第2号及び同第28条第10項に規定する当社が定める比率は100分の90とする。

(国債店頭取引清算資格の取得手続)

第5条 業務方法書第8条第1項に規定する国債店頭取引清算資格の取得手続は、国債店頭取引清算資格取得手数料の支払いその他当社が必要と認める手続とする。

2 前項に規定する国債店頭取引清算資格取得手数料は100万円とし、取得申請者は、これに消費税額及び地方消費税額を加算して支払うものとする。

3 第1項の規定は、業務方法書第8条第3項に規定する国債店頭取引清算資格の取得手続について準用する。この場合において、第1項中「国債店頭取引清算資格取得手数料の支払いその他当社が必要と認める手続」とあるのは「当社が必要と認める手続」と読み替えるものとする。

(清算参加者契約)

第5条の2 業務方法書第10条に規定する当社が定める様式は、別紙様式第2号の様式とする。

(届出事項)

第6条 業務方法書第11条第1項、同第12条、同第18条及び同第42条第2項に規

定する当社への届出は、当社が指定するときまでに、所定の届出書に当社が必要と認める書類を添付して行うものとする。

(報告事項)

第7条 業務方法書第19条に規定する当社が定める場合は、次の各号に掲げる場合とし、所定の報告書に当社が必要と認める書類を添付して報告するものとする。

- (1) 損失の危険の管理方法、業務分掌の方法その他の業務の内容及び方法を定めたとき又は変更したとき。
- (2) 指定親会社（法57条の12第3項に規定する指定親会社をいう。以下同じ。）が法第57条の13第1項第6号に掲げる事項について法第57条の14の届出を行ったことを知ったとき。
- (3) 事業を休止し、又は再開したとき。
- (4) 破産手続開始、再生手続開始、更生手続開始若しくは清算開始又は特別清算開始の申立てを行ったとき又はこれらの申立てが行われた事実を知ったとき。
- (5) 指定親会社について、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の事実があったことを知ったとき。
- (6) 支払不能となり又は支払不能となるおそれがある状態となったとき。
- (7) 指定親会社が支払不能となり又は支払不能となるおそれがある状態となったことを知ったとき。
- (8) 純財産額（金融商品取引業者以外の者にあつては、純資産額とする。以下この号において同じ。）が50億円及び10億円を下回ったとき（当該清算参加者が国債店頭取引他社清算参加者である場合は、純財産額が200億円を下回ったとき、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は、純財産額が10億円を下回ったとき、当該清算参加者が業務方法書第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である場合は、純財産額が25億円及び10億円を下回ったとき）。
- (9) 資本金の額又は出資の総額が3億円を下回ったとき。
- (10) 次のaからdまでに掲げる区分に従い、当該aからdまでに定める事由に該当したとき。
 - a 金融商品取引業者、証券金融会社又は短資会社
自己資本規制比率又は連結自己資本規制比率が200パーセント及び140パーセントを下回ったとき（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）。
 - b 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。）

次の（a）から（c）までのいずれかに該当したとき（外国銀行にあつては、これに準ずる場合に該当したとき）。

（a） 単体又は連結普通株式等Tier 1比率（農林中央金庫及び国際統一基準金庫にあつては、単体又は連結普通出資等Tier 1比率とする。以下同じ。）が4.5パーセントを下回ったとき。

（b） 単体又は連結Tier 1比率が6パーセントを下回ったとき。

（c） 単体又は連結総自己資本比率が8パーセントを下回ったとき。

c 国際統一基準行等以外の銀行等

国内基準に係る単体又は連結自己資本比率が4パーセントを下回ったとき。

d 保険会社

単体又は連結ソルベンシー・マージン比率が400パーセント及び200パーセントを下回ったとき。

（11） 総株主の議決権（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法（平成17年法律第86号）第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含む。）又は出資に係る議決権の過半数が一の個人又は他の一の法人又その他の団体によって保有されることを知ったとき。

（12） 大株主上位10名（自己又は他人の名義をもって所有する株式の数が多い順に10名の株主をいう。）に関し変更があつたとき。

（13） 役員が他の会社その他の法人の役員に就任又は退任したとき

（14） 法令の規定により処分若しくは処罰を受けたとき又は法令の規定による処分に係る聴聞若しくは弁明の機会の付与が行われたとき。

（15） 指定親会社又は特定主要株主（法第32条第4項に規定する特定主要株主をいう。以下同じ。）が法令の規定により処分若しくは処罰を受けたことを知ったとき又は法令の規定による処分に係る聴聞若しくは弁明の機会の付与が行われたことを知ったとき。

（15）の2 前2号に規定する処分に伴い行政官庁に対し改善策等を報告したとき。

（16） 金融商品取引業者にあつては、役員が法第29条の4第1項第2号イからリまでに掲げる者のいずれかに該当することとなつた事実を知ったとき、金融商品取引業者以外の者にあつては、役員が破産手続開始の決定、禁錮以上の刑又は法令の規定により罰金の刑を受けた事実を知ったとき。

（17） 指定親会社の役員が法第29条の4第1項第2号イからリまでに掲げる者のいずれかに該当することとなつた事実を知ったとき。

- (18) 金融商品取引業者の主要株主（法第29条の4第2項に規定する主要株主をいう。以下同じ。）が同条第1項第5号ニ又はホに該当することとなった事実を知ったとき（外国法人にあっては、主要株主に準ずるものが同号へに該当することとなった事実を知ったとき。）。
- (19) 指定親会社の主要株主が法第29条の4第1項第5号ニ又はホに該当することとなった事実を知ったとき。
- (20) 民事事件に係る訴え（訴訟の目的の価額が10億円未満のものを除く。以下同じ。）を提起され若しくは当該訴訟について判決等があったとき（上訴の場合を含む。）又は民事調停法による調停（調停を求める事項の価額が10億円未満のものを除く。以下同じ。）を申し立てられ若しくは当該調停事件が終結したとき。
- (21) 指定親会社が民事事件に係る訴えを提起され若しくは当該訴訟について判決等があったことを知ったとき（上訴の場合を含む。）又は民事調停法による調停を申し立てられ若しくは当該調停事件が終結したことを知ったとき。
- (21)の2 金融商品取引業者にあっては、法第46条の3第2項の規定に基づく関係会社に関する報告書を作成したとき、登録金融機関にあっては、法第48条の2第2項の規定に基づく関係会社に関する報告書を作成したとき、外国法人である金融商品取引業者にあっては、法第49条の3第2項の規定に基づく関係会社に関する報告書を作成したとき。
- (22) 法第56条の2に基づくモニタリング調査表（証券金融会社又は短資会社にあっては、これに準ずるもの、国債店頭取引他社清算参加者である登録金融機関にあっては、当社が定める主要勘定状況表とする。）を作成したとき。
- (23) 法第57条の5第3項の規定に従い公衆の縦覧に供する経営の健全性の状況を記載した書面を作成したとき。
- (24) 最終指定親会社（法第57条の12第3項に規定する最終指定親会社をいう。以下同じ。）が法第57条の17第3項の規定に従い公衆縦覧に供する経営の健全性の状況を記載した書面を作成したとき。
- (25) 金融商品取引業者にあっては、事業報告書を作成したとき、銀行等又は保険会社にあっては、単体又は連結の業務報告書又は中間業務報告書を作成したとき、証券金融会社にあっては、事業報告書又は中間決算状況表を作成したとき、短資会社にあっては、業務報告書を作成したとき。
- (26) 法第57条の3第1項に基づく事業報告書を作成したとき。
- (27) 最終指定親会社が事業報告書を作成したとき。
- (28) 信託口を有する清算参加者にあっては、当社が定める信託財産残高における国債残高に関する報告書を作成したとき。

- (29) 当社が定める決算概況表又は中間決算概況表を作成したとき。
 - (30) 外国法人である金融商品取引業者にあつては、法第49条の3第1項に規定する貸借対照表、損益計算書その他財務計算に関する書類を作成したとき。
 - (31) 指定親会社が本店又は主たる事務所を変更したことを知ったとき。
 - (32) 法第57条の2第1項又は同条第6項（同項第2号に該当することとなった場合に限る。）の届出を行ったとき。
 - (33) 指定親会社の指定があつたこと、当該指定が解除されたこと又は当該指定が効力を失ったことを知ったとき。
 - (34) 指定親会社が他の法人と合併したことを知ったとき（当該指定親会社が合併により消滅した場合又は業務方法書第18条第3項に基づき当該合併に係る届出を既に行っている場合を除く。）。
 - (35) 指定親会社の役員の変更があつたことを知ったとき（第13号に掲げる場合を除く。）。
 - (36) 新たに特定主要株主に該当した者があつたこと又は特定主要株主に該当しなくなった者があつたことを知ったとき。
 - (37) 事業年度の末日の変更があつたとき。
- 2 前項第25号に掲げる場合の報告においては、同項本文に定めるもののほか、事業報告書又は単体の業務報告書に添付される計算書類に係る会計監査人の監査報告書（これに準ずるものとして当社が適当と認めるものを含む。）を添付するものとする。
- 3 親会社等保証を受けている清算参加者にあつては、業務方法書第19条に規定する当社が定める場合は、第1項各号に掲げる場合のほか、次の各号に掲げる場合とし、所定の報告書に当社が必要と認める書類を添付して報告するものとする。
- (1) 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。以下本条において同じ。）が第1項第3号、第4号、第6号、第9号、第10号、第20号から第23号まで、第25号及び第26号に該当することとなったとき（第1項第4号にあつては、同項第5号に基づき既に親会社等に係る報告を行っている場合を、同項第6号にあつては、同項第7号に基づき既に親会社等に係る報告を行っている場合を、同項第20号にあつては、同項第21号に基づき既に親会社等に係る報告を行っている場合を除く。）。
 - (2) 親会社等の純財産額（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）を下回ったとき。
- 4 前項において、親会社等が第1項第25号に該当することとなった場合の報告におい

ては、前項本文に定めるもののほか、親会社等が作成した事業報告書又は単体の業務報告書に添付される計算書類に係る会計監査人の監査報告書（これに準ずるものとして当社が適当と認めるものを含む。）を添付するものとする。

（国債店頭取引清算資格の喪失申請）

第8条 業務方法書第21条に規定する国債店頭取引清算資格の喪失申請は、国債店頭取引清算資格の喪失申請者が、次の各号に掲げる事項を記載した所定の国債店頭取引清算資格喪失申請書を当社に提出して行うものとする。

- （1） 喪失しようとする国債店頭取引清算資格の区分
- （2） 商号又は名称（英文の商号又は名称を含む。）
- （3） 本店又は主たる事務所の所在地
- （4） 代表者名
- （5） 国債店頭取引清算資格の喪失申請理由

2 前項に規定する国債店頭取引清算資格喪失申請書には、国債店頭取引清算資格の喪失にあたり当社が必要と認める書類を添付しなければならない。

（純財産額等として維持すべき額）

第9条 業務方法書第28条第5項第1号に規定する当社が定める額は、国債店頭取引に係る当初証拠金所要額に関する規則第2条に規定する当該清算参加者の当初証拠金所要額（信託口に係るものを除く。以下第4項までにおいて同じ。）（その親会社等から親会社等保証を受けた清算参加者（以下「親会社等保証特例適用先」という。）にあつては、当該親会社等保証特例適用先の当初証拠金所要額に当該親会社等保証特例適用先の親会社等（当該親会社等保証特例適用先のために親会社等保証を行う親会社等に限る。）の当初証拠金所要額を加算した額、親会社等保証特例適用先のために親会社等保証を行う親会社等である清算参加者にあつては、当該親会社等である清算参加者の当初証拠金所要額に当該親会社等保証特例適用先の当初証拠金所要額を加算した額）とする。

2 複数のネットティング口座を開設している清算参加者について、前項の規定を適用する場合には、「清算参加者の当初証拠金所要額」とあるのは、「清算参加者のネットティング口座ごとの当初証拠金所要額の合計額」と、「親会社等保証特例適用先の当初証拠金所要額」とあるのは、「親会社等保証特例適用先のネットティング口座ごとの当初証拠金所要額の合計額」と、「当該親会社等である清算参加者の当初証拠金所要額」とあるのは、「当該親会社等である清算参加者のネットティング口座ごとの当初証拠金所要額の合計額」と読み替えるものとする。

3 親会社等保証特例適用先のために親会社等保証を行う親会社等である清算参加者が複

数のネットティング口座を開設している場合において、当該親会社等保証特例適用先について第1項の規定を適用するときは、「当該親会社等保証特例適用先の親会社等（当該親会社等保証特例適用先のために親会社等保証を行う親会社等に限る。）の当初証拠金所要額」とあるのは、「当該親会社等保証特例適用先の親会社等（当該親会社等保証特例適用先のために親会社等保証を行う親会社等に限る。）のネットティング口座ごとの当初証拠金所要額の合計額」と読み替えるものとする。

- 4 親会社等保証特例適用先が複数のネットティング口座を開設している場合において、当該親会社等保証特例適用先の親会社等（当該親会社等保証特例適用先のために親会社等保証を行う親会社等に限る。）である清算参加者について第1項の規定を適用するときは、「当該親会社等保証特例適用先の当初証拠金所要額」とあるのは、「当該親会社等保証特例適用先のネットティング口座ごとの当初証拠金所要額の合計額」と読み替えるものとする。
- 5 前各項の規定にかかわらず、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は、業務方法書第28条第5項第1号に規定する当社が定める額は、次の各号に定める額のうち最大のものとする。
 - (1) 当該清算参加者の顧客に係るネットティング口座以外のネットティング口座ごとの当初証拠金所要額の合計額
 - (2) 当該清算参加者の顧客に係るネットティング口座ごとの当初証拠金所要額（一の顧客に係るネットティング口座が複数あるときは、当該顧客に係るネットティング口座ごとの当初証拠金所要額の合計額）のうち最大のもの
 - (3) 当該清算参加者のネットティング口座（当該清算参加者の属する企業集団（金融商品取引法第5条第1項第2号に規定する企業集団をいう。）に含まれない顧客に係るものを除く。）ごとの当初証拠金所要額の合計額を2で除した額
 - (4) 当該清算参加者のネットティング口座ごとの当初証拠金所要額の合計額を4で除した額
- 6 業務方法書第28条第5項第2号に規定する当社が定める数値は、1から国債店頭取引に係る当初証拠金所要額に関する規則別表第1項第2号（注）1.に定める時価変動リスクファクターのうち最大のものを100で除した値を差し引いた値とする。
- 7 業務方法書第28条第5項第2号に規定する当社が定める額は、当該清算参加者の信託口の当初証拠金所要額（複数の信託口を開設している清算参加者にあつては当該清算参加者の信託口の当初証拠金所要額の合計額）とする。

（債務の引受けの申込み等）

第10条 業務方法書第40条第1項、同第41条第1項、同第42条第1項、同第43

条第1項及び同第50条の3第1項に規定する当社が定める方法は、株式会社証券保管振替機構の決済照合システムを経由して行う方法とする。

(代理人の承認手続)

第11条 清算参加者は、業務方法書第40条第4項（同第41条第3項及び同第42条第6項の規定により準用される場合を含む。）、同第43条第3項、同50条の3第2項、同第50条の11第2項（同第51条第3項及び同第56条第2項の規定により準用される場合を含む。）、同第69条第2項（同第57条第2項、同第59条第2項、同第60条第2項、同第62条第2項及び同第63条第2項の規定により準用される場合を含む。以下この条において同じ。）及び同第70条の9に規定する代理人の承認を得ようとする場合には、当社が定める事項を記載した申請書を当社に提出し、当社の承認を得なければならない。この場合において、同第69条第2項及び同第70条の9に規定する金銭の授受の代理人は、銀行であることを要するものとする。

(証券決済債務時価評価額)

第12条 業務方法書第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及び同第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は、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に係る証券決済債務について、決済日等の日付で日本証券業協会が発表する売買参考統計値のうち当該銘柄に係る価格の平均値により評価した額（円位未満は切り捨てる。）に、決済日等までの日数に応じた経過利子（円位未満は切り捨てる。）を加算した額とする。

2 決済日等の日付で日本証券業協会から売買参考統計値が発表されない銘柄に係る前項に規定する価格については、当社がその都度定める。

(銘柄割当ての方法)

第12条の2 当社は、業務方法書第50条の4第1項の規定に基づき、当社が定めるところにより、国債証券の渡方清算参加者が当社に対して負担する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スタート/Rewind国債引渡債務（バスケット）及び当社が国債証券の受方清算参加者に対して負担する、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スタート/Rewind国債引渡債務（バスケット）について、両者が同一金額になるような国債証券の渡方清算参加者及び国債証券の受方清算参加者の組合せを設定し、当該組合せごとに各債務に対し、国債証券の渡方清算参加者が業務方法書第50条の3の規定により通知した国債証券の銘柄及び数量の範囲内で国債証券の時価評価額（当該国債証券を第12条に規定する方法により評価した額をいう。以下この条に

- において同じ。)が各債務の金額に相当するような国債証券の銘柄及び数量を割り当てる。
- 2 前項の規定にかかわらず、業務方法書第44条第2項第4号に規定する時刻に行う銘柄割当てに際しては、国債証券の渡方清算参加者が業務方法書第50条の3の規定により通知した国債証券の時価評価額がスタート/Rewind国債引渡債務(バスケット)の金額に満たない場合には、当社が定めるところにより、当該国債証券の渡方清算参加者が通知した国債証券及び数量の範囲外で国債証券の銘柄及び数量を割り当てる。
 - 3 当社は、前2項の規定によりスタート/Rewind国債引渡債務(バスケット)に対して割り当てた国債証券の銘柄及び数量を、当社が定めるところにより、当該スタート/Rewind国債引渡債務(バスケット)に対応する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エンド/Unwind国債引渡債務(バスケット)に対して割り当てる。
 - 4 複数のネットティング口座を開設している清算参加者について、第1項及び第2項の規定を適用する場合には、第1項及び第2項中「国債証券の渡方清算参加者が」とあるのは「国債証券の渡方清算参加者がネットティング口座ごとに」と、第1項中「国債証券の受方清算参加者に」とあるのは「国債証券の受方清算参加者にネットティング口座ごとに」と、同項中「同一金額になるような国債証券の渡方清算参加者」とあるのは「同一金額になるような国債証券の渡方清算参加者のネットティング口座」と、同項中「国債証券の受方清算参加者の組合せ」とあるのは「国債証券の受方清算参加者のネットティング口座の組合せ」と読み替えるものとする。
 - 5 清算参加者が信託口座を開設している場合には、第1項及び第2項の規定は、一のネットティング単位(ネットティング口座及び業務方法書第40条第2項第4号bに規定するネットテ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。)を一のネットティング口座とみなして適用する。
 - 6 前2項の規定にかかわらず当社が清算参加者の破綻等を認定した場合、当該破綻等の認定時点において当該破綻清算参加者が当社に対して負担していたスタート/Rewind国債引渡債務(バスケット)及び当社が当該破綻清算参加者に負担していたエンド/Unwind国債引渡債務(バスケット)のうち、国債店頭取引清算業務に関する清算参加者の破綻処理に関する規則第5条の3に規定するものについては、業務方法書第78条及び同第79条の規定にかかわらず、これらの債務が履行期限を変えずに存在しているものとみなして、前各項の規定により、生存清算参加者に対する銘柄割当てを行う。この場合において、当該破綻清算参加者が当社に対して負担していたスタート/Rewind国債引渡債務(バスケット)に対応する生存清算参加者に対する銘柄割当てに係る第1項及び第2項の規定の適用については、「国債証券の渡方清算参加者が業務方法書第50条の3の規定により通知した」とあるのは「当社がその都度定める」と、「当該国債証

券の渡方清算参加者が通知した」とあるのは「当社がその都度定める」とする。

(国債DVP決済の方法)

第13条 業務方法書第50条の11第1項及び第2項(同第51条第3項及び同第56条第2項の規定により準用される場合を含む。以下この条において同じ。)に規定する国債証券の授受は、振替法に基づき日本銀行に開設された口座の振替により行うものとし、この場合における国債資金同時受渡依頼及び決済指示(国債)は、次の各号に定めるところによる。

(1) 渡方清算参加者と当社との間の決済については、次のa又はbに掲げる清算対象取引の区分に応じ、当該a又はbに定めるところにより行う。

a 個別銘柄取引(銘柄後決め現先取引等に関して行うバイ・インによる売買を含む。)

(a) 渡方清算参加者の口座と当社の口座との間で振替を行う場合

渡方清算参加者が、日本銀行に対して国債資金同時受渡依頼及び決済指示(国債)を行う。

(b) 業務方法書第50条の11第2項に規定する代理人の口座と当社の口座との間で振替を行う場合

当該代理人が、日本銀行に対して国債資金同時受渡依頼及び決済指示(国債)を行う。この場合において、同第50条の11第2項に規定する承認を得た渡方清算参加者は、当該代理人に対し必要な指示を行うものとする。

b 銘柄後決め現先取引等

(a) 渡方清算参加者の口座と当社の口座との間で振替を行う場合

当社が、日本銀行に対して国債資金同時受渡依頼を行い、渡方清算参加者が、日本銀行に対して決済指示(国債)を行う。

(b) 業務方法書第50条の11第2項に規定する代理人の口座と当社の口座との間で振替を行う場合

当社が、日本銀行に対して国債資金同時受渡依頼を行い、当該代理人が、日本銀行に対して決済指示(国債)を行う。この場合において、同第50条の11第2項に規定する承認を得た渡方清算参加者は、当該代理人に対し必要な指示を行うものとする。

(2) 当社と受方清算参加者との間の決済については、当社が日本銀行に対して国債資金同時受渡依頼及び決済指示(国債)を行う。

2 業務方法書第50条の11に規定する金銭の授受は、次の各号に規定するところにより行うものとする。

(1) 金銭を支払う清算参加者は、日本銀行金融ネットワークシステムを利用した国

債資金同時受渡に伴う金銭の受払いを行うために日本銀行に設けられた当該清算参加者の当座勘定（業務方法書第50条の11第2項の定めるところにより代理人を通じて同条第1項に規定する金銭の授受を行う場合には、当該代理人の当座勘定）のうちから、当該清算参加者が指定した当座勘定（以下「指定当座勘定」という。）から、日本銀行に設けられた当社の当座勘定に振り替えるものとする。この場合における決済指示（資金）は、次のa又はbに規定するところにより行うものとする。

a 金銭を支払う清算参加者の当座勘定から振り替える場合

金銭を支払う清算参加者が、日本銀行に対して決済指示（資金）を行う。

b 代理人の当座勘定から振り替える場合

当該代理人が、日本銀行に対して決済指示（資金）を行う。この場合において、業務方法書第50条の11第2項に規定する承認を得た金銭を支払う清算参加者は、当該代理人に対し必要な指示を行うものとする。

(2) 金銭を受領する清算参加者は、指定当座勘定において受領するものとし、この場合における決済指示（資金）は当社が行う。

3 第1項に規定する国債資金同時受渡依頼は、当社が指定する数量及び金額ごとに行うものとする。この場合において、当社は、各国債資金同時受渡依頼に係る国債証券の額面総額が50億円を超えないように指定するものとする。

(国債先物ペアオフネッティングの成立)

第13条の2 当社は、業務方法書第50条の12第2項の規定に基づき、国債先物受渡決済（同条第1項に規定する国債先物受渡決済をいう。以下この条において同じ。）及び個別銘柄決済（同条第2項に規定する個別銘柄決済をいう。以下この条において同じ。）を対象として、それぞれ同額面相当額の国債証券について、当社が適当と認める数量に係る国債先物ペアオフネッティングの組合せを成立させる。

2 前項の国債先物ペアオフネッティングの組合せを成立させる国債証券は、国債先物受渡決済の受渡決済期日を決済日とする同一銘柄の国債先物受渡決済及び個別銘柄決済の決済予定が存在し、当社への引渡し又は当社からの受領の別が異なる清算参加者に係るものに限る。

3 第1項の国債先物ペアオフネッティングの組合せは、国債先物受渡決済及び個別銘柄決済それぞれにおいて、各ペアオフネッティング利用申請参加者について対象となる国債証券の額面相当額を合計したときに当社への引渡数量合計と当社からの受領数量合計が同一となるような組合せについて成立させる。

(フェイルチャージの計算式等)

第14条 業務方法書第52条第1項に規定する当社が定める金額は、次の計算式により算出した金額とする。

$$\sum_{\text{フェイル期間}} \frac{1}{365} \times \max(3\% - \text{参照レート}, 0) \times \text{受渡金額}$$

2 前項の計算式における用語の意味は、次の各号に定めるとおりとする。

(1) 参照レートは、日本銀行の金融市場調節の操作目標がマネタリーベースとされている間は0パーセントとする。この場合において、日本銀行の金融市場調節の操作目標がマネタリーベースから無担保コールレート（オーバーナイト物）に変更になった場合には、当該変更の日の翌日以降のフェイル期間について、各日の無担保コールレート（オーバーナイト物）の誘導目標（レンジの場合はその下限）（誘導目標が変更された場合における変更実施日については、その前日の誘導目標（レンジの場合はその下限））と、無担保コールレート（オーバーナイト物）以外の指標等に変更になった場合には、当該変更の日の翌日以降のフェイル期間について、当社が適当と認めるレートとする。

(2) 受渡金額とは、フェイルに係る決済の証券決済債務時価評価額をいう。

(3) フェイル期間とは、フェイルが発生した日（業務方法書第84条の2第1項又は同第84条の3の規定により当社が指定した決済にあつては、当該決済の当初の決済日等）から起算してフェイルが解消された日（業務方法書第84条の2第1項又は同第84条の3の規定により当社が指定した決済にあつては、第27条又は第28条に規定する日）の前日までの期間をいう。

3 当社は、毎月第10営業日までに、各清算参加者に係る前月のフェイルチャージの総支払金額と総受領額の差引額を当該清算参加者に通知する。

4 清算参加者は、前項の差引額を、当社が指定する期日に、当社との間で授受するものとする。

（利払期日が到来した場合に償還期日が到来したものとして取り扱う国債証券）

第15条 業務方法書第54条第1項及び同第70条の8第4項に規定する当社が定める国債証券は、分離利息振替国債とする。

（変動証拠金に係る現在価値）

第16条 業務方法書第65条第1項及び第2項に規定する清算対象取引に係る金銭の受領額又は支払額の現在価値は、次の各号に掲げる清算対象取引の区分に応じて、当該各号に定めるところにより算出された額の合計額とする。

(1) 国債証券の売買等

決済日等（計算日（変動証拠金の算出を行う日をいう。以下本条及び第19条において同じ。）から起算して3日目（休業日を除外する。）の日以降に到来するものに限る。以下この条において同じ。）及び銘柄ごとの国債証券の売買等に係る金銭の受領額と支払額の差引額（レギュラー受渡日（計算日の翌日をいう。以下同じ。）が当該銘柄の利払期日（計算日以降最初に到来するものに限る。休業日に当たるときは、順次繰り下げる。以下同じ。）の前日までに到来する場合においては、決済日等が当該利払期日以降に到来する国債証券の売買等に係る金銭の受領額に当該銘柄に係る利金相当額を加算した額と支払額に当該銘柄に係る利金相当額を加算した額の差引額）について、それぞれ、決済日等及び銘柄ごとに当社が定める割引率を使用して算出した、レギュラー受渡日における現在価値を、受領又は支払いの別ごとに合算した額

(2) 現金担保付債券貸借取引等及び銘柄先決め現先取引等

決済日等及び銘柄ごとの現金担保付債券貸借取引等及び銘柄先決め現先取引等に係る金銭の受領額と支払額の差引額について、それぞれ、決済日等及び銘柄ごとに当社が定める割引率を使用して算出した、レギュラー受渡日における現在価値（レギュラー受渡日が利払期日に到来する場合においては、現金担保付債券貸借取引等及び現先取引等に係る金銭の受領額の現在価値から利金相当額を減じた額と、支払額の現在価値から利金相当額を減じた額の差引額）を、受領又は支払いの別ごとに合算した額

(3) 銘柄後決め現先取引等

決済日等及びバスケットごとの銘柄後決め現先取引等に係るエンド受渡金額の受領額と支払額の差引額について、それぞれ、決済日等及びバスケットごとに当社が定める割引率を使用して算出した、レギュラー受渡日における現在価値を、受領又は支払いの別ごとに合算した額

(フェイルに係る現在価値)

第17条 業務方法書第66条第1項及び第2項に規定するフェイルに係る金銭の受領額又は支払額の現在価値は、銘柄ごとに算出したフェイルに係る金銭の受領額と支払額の差引額について、それぞれ、計算日（当該差引額の算出を行う日をいう。以下本条において同じ。）の翌日をフェイルの場合における決済日として、銘柄ごとに当社が定める割引率を使用して算出した、レギュラー受渡日における現在価値（レギュラー受渡日が利払期日に到来する場合においては、フェイルに係る金銭の受領額の現在価値から利金相当額を減じた額と、フェイルに係る金銭の支払額の現在価値から利金相当額を減じた額の差引額）を、受領又は支払いの別ごとに合算した額とする。

(現在価値の算出に使用する割引率)

第18条 前2条の現在価値の算出における当社が定める割引率は、日本証券業協会から公表される東京レポ・レート（レファレンス先平均値）をもとに当社が定める割引率とする。ただし、当社が必要と認めるときは、当社がその都度定める割引率とする。

（変動証拠金に係る時価評価額）

第19条 業務方法書第65条第1項及び第2項に規定する清算対象取引に係る国債証券の受領数量又は引渡数量の時価評価額は、次の各号に掲げる清算対象取引の区分に応じ、当該各号に定めるところにより算出された額の合計額とする。

（1） 個別銘柄取引

計算日から起算して3日目（休業日を除外する。）以降の日を決済日等とする銘柄ごとの受領数量又は引渡数量について、計算日翌日付で日本証券業協会が発表する売買参考統計値のうち当該銘柄に係る価格の平均値（当該銘柄が変動利付国債又は物価連動国債以外の場合であって、当該銘柄の発行日が計算日から起算して3日目（休業日を除外する。）以降の日であるときは、当該銘柄に係る利回りの平均値により、決済日等を基準として算出する価格）により評価した額（円位未満は切り捨てる。）に、計算日の翌日までの日数（当該銘柄が変動利付国債又は物価連動国債以外の場合であって、当該銘柄の発行日が計算日から起算して3日目（休業日を除外する。）以降の日であるときは、決済日等までの日数）に応じた経過利子（円位未満は切り捨てる。）を加算した額を受領又は引渡しの別ごとに合算した額

（2） 銘柄後決め現先取引等

計算日の翌日を決済日等とするバスケットごとのR e w i n d 金銭支払債務に係る金銭の受領額又は支払額を受領又は支払いの別ごとに合算した額

- 2 業務方法書第66条第1項及び第2項に規定するフェイルに係る国債証券の受領数量又は引渡数量の時価評価額は、銘柄ごとの受領数量又は引渡数量について、計算日翌日付で日本証券業協会が発表する売買参考統計値のうち当該銘柄に係る価格の平均値により評価した額（円位未満は切り捨てる。）に、計算日の翌日までの日数に応じた経過利子（円位未満は切り捨てる。）を加算した額を受領又は引渡しの別ごとに合算した額とする。
- 3 計算日翌日付で日本証券業協会から売買参考統計値が発表されない銘柄に係る前2項に規定する価格については、当社がその都度定める。

（変動証拠金に付す利息の利率）

第20条 業務方法書第67条第1項及び第2項に規定する当社が定める利率は、返還を行う日の前日に日本銀行が公表する無担保コールオーバーナイト物レートの加重平均値をもとに当社が定めるレートとする。ただし、当社が必要と認めるときは、当社がその

都度定めるレートとする。

(FOS決済の方法)

第21条 業務方法書第69条第1項及び第2項(同第57条第2項、同第59条第2項、同第60条第2項、同第62条第2項及び同第63条第2項の規定により準用される場合を含む。以下この条において同じ。)に規定する金銭の受払いは、次の各号に規定するところにより行うものとする。

- (1) 金銭を支払う清算参加者は、当該清算参加者の当座勘定(業務方法書第69条第2項の定めるところにより代理人を通じて同条第1項に規定する金銭の授受を行う場合には、当該代理人の当座勘定)のうちから当該清算参加者が指定した当座勘定から、当社の当座勘定に振り替えるものとする。
- (2) 金銭を受領する清算参加者は、前号の規定により指定した当座勘定において受領するものとする。

(当初証拠金の追加預託時限)

第21条の2 業務方法書第70条第2項に規定する当初証拠金の追加預託は、次の各号に掲げる当初証拠金の区分に応じ、次の各号に定める時限までに行われるものとする。

- (1) 国債店頭取引に係る当初証拠金所要額に関する規則第2条第2項に規定する一回目算出証拠金所要額に係るもの 業務方法書第70条第2項に規定する不足額が生じた日(以下「不足額発生日」という。)の午前10時
- (2) 国債店頭取引に係る当初証拠金所要額に関する規則第2条第2項に規定する二回目算出証拠金所要額に係るもの 不足額発生日の午後2時
- (3) 国債店頭取引に係る当初証拠金所要額に関する規則第2条第2項に規定する三回目算出証拠金所要額に係るもの 不足額発生日の午後4時30分

(国債店頭取引清算基金の追加預託時限)

第21条の3 業務方法書第70条の5第2項に規定する国債店頭取引清算基金の追加預託は、同項に規定する不足が生じた日の午後4時30分までに行われるものとする。

(当初証拠金及び国債店頭取引清算基金の金銭の預託方法)

第22条 業務方法書第15条、同第70条及び同第70条の5に規定する金銭の預託は、日本銀行当座預金取引における清算参加者の当座勘定(同第70条の9の定めるところにより代理人を通じて同第70条、同第70条の4第1項及び同第70条の5に規定する金銭の預託を行う場合には、当該代理人の当座勘定。以下この条において同じ。)から

当社の当座勘定への振替により行うものとする。

- 2 前項の定めるところにより預託された金銭に係る業務方法書第70条の3第1項及び同第70条の7に規定する返還は、日本銀行当座預金取引における当社の当座勘定から清算参加者の当座勘定への振替により行うものとする。

(緊急当初証拠金による当初証拠金所要額の変更の取扱い)

第23条 業務方法書第70条の4第1項に規定する当社が定める基準は、長期国債先物取引（株式会社大阪取引所（以下「大阪取引所」という。）が定める長期国債標準物に関す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。以下同じ。）のうち中心限月取引（最も流動性が高いものとして当社が定める限月取引をいう。）について、午前立会終了時の約定値段と前日の午後立会終了時の約定値段との差が、当社があらかじめ定めた数値を超えた場合とする。

- 2 業務方法書第70条の4第1項に規定する当初証拠金所要額の引上げは、各清算参加者の国債店頭取引に係る当初証拠金所要額に関する規則第2条第2項に規定する二回目算出証拠金所要額及び三回目算出証拠金所要額（親会社等保証特例適用先にあつては、当該親会社等保証特例適用先の当初証拠金所要額に当該親会社等保証特例適用先の親会社等（当該親会社等保証特例適用先のために親会社等保証を行う親会社等に限る。以下本項において同じ。）の当初証拠金所要額を加算した額、親会社等保証特例適用先の親会社等である清算参加者にあつては、当該親会社等である清算参加者の当初証拠金所要額に当該親会社等保証特例適用先の当初証拠金所要額を加算した額）を、当社が定める方法により行う。
- 3 複数のネットティング口座を開設している清算参加者について、前項の規定を適用する場合には、「親会社等保証特例適用先の当初証拠金所要額」とあるのは「親会社等保証特例適用先のネットティング口座ごとの当初証拠金所要額の合計額」と、「当該親会社等である清算参加者の当初証拠金所要額」とあるのは「当該親会社等である清算参加者のネットティング口座ごとの当初証拠金所要額の合計額」と読み替えるものとする。
- 4 親会社等保証特例適用先の親会社等（当該親会社等保証特例適用先のために親会社等保証を行う親会社等に限る。）が複数のネットティング口座を開設している場合において、当該親会社等保証特例適用先について第2項の規定を適用するときは、「当該親会社等保証特例適用先の親会社等（当該親会社等保証特例適用先のために親会社等保証を行う親会社等に限る。以下本項において同じ。）の当初証拠金所要額」とあるのは「当該親会社等保証特例適用先の親会社等（当該親会社等保証特例適用先のために親会社等保証を行う親会社等に限る。以下本項において同じ。）のネットティング口座ごとの当初証拠金所要額の合計額」と読み替えるものとする。

- 5 親会社等保証特例適用先が複数のネットィング口座を開設している場合において、当該親会社等保証特例適用先の親会社等（当該親会社等保証特例適用先のために親会社等保証を行う親会社等に限る。）である清算参加者について第2項の規定を適用するときは、「当該親会社等保証特例適用先の当初証拠金所要額」とあるのは「当該親会社等保証特例適用先のネットィング口座ごとの当初証拠金所要額の合計額」と読み替えるものとする。
- 6 業務方法書第70条の4第2項に規定する当社が定める時刻は、大阪取引所における長期国債先物取引の午前立会終了時とする。

（代用国債証券の取扱い）

第24条 業務方法書第70条の8第1項に規定する当社が定める額は、5億円とする。

- 2 業務方法書第70条の8第1項に規定する国債証券の預託は、振替法に基づき日本銀行に設けられた清算参加者の口座（第70条の9の定めるところにより代理人を通じて代用国債証券の預託を行う場合には、当該代理人の口座。以下この条において同じ。）から当社の口座への振替により行うものとする。
- 3 前項の定めるところにより預託された国債証券に係る業務方法書第70条の3第1項及び第70条の7に規定する返還は、振替法に基づき日本銀行に設けられた当社の口座から清算参加者の口座への振替により行うものとする。
- 4 業務方法書第70条の8第1項に規定する当社が定めるものは、第2条第1項に規定する国債証券とする。
- 5 業務方法書第70条の8第2項に規定する当社が定める時価は、預託日の日付で日本証券業協会が発表する売買参考統計値のうち当該銘柄に係る価格の平均値とし、当社が定める率については、次の各号に掲げる国債証券の区分に従い、当該各号に定めるとおりとする。

（1） 利付国債及び割引国債（変動利付国債、物価連動国債、分離元本振替国債及び分離利息振替国債を除く。）

a 残存期間1年以内のもの	100分の99
b 残存期間1年超5年以内のもの	100分の98
c 残存期間5年超10年以内のもの	100分の98
d 残存期間10年超20年以内のもの	100分の96
e 残存期間20年超30年以内のもの	100分の93
f 残存期間30年超のもの	100分の92

（2） 変動利付国債

a 残存期間1年以内のもの	100分の99
---------------	---------

- | | |
|------------------------|---------|
| b 残存期間1年超5年以内のもの | 100分の99 |
| c 残存期間5年超10年以内のもの | 100分の99 |
| d 残存期間10年超20年以内のもの | 100分の99 |
| (3) 物価連動国債 | |
| a 残存期間1年以内のもの | 100分の99 |
| b 残存期間1年超5年以内のもの | 100分の98 |
| c 残存期間5年超10年以内のもの | 100分の97 |
| d 残存期間10年超20年以内のもの | 100分の97 |
| e 残存期間20年超30年以内のもの | 100分の97 |
| f 残存期間30年超のもの | 100分の97 |
| (4) 分離元本振替国債及び分離利息振替国債 | |
| a 残存期間1年以内のもの | 100分の99 |
| b 残存期間1年超5年以内のもの | 100分の98 |
| c 残存期間5年超10年以内のもの | 100分の97 |
| d 残存期間10年超20年以内のもの | 100分の96 |
| e 残存期間20年超30年以内のもの | 100分の93 |
| f 残存期間30年超のもの | 100分の91 |
| (5) 国庫短期証券 | 100分の99 |
- 6 前項に規定する時価がない銘柄の時価及び時価に乗すべき率については、当社がその都度定める。
- 7 代用国債証券の評価額は、当該国債証券について、業務方法書第70条の8第2項に規定する代用価格により評価した額（円位未満は切り捨てる。）に、預託日までの日数に応じた経過利子（円位未満は切り捨てる。）を加算した額とする。

(決済不履行時の資金調達の取扱い)

第25条 業務方法書第74条第2項の規定により当社が調達する額の割当ては、次の各号に掲げる場合の区分に従い、当該各号に定めるところにより行うものとする。

- (1) 当社が調達する額が、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及び基礎負担額が0円である清算参加者以外の清算参加者（以下この条において「割当対象清算参加者」という。）の基礎負担額の合計額以下である場合

当社は、次のaからcまでに定める方法により割当てを行う。

- a 割当対象清算参加者に対し、当社が調達する額を平均当初証拠金所要額の大きい割当対象清算参加者から順に50億円を割り当てる。ただし、当社が調達する額が50億円に満たない場合の第一順位の割当対象清算参加者又は前順位の割当対象清

算参加者まで割り当てた後の残額が50億円に満たない割当対象清算参加者については、当該当社が調達する額又は当該残額を割り当てる。

b 前aの割当ての総額が当社が調達する額に満たない場合は、その残額を平均当初証拠金所要額の大きい割当対象清算参加者から順に各割当対象清算参加者の基礎負担額から割当て済みの額を差し引いた額又は50億円（前順位の割当対象清算参加者まで割り当てた後の残額が50億円に満たない場合には、当該残額）のいずれか小さい額を割り当てる。

c a及び前bの割当ての総額が当社が調達する額に満たない場合は、その残額が0となるまで前bの割当てを繰り返す。

(2) 当社が調達する額が、割当対象清算参加者の基礎負担額の合計額を超過する場合

当社は、割当対象清算参加者に対し、当社が調達する額を、割当対象清算参加者の基礎負担額の合計額のうち各割当対象清算参加者の基礎負担額が占める割合に応じて按分する（1億円未満の端数があるときは、これを1億円に切り上げる。）。

(3) 割当対象清算参加者が当社が定める割当てに係る届出を行っている場合

前2号の規定にかかわらず割当対象清算参加者が届け出た金額を割り当てる。届出を行っていない割当対象清算参加者においては当社が調達する額から当該割当金額を控除した金額を、前2号の規定に基づき割り当てる。ただし、割当対象清算参加者が届け出た金額が、前2号の定めるところにより割り当てる金額よりも小さい場合には当該届出を行っていないものとみなして割り当てる。

2 前項に規定する基礎負担額及び平均当初証拠金所要額とは、次の各号に定めるところにより算定される額とする。

(1) 基礎負担額

各清算参加者の平均当初証拠金所要額に基礎負担倍率を乗じて得た額が0円の場合は0円、0円を超え50億円以下の場合は50億円、50億円を超える場合は当該額の50億円未満の端数を切り捨てた額とする。

(2) 平均当初証拠金所要額

各清算参加者の過去120日間（休業日を除外する。）の日々の国債店頭取引に係る当初証拠金所要額に関する規則第2条第2項に規定する一回目算出証拠金所要額の平均額（円位未満は切り捨てる。）とする。

3 基礎負担額及び平均当初証拠金所要額は、毎年3月、6月、9月及び12月の最終営業日を基準として前項の規定に従い当社が算定し、それぞれ翌月の第10営業日から適用する。ただし、清算資格の取得又は喪失があった場合、清算参加者が合併した場合その他当社が必要と認める場合は、当社が適当と認める方法により算定した数値を当社が

適当と認める日から適用することができる。

4 この条において、次の各号に掲げる用語の意義は、当該各号に定めるところによる。

(1) 基礎負担倍率

基準調達額を第1項第1号に規定する方法に準じて各清算参加者に割り当てた場合に平均当初証拠金所要額の大きい順に上位20先の清算参加者に対する割当額が同一となるときの当該割当額を、当該20先のうち平均当初証拠金所要額が最低である清算参加者の平均当初証拠金所要額で除して得た数値をもとに当社が定める数値をいう。

(2) 基準調達額

清算参加者及び清算参加者グループごとの最大調達額から、業務方法書第74条第1項に規定する方法による資金調達想定額を減じて得た額の過去250日間（休業日を除外する。）における97.72%カバー最小値（対象となるすべての数値のうち、一の数値以下であるものの個数の占める割合が、100分の97.72以上となる場合の当該一の数値のうち最小のものをいう。）に相当する額をもとに当社が定める額をいう。

(3) 最大調達額

次のaからcまでに定める額をいう。

- a 各清算参加者について、一の日当該清算参加者の決済不履行が発生したと仮定した場合において当該決済不履行の発生日から起算して3日間（休業日を除外する。）における各日の当該清算参加者が履行すべき債務（信託口に関し履行すべき債務を除く。）の履行のために資金調達を要することとなる額のうち最大のもの
- b 清算参加者グループについて、一の日当該清算参加者グループに属するいずれかの清算参加者の決済不履行が発生したと仮定した場合において当該決済不履行の発生日から起算して3日間（休業日を除外する。）における各日の当該清算参加者グループに属する全清算参加者が履行すべき債務（信託口に関し履行すべき債務を除く。）の履行のために資金調達を要することとなる額のうち最大のもの
- c 各清算参加者（信託口を有する清算参加者に限る。）について、一の日当該清算参加者の決済不履行が発生したと仮定した場合において当該決済不履行の発生日から起算して3日間（休業日を除外する。）における各日の当該清算参加者が履行すべき債務（信託口に関し履行すべき債務に限る。）の履行のために資金調達を要することとなる額のうち最大のもの

(4) 清算参加者グループ

清算参加者に関係会社等（ある会社の子会社及び関連会社並びに当該ある会社の親会社、当該親会社の子会社及び当該親会社の関連会社をいう。）に該当する他の清算参加者が存在する場合における、当該清算参加者及び当該他の清算参加者をいう。

(国債証券引渡返還債務の評価に使用する時価総額)

第26条 業務方法書第79条第2項第2号a (b) 及びb (b) に規定する当社が定める時価総額は、当該国債証券引渡返還債務を一括清算事由が発生した日から起算して3日目(休業日を除外する。)の日付で日本証券業協会が発表する売買参考統計値のうち当該銘柄に係る価格の平均値に、一括清算事由が発生した日から起算して3日目(休業日を除外する。)の日までの日数に応じた経過利子(円位未満は切り捨てる。)を加算した価格により評価した額の合計額をいう。

- 2 一括清算事由が発生した日から起算して3日目(休業日を除外する。)の日付で日本証券業協会から売買参考統計値が発表されない銘柄に係る前項に規定する価格については、当社がその都度定める。

(破綻等の認定を行った場合のフェイルの取扱い)

第27条 業務方法書第84条の2第1項に規定する当社が定める日は、次の各号に掲げる場合に依りて、当該各号に定める日とする。

- (1) 当初の決済日等が当該渡方清算参加者に係る破綻認定日又は破綻認定日の翌日である場合

当該渡方清算参加者の破綻等を認定した時点で当該渡方清算参加者が負担していた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(これらの債務に関し当該時点において発生しているフェイルに係るものを含む。以下この条において「破綻等証券決済債務」という。)を破綻処理対象ポジションとする第一段階破綻処理入札又は第二段階破綻処理入札により成立した入札対象取引の決済が行われる日。

- (2) 当初の決済日等が渡方清算参加者に係る破綻認定日から起算して3日目(休業日を除外する。)の日である場合(破綻等証券決済債務が第二段階破綻処理入札の破綻処理対象ポジションである場合に限る。

破綻等証券決済債務を破綻処理対象ポジションとする第二段階破綻処理入札により成立した入札対象取引の決済が行われる日。

- 2 前項の規定にかかわらず、業務方法書第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る場合には、同第84条の2第1項に規定する当社が定める日は、当該未決済ポジションの一括清算が行われる日とする。

- 3 前2項の規定にかかわらず、次の各号に掲げる場合は、業務方法書第84条の2第1項に規定する当社が定める日は、当該各号に定める日とする。

- (1) 当初の決済日等が当該渡方清算参加者に係る破綻認定日から起算して2日間(休

業日を除外する。)のいずれかの日であって、対象銘柄の償還期日が破綻認定日から起算して3日目(休業日を除外する。)の日である場合

破綻認定日から起算して3日目(休業日を除外する。)の日

(2) 当初の決済日等が当該渡方清算参加者に係る破綻認定日から起算して3日間(休業日を除外する。)のいずれかの日であって、対象銘柄の償還期日が破綻認定日から起算して4日目(休業日を除外する。)の日である場合(破綻等証券決済債務に係る第一段階破綻処理入札において不成立となった場合に限る。)

破綻認定日から起算して4日目(休業日を除外する。)の日

(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28条 業務方法書第84条の3に規定する当社が定める日は、同第80条の7第2項に規定する決済について、当社が国債証券を受領する日とする。

2 前項の規定にかかわらず、業務方法書第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る場合には、同第84条の3に規定する当社が定める日は、当該未決済ポジションの一括清算が行われる日とする。

第29条 削除

(ネットイング口座の開設に係る届出)

第30条 業務方法書第86条第3項に規定する届出は、所定の届出書に当社が必要と認める書類を添付して行うものとする。

(ネットイング口座の追加等の申請)

第31条 業務方法書第87条第2項に規定する申請及び同第88条第1項に規定する申請は、所定の申請書に当社が必要と認める書類を添付して行うものとする。

(当初証拠金グループに係る届出)

第32条 業務方法書第90条第4項に規定する当初証拠金グループの設定及び設定の解除の届出は、所定の届出書に当社が必要と認める書類を添付して行うものとする。

(当初証拠金グループを設定している清算参加者の特例)

第33条 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9条及び第23条の規定は、一の当初証拠金グループを一のネットイング口座とみなして適用する。

付 則

- 1 この規則は、平成25年10月1日から施行する。ただし、第5条の規定は平成26年10月1日から、第32条及び第33条の規定は当社が別に定める日から施行する。
- 2 この規則の施行の日（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10号bの規定の適用については、同（a）中「4.5パーセント」とあるのは「3.5パーセント」と、同（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10号bの規定の適用については、同（a）中「4.5パーセント」とあるのは「4パーセント」と、同（b）中「6パーセント」とあるのは「5.5パーセント」とする。
- 4 当社は、施行日に、施行日の前日における株式会社日本国債清算機関の株主資本から、同社の同日における資本金、資本準備金及び利益準備金を差し引いた額を国債店頭取引決済保証準備金として積み立てる。

（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25年11月25日から施行する。

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

この改正規定は、平成26年8月25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

この改正規定は、平成26年11月25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11月29日。

付 則

この改正規定は、平成27年5月25日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成27年5月29日から施行する。

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11条及び第13条第1項の改正規定（「第4項」を「第3項」に改正する部分に限る。）は、平成27年10月14日から、第2条第1項第1号の改正規定は、平成28年1月1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

この改正規定は、平成27年11月24日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成28年5月23日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成28年11月28日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成29年2月27日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成29年4月1日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成29年5月29日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成29年8月28日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成29年11月27日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成30年2月26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 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。
- 3 国債店頭取引清算参加者契約書（平成25年10月1日施行）は、この改正規定施行

の日に廃止する。

付 則

この改正規定は、平成30年5月28日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成30年8月27日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成30年11月26日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成31年2月25日から施行する。

付 則

この改正規定は、令和元年5月1日から施行する。

付 則

この改正規定は、令和2年6月1日から施行する。

付 則

この改正規定は、令和2年8月24日から施行する。

付 則

この改正規定は、令和2年11月24日から施行する。

付 則

この改正規定は、令和3年1月14日から施行する。

付 則

この改正規定は、令和3年5月24日から施行する。

付 則

この改正規定は、令和3年8月30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

この改正規定は、令和4年2月21日から施行する。

付 則

この改正規定は、令和4年5月23日から施行する。

付 則

この改正規定は、令和4年8月22日から施行する。

付 則

この改正規定は、令和4年11月21日から施行する。

付 則

この改正規定は、令和5年2月13日から施行する。

付 則

この改正規定は、令和5年5月23日から施行する。

付 則

この改正規定は、令和5年11月20日から施行する。

付 則

- 1 この改正規定は、令和5年12月18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5年12月18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6年4月1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6年4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。

様式第 1 号 保証に関する書面の様式

保 証 書

年 月 日

株式会社日本証券クリアリング機構
代表取締役社長 殿

所 在 地

商号 又は 名称

代表者名

印

当（以下「当法人」といいます。）は、貴社の定めた国債店頭取引清算業務に関する業務方法書（以下「業務方法書」といいます。）に基づき、あらかじめ本業務方法書等の内容を確認及び了承のうえ、（以下「本清算参加者」といいます。）を經由して、この保証書（以下「本保証書」といいます。）を貴社に提出します。

なお、本保証書において使用する用語は、本保証書に別段の定めがある場合を除くほか、業務方法書において使用される用語の例によるものとします。

1. 当法人は、本清算参加者の親会社等に該当します。
2. 当法人は、貴社に対し、貴社の国債店頭取引清算業務に関する本清算参加者の貴社に対する現在又は将来の一切の債務（本清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づく債務を含みますが、これに限られません。）を、本清算参加者と連帯して保証します。
3. 当法人は、貴社が、業務方法書第 20 条の規定（同条が業務方法書の定めるところにより変更された場合には、当該変更後の条項）により、当法人に関する事項に関し、本清算参加者に報告若しくは資料の提出を求め、又は検査をする場合には、本清算参加者による報告若しくは資料の提出又は貴社による検査に協力します。
4. 本保証書は日本法に準拠し、日本法に従って解釈されるものとします。

5. 当法人は、本保証書に関して、貴社及び当法人の間で訴訟の必要が生じた場合には、東京地方裁判所を第一審の専属的合意管轄裁判所とすることに合意します。

以 上

様式第2号 清算参加者契約に関する書面の様式

国債店頭取引清算参加者契約書

年 月 日

株式会社日本証券クリアリング機構
代表取締役社長 殿

所在地

商号 又は 名称

代表者名

印

当__は、株式会社日本証券クリアリング機構（以下「貴社」という。）の清算参加者として、次の事項を承諾します。

1. 貴社が現に制定している及び将来制定又は改正することのある国債店頭取引清算業務に関する業務方法書その他の規則（以下「規則」という。）及び貴社が定める国債店頭取引清算業務の業務処理の方法に従い、また、これを遵守すること。
2. 規則に基づいて貴社が行う、国債店頭取引清算資格の取消し、債務引受けの停止その他の措置に従うこと。
3. 当__が国債店頭取引清算資格を喪失する場合は、その喪失について当__が一切の責任を負い、貴社、他の清算参加者及び顧客に対し、一切迷惑をかけないこと。
4. 貴社からこの契約の内容の変更について通知された場合で、当__が所定の期日までに異議の申出をしないときは、その変更に同意したものとすること。
5. 当__と貴社との間の諸通知（授受する書類を含む。）は日本語で作成し、金額の表示については本邦通貨で表示したものにより行うこと。

以 上