国債店頭取引清算基金所要額に関する規則

（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。）第７０条の６の規定に基づき、国債店頭取引清算基金所要額に関する事項を定める。

（国債店頭取引清算基金所要額）

第２条　各清算参加者の国債店頭取引清算基金所要額は、清算参加者ごとに毎営業日、別表「国債店頭取引清算基金所要額の算出に関する表」により算出される額（以下「国債店頭取引清算基金基礎所要額」という。）と１０００万円のいずれか大きい額とする。ただし、当社は、清算参加者が合併する場合その他当社が必要と認める場合は、国債店頭取引清算基金所要額を臨時に変更することができる。

２　前項の規定にかかわらず、新たに清算資格を取得した者の国債店頭取引清算基金所要額は、別表「国債店頭取引清算基金所要額の算出に関する表」第２項に規定する担保超過リスク額が上位である清算参加者２社の担保超過リスク額の合計額に、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３項の規定に基づき当社が定める当初証拠金所要額の全清算参加者の当初証拠金所要額の合計額に占める比率を乗じた額を勘案のうえ、当社がその都度定める額とし、当社が必要と認める期間これを適用する。

（複数のネッティング口座を開設している清算参加者の特例）

第３条　複数のネッティング口座を開設している清算参加者について、前条の規定を適用する場合には、同条中「各清算参加者の」とあるのは「各清算参加者のネッティング口座ごとの」と、「清算参加者ごとに」とあるのは「清算参加者のネッティング口座ごとに」と、それぞれ読み替えるものとする。

２　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、一の当初証拠金グループを一のネッティング口座とみなしてこの規則を適用する。

付　　則

１　この規則は、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、この規則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、この規則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。

付　　則

この改正規定は、平成３１年４月１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。

別表

国債店頭取引清算基金所要額の算出に関する表

１　各清算参加者の国債店頭取引清算基金基礎所要額は、算出日（国債店頭取引清算基金基礎所要額の算出を行う日をいう。以下同じ。）におけるストレス時想定損失負担額とする。

２　前項に規定するストレス時想定損失負担額は、算出日における担保超過リスク額（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。以下同じ。）に該当する他の清算参加者が存在する場合には、当該他の清算参加者の担保超過リスク額を合計した額）が上位である清算参加者２社の担保超過リスク額の合計額又は算出日から起算して過去１２０日間（休業日を除外する。）の各日における担保超過リスク額（清算参加者に関係会社等に該当する他の清算参加者が存在する場合には、当該他の清算参加者の担保超過リスク額を合計した額）が上位である清算参加者２社の担保超過リスク額の合計額の平均の額のいずれか大きい額を、当該算出日に算出された第１項の各清算参加者の一回目算出証拠金所要額（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をいう。以下同じ。）に応じて按分した額とする。なお、本項において「担保超過リスク額」とは、当該各清算参加者の算出日又は算出日から起算して過去１２０日間（休業日を除外する。）の各日の午前７時の時点における未決済約定に係るストレス時リスク相当額（清算対象銘柄に係るイールドカーブの極端な変動により、当該未決済約定から当該各清算参加者に生じ得る損失に相当する額のうち最大のものにフェイルチャージ及び業務方法書第７４条に規定する資金調達に係る費用に関し当該清算参加者に生じ得る損失に相当する額を加えた額をいい、当社が通知により定める方法により算出するものをいう。）から当該各清算参加者の当該日に計算された一回目算出証拠金所要額又は当該算出日の午前７時の時点において当該各清算参加者が当社に預託している当初証拠金のいずれか小さい額を差し引いた額（当該額が負数となる場合は、０とする。）をいう。

３　複数のネッティング口座を開設している清算参加者について、第１項の規定を適用する場合には、同項中「各清算参加者の」とあるのは「各清算参加者のネッティング口座ごとの」と、前項の規定を適用する場合には、同項中「各清算参加者の一回目算出証拠金所要額」とあるのは「各清算参加者のネッティング口座ごとの一回目算出証拠金所要額」と、それぞれ読み替えるものとする。

４　第２項の規定にかかわらず、信託口を有する清算参加者の担保超過リスク額を算出する場合には、信託口と信託口以外のネッティング口座とを区分して算出するものとする。

この場合において、当該清算参加者の信託口に係る担保超過リスク額には、当該清算参加者の信託口以外のネッティング口座に係る担保超過リスク額及び当該清算参加者に関係会社等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他の清算参加者の担保超過リスク額を合算しないものとし、当該清算参加者の信託口以外のネッティング口座に係る担保超過リスク額には、当該清算参加者の信託口に係る担保超過リスク額及び当該清算参加者に関係会社等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他の清算参加者の信託口に係る担保超過リスク額を合算しないものとする。

５　第２項の規定にかかわらず、信託口を有しない清算参加者の担保超過リスク額には、当該清算参加者に関係会社等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他の清算参加者の信託口に係る担保超過額を合算しないものとする。