

新日銀ネットの稼働等に伴う国債店頭取引清算業務に関する 業務方法書等の一部改正について

I. 改正趣旨

平成27年10月13日予定の新日銀ネットの稼働に伴い、国債店頭取引清算業務に関する業務方法書等について、所要の制度改正を行う。

また、義務付け調達制度における資金調達必要額の変化に対応するため基礎負担額等の算定頻度を現在の年2回から年4回に変更すべく、所要の制度改正を行う。

II. 改正概要

(備考)

1. 新日銀ネットの稼働に伴う対応

(1) 振替停止期間の廃止に伴う決済日等の変更

・新日銀ネットにおいて利払期日前の振替停止期間が廃止されることに伴い、フェイルに係る決済はフェイル発生日の翌日以降の日
に一律繰り延べることとするなど、所要の改正を行う。

・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51条等

(2) 国債DVP決済に係るデータ入力方法の変更

・新日銀ネットにおいて国債DVP決済に係るデータ入力方法が変更になることに伴い、所要の改正を行う。

・国債店頭取引清算業務に関する業務方法書の取扱い（以下「業務方法書の取扱い」という。）第13条

2. 義務付け調達に係る基礎負担額等の算定頻度の見直し

・義務付け調達に係る基礎負担額及び平均当初証拠金所要額の算定頻度を現在の年2回から四半期ごとの年4回（3月、6月、9月、12月の最終営業日を基準として算出し、翌月の第10営業日から適用）に変更する。

・業務方法書の取扱い第25条第3項

3. その他

・その他、所要の改正を行う。

III. 施行日

1. 平成27年10月13日から施行する。ただし、業務方法書第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項並びに業務方法書の取扱い第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、業務方法書の取扱い第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。

以 上

国債店頭取引清算業務に関する業務方法書等の一部改正新旧対照表

目 次

1. 国債店頭取引清算業務に関する業務方法書の一部改正新旧対照表
2. 国債店頭取引清算業務に関する業務方法書の取扱いの一部改正新旧対照表
3. 国債店頭取引に係る当初証拠金所要額に関する規則の一部改正新旧対照表

国債店頭取引清算業務に関する業務方法書の一部改正新旧対照表

新	旧
<p>(国債店頭取引清算資格の取得手続の履行)</p> <p>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。<u>第53条及び第54条第1項を除き</u>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。</p> <p>2・3 (略)</p>	<p>(国債店頭取引清算資格の取得手続の履行)</p> <p>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。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。</p> <p>2・3 (略)</p>
<p>(国債店頭取引清算資格の喪失)</p> <p>第23条 清算参加者が<u>第21条</u>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（清算参加者について破綻等（第77条の2に規定する破綻等をいう。以下この条において同じ。）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（第77条の2に規定する破綻認定日をいう。以下この条において同じ。）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</p>	<p>(国債店頭取引清算資格の喪失)</p> <p>第23条 清算参加者が<u>前条</u>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（清算参加者について破綻等（第77条の2に規定する破綻等をいう。以下この条において同じ。）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（第77条の2に規定する破綻認定日をいう。以下この条において同じ。）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</p>

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。以下同じ。)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 (略)

(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
応じて、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っ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(第70条に規定する当初証拠金所要額をいう。)の引上げの措置を行うことができる。

(1)・(2) (略)

(フェイルの取扱い)

第51条 (略)

2 (略)

(削る)

3 第48条の規定は、前2項の規定により繰り延べられた決済(以下「フェイルに係る決済」

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。以下同じ。)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 (略)

(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
応じて、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っ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)・(2) (略)

(フェイルの取扱い)

第51条 (略)

2 (略)

3 前2項の規定により繰り延べられた決済(以下「フェイルに係る決済」という。)は、利払
期日前3日間(銀行休業日を除外する。)及び償還期日前3日間(銀行休業日を除外する。)
においては行わないものとする。

4 第48条の規定は、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

という。)に関する国債証券の授受及び金銭の授受について準用する。

4 (略)

(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っては、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渡方清算参加者は、償還期日に、受領する元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受方清算参加者は、当該元利金相当額の金銭を、償還期日に、当社から受領するものとする。

2 (略)

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。

準用する。

5 (略)

(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4日前(銀行休業日を除外する。)の日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っては、利払期日。以下この条において同じ。)の4日前(銀行休業日を除外する。)の日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渡方清算参加者は、償還期日に、受領する元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受方清算参加者は、当該元利金相当額の金銭を、償還期日に、当社から受領するものとする。

2 (略)

3 第51条第4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。

(バイ・イン)

第55条 (略)

- 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(休業日を除く。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 (略)

2・3 (略)

- 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48条第1項第2号の規定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渡方清算参加者と当社との間の決済)

第57条 (略)

2 (略)

- 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。

(バイ・イン)

第55条 (略)

- 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(休業日を除く。以下日数計算において同じ。)の日(当該日が、利払期日前3日間(銀行休業日を除く。)に該当する場合は、利払期日)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 (略)

2・3 (略)

- 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受方清算参加者との間において、第51条第4項の規定により準用される第48条第1項第2号の規定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渡方清算参加者と当社との間の決済)

第57条 (略)

2 (略)

- 3 第51条第4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。

(参加者バイ・イン)

第58条 (略)

- 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 (略)

2 (略)

- 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渡方清算参加者と当社との間の決済)

第60条 (略)

2 (略)

- 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。

(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)

(参加者バイ・イン)

第58条 (略)

- 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 (当該日が、利払期日前3日間(銀行休業日を除外する。)) に該当する場合は、利払期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 (略)

2 (略)

- 3 第51条第4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渡方清算参加者と当社との間の決済)

第60条 (略)

2 (略)

- 3 第51条第4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。

(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 (略)

2 (略)

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渡方清算参加者との当社との間の決済)

第63条 (略)

2 (略)

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。

(当初証拠金の利用)

第71条 (略)

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処分代金、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

第62条 (略)

2 (略)

3 第51条第4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渡方清算参加者との当社との間の決済)

第63条 (略)

2 (略)

3 第51条第4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。

(当初証拠金の利用)

第71条 (略)

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81条の規定による国債証券の処分代金、第82条の規定により納入された損失負担金又は第83条の規定により納入された追加損失負担金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

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。

(決済不履行時の資金調達)

第74条 当社は、清算参加者が金銭決済債務、証券決済債務及び利金相当額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48条(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)・(2) (略)

2・3 (略)

(調達資金の返済等)

第76条 (略)

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) (略)

(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

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。

(決済不履行時の資金調達)

第74条 当社は、清算参加者が金銭決済債務、証券決済債務及び利金相当額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48条(第51条第4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)・(2) (略)

2・3 (略)

(調達資金の返済等)

第76条 (略)

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) (略)

(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81条の規定による国債証券の処分代金又は第82条に規定する損失負担金若し

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 (略)

(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、第80条の3に規定する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(第79条第1項に規定する当初証拠金代用預託残高をいう。)、国債店頭取引清算基金代用預託残高(第79条第1項に規定する国債店頭取引清算基金代用預託残高をいう。)、破綻時証拠金代用預託残高(第79条第1項に規定する破綻時証拠金代用預託残高をいう。)、当該清算参加者に対する証券決済債務、バイ・インに係る国債証券引渡債務又は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(第78条第1項第7号に規定する参加者決済に係る支払債務をいう。)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)・(3) (略)

(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、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

くは第83条に規定する追加損失負担金の納入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

3 (略)

(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、第80条の3に規定する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、当該清算参加者に対する証券決済債務、バイ・インに係る国債証券引渡債務又は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)・(3) (略)

(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、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（以下「一括清算事由」という。）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（当社又は清算参加者が負担する参加者決済に係る支払債務、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、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に係る支払債務並びに当社が負担する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、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。）に係る返還債務及び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。）に係る返還債務をいう。以下同じ。）及び国債証券引渡返還債務（第46条第1項の規定により当社又は清算参加者が負担する証券決済債務、第55条の規定により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、第58条の規定により清算参加者が負担する参加者バイ・インに係る国債証券引渡債務、当社が負担する当初証拠金代用預託残高（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。以下同じ。）に係る返還債務、当社が負担する国債店頭取引清算基金代用預託残高（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。以下同じ。）に係る返還債務及び当社が負担する破綻時証拠金代用預託残高（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

別清算開始の申立（以下「一括清算事由」という。）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（当社又は清算参加者が負担する参加者決済に係る支払債務、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、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に係る支払債務並びに当社が負担する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、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。）に係る返還債務及び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。）をいう。以下同じ。）及び国債証券引渡返還債務（第46条第1項の規定により当社又は清算参加者が負担する証券決済債務、第55条の規定により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、第58条の規定により清算参加者が負担する参加者バイ・インに係る国債証券引渡債務、当社が負担する当初証拠金代用預託残高（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。以下同じ。）に係る返還債務、当社が負担する国債店頭取引清算基金代用預託残高（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。以下同じ。）に係る返還債務及び当社が負担する破綻時証拠金代用預託残高（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。以下

をいう。以下同じ。)に係る返還債務、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現金担保付債券貸借取引に係る国債証券引渡債務並びに第80条の7第2項の規定により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をいう。以下同じ。)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。

2～7 (略)

(破綻処理入札の実施)

第80条の3 (略)

2 破綻処理入札は、当社が規則で定める清算参加者を対象とする第一段階破綻処理入札及び破綻清算参加者以外の全清算参加者を対象とする第二段階破綻処理入札に区分する。

3・4 (略)

(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、破綻清算参加者以外の各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。この場合における破綻清算参加者以外の各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、次に定めるところとする。

同じ。)に係る返還債務、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現金担保付債券貸借取引に係る国債証券引渡債務並びに第80条の7第2項の規定により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をいう。以下同じ。)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。

2～7 (略)

(破綻処理入札の実施)

第80条の3 (略)

2 破綻処理入札は、当社が規則で定める清算参加者を対象とする第一段階破綻処理入札及び破綻参加者以外の全清算参加者を対象とする第二段階破綻処理入札に区分する。

3・4 (略)

(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、破綻清算参加者以外の各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。この場合における破綻清算参加者以外の各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、次に定めるところとする。

- (1) (略)
- (2) 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（以下本項において「第二階層原取引按分清算参加者負担総額」という。）は、原取引按分方式対象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り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) (略)
- (4) 清算基金所要額按分方式における清算基金所要額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（以下本項において「第二階層清算基金所要額按分清算参加者負担総額」という。）は、清算基金所要額按分方式対象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所要額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所要額按分方式において取り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) 清算基金所要額按分方式における各清算基金所要額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

- (1) (略)
- (2) 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（以下本項において「第二階層原取引按分清算参加者負担総額」という。）は、原取引按分方式対象損失総額から前号に規定する原取引按分方式において取り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) (略)
- (4) 清算基金所要額按分方式における清算基金所要額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（以下本項において「第二階層清算基金所要額按分清算参加者負担総額」という。）は、清算基金所要額按分方式対象損失総額から前1号に規定する清算基金所要額按分方式において取り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) 清算基金所要額按分方式における各清算基金所要額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所要額按分清算参加者（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 第二階層清算基金所要額按分清算参加者負担総額を各対象清算参加者の清算基金所要額按分清算参加者第二階層負担限度額（本条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第 1 項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における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。以下同じ。）に応じて按分した額（第二階層清算基金所要額按分清算参加者負担総額が対象清算参加者第二階層負担限度額の総額以上である場合には、各対象清算参加者の清算基金所要額按分清算参加者第二階層負担限度額（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、当該額を控除した残額）

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所要額按分清算参加者（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 第二階層清算基金所要額按分清算参加者負担総額を各対象清算参加者の清算基金所要額按分清算参加者第二階層負担限度額（本条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第 1 項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における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。以下同じ。）に応じて按分した額（第二階層清算基金所要額按分清算参加者負担総額が対象清算参加者第二階層負担限度額の総額以上である場合には、各対象清算参加者の清算基金所要額按分清算参加者第二階層負担限度額（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、当該額を控除した残額）

<p>b・c (略)</p> <p>2 (略)</p> <p>(破綻時証拠金の預託)</p> <p>第83条の9 (略)</p> <p>(削る)</p> <p><u>2</u> (略)</p> <p><u>3</u> (略)</p> <p><u>4</u> (略)</p> <p>(最終損失確定時の調整)</p> <p>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<u>第80条</u>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。</p> <p>2 (略)</p> <p>(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)</p> <p>第90条 複数のネットィング口座を開設して</p>	<p>b・c (略)</p> <p>2 (略)</p> <p>(破綻時証拠金の預託)</p> <p>第83条の9 (略)</p> <p><u>2</u> <u>破綻時証拠金の預託を受けた当社は、本業務方法書等の定めるところにより、破綻時証拠金(破綻時証拠金が代用国債証券である場合には、その換価処分後の金銭から当該換価処分に要した費用を控除した残額。以下本項において同じ。)を被担保債務の弁済に充当し、又は破綻時証拠金の返還請求権と被担保債務に係る債権とを対当額で相殺することができる。</u></p> <p><u>3</u> (略)</p> <p><u>4</u> (略)</p> <p><u>5</u> (略)</p> <p>(最終損失確定時の調整)</p> <p>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<u>80</u>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。</p> <p>2 (略)</p> <p>(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)</p> <p>第90条 複数のネットィング口座を開設して</p>
--	---

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。

(略)		
第 8 3 条 の 9 第 1 項	(略)	(略)
同条第 2 項	(略)	(略)
同条第 3 項	(略)	(略)

2・3 (略)

4 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 7 0 条から第 7 0 条の 8 まで、第 7 3 条、第 7 8 条、第 8 0 条及び第 8 0 条の 2 から第 8 0 条の 7 までの規定は、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。

付 則

- この改正規定は、平成 2 7 年 1 0 月 1 3 日から施行する。ただし、第 5 1 条第 3 項から第 5 項まで、第 5 4 条第 3 項、第 5 6 条第 4 項、第 5 7 条第 3 項、第 5 9 条第 3 項、第 6 0 条第 3 項、第 6 2 条第 3 項及び第 6 3 条第 3 項の改正規定は、平成 2 7 年 1 0 月 1 4 日から施行する。
- 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 2 7 年 1 0 月 1 3 日以後の当社が定める日から施行

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。

(略)		
第 8 3 条 の 9 第 1 項	(略)	(略)
同条第 3 項	(略)	(略)
同条第 4 項	(略)	(略)

2・3 (略)

4 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 7 0 条から第 7 0 条の 8 まで、第 7 3 条、第 7 8 条、第 8 0 条及び第 8 0 条の 2 から第 8 0 条の 8 までの規定は、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。

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。

国債店頭取引清算業務に関する業務方法書の取扱いの一部改正新旧対照表

新	旧
<p>(清算対象取引)</p> <p>第2条 業務方法書第3条第1項に規定する当社が定める国債証券は、次の各号に掲げるもの（流動性等を勘案し当社が適当でないとするものを除く。）とする。</p> <p>(1) 利付国債（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。）及び個人向け国債（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。）</p> <p>(2)・(3) (略)</p> <p>2 業務方法書第3条第2項に規定する当社が定める取引は、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。</p> <p>(1) 国債証券の売買等</p> <p>a (略)</p> <p>(削る)</p>	<p>(清算対象取引)</p> <p>第2条 業務方法書第3条第1項に規定する当社が定める国債証券は、次の各号に掲げるもの（流動性等を勘案し当社が適当でないとするものを除く。）とする。</p> <p>(1) 利付国債（<u>利子を非課税扱いとするものに限り、承継国債（政府が承継した日本国有鉄道清算事業団債務に係る国債の取扱い等に関する省令（平成10年大蔵省令第35号）第1条、国が承継した石油公団債務に係る国債の取扱い等に関する省令（平成15年財務省令第22号）第1条及び政府が承継した本州四国連絡橋公団債務に係る国債の取扱い等に関する省令（平成15年財務省令第57号）第1条に規定する承継国債をいう。）</u>、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。）及び個人向け国債（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。）</p> <p>(2)・(3) (略)</p> <p>2 業務方法書第3条第2項に規定する当社が定める取引は、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。</p> <p>(1) 国債証券の売買等</p> <p>a (略)</p> <p>b <u>売買決済日が利払期日前3日間（銀行休業日を除外する。）及び償還期日前3日間（銀行休業日を除外する。）に該当しない</u></p>

b (略)

c (略)

d (略)

(2) 現金担保付債券貸借取引等

a (略)

(削る)

b (略)

c (略)

d (略)

e (略)

(3) 現先取引等

a (略)

(削る)

b (略)

c (略)

d (略)

e (略)

f (略)

g (略)

(純財産額等として維持すべき額)

第9条 (略)

2～4 (略)

5 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a(a)に定める時価変動リスクファ

こと。

c (略)

d (略)

e (略)

(2) 現金担保付債券貸借取引等

a (略)

b 取引実行日及び取引決済日が利払期日前3日間(銀行休業日を除外する。)及び償還期日前3日間(銀行休業日を除外する。)に該当しないこと。

c (略)

d (略)

e (略)

f (略)

(3) 現先取引等

a (略)

b スタート取引受渡日及びエンド取引受渡日が利払期日前3日間(銀行休業日を除外する。)及び償還期日前3日間(銀行休業日を除外する。)に該当しないこと。

c (略)

d (略)

e (略)

f (略)

g (略)

h (略)

(純財産額等として維持すべき額)

第9条 (略)

2～4 (略)

5 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a(a)に定める銘柄別リスクファク

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。

6 (略)

(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、同第48条第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。

(国債DVP決済の方法)

第13条 業務方法書第48条第1項第1号及び第2号並びに第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に掲げる区分に従

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。

6 (略)

(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、同第48条第2項(同第51条第4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8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8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。

(国債DVP決済の方法)

第13条 業務方法書第48条第1項第1号及び第2号並びに第2項(同第51条第4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に掲げる区分に従

い、当該 a 又は b に定めるところにより行う。

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 48 条第 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 48 条第 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 48 条第 1 項第 1 号及び第 2 号並びに第 2 項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 48 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 項第 1 号及び第 2 号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

い、当該 a 又は b に定めるところにより行う。

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を行う。

b 業務方法書第 48 条第 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を行う。この場合において、同第 48 条第 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を行う。

2 業務方法書第 48 条第 1 項第 1 号及び第 2 号並びに第 2 項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 48 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 項第 1 号及び第 2 号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。この場合における資金

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48条第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。

(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。

受渡依頼は、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、日本銀行に対して資金受渡依頼を行う。

b 代理人の当座勘定から振り替える場合

当該代理人が、日本銀行に対して資金受渡依頼を行う。この場合において、業務方法書第48条第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、この場合における資金受渡依頼は当社が行う。

3 前2項に規定する受渡依頼は、当社が指定する数量又は金額ごとに行うものとする。この場合において、当社は、各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。

(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条第10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（計算日から起算して3日目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。）ごと、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（計算日のレギュラー受渡日（計算日から起算して3日目の日をいう。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。以下同じ。）の前日までに到来する場合には、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、決済日等ごと、銘柄ごとに当社が定める割引率を使用して算出した、計算日の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とする。

(2) (略)

（当初証拠金及び国債店頭取引清算基金の金銭の取扱い）

第22条 業務方法書第70条の2及び第70条の4第1項並びに第70条の6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（業務方法書第70条の9の定めるところにより代理人を通じて第70条の2及び第70条の4第1項並びに第70条の6に規定する金銭の預託を行う場合に

(1) 国債証券の売買等

決済日等（計算日から起算して3日目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。）ごと、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（計算日のレギュラー受渡日（計算日から起算して3日目の日（当該日が利払期日前3日間（銀行休業日を除外する。）に該当する場合は利払期日、当該日が償還期日前3日間（銀行休業日を除外する。）に該当する場合は償還期日）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。以下同じ。）の4日前の日までに到来する場合には、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、決済日等ごと、銘柄ごとに当社が定める割引率を使用して算出した、計算日の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とする。

(2) (略)

（当初証拠金及び国債店頭取引清算基金の金銭の取扱い）

第22条 業務方法書第70条の2及び第70条の4第1項並びに第70条の6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（業務方法書第70条第11項の定めるところにより代理人を通じて同条第2項及び第5項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

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。

(代用国債証券の取扱い)

第24条 (略)

- 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。

4～7 (略)

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項及び第70条の7第1項に規定する返還は、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。

(代用国債証券の取扱い)

第24条 (略)

- 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。この場合において、清算参加者は、利払期日前3日間(銀行休業日を除外する。)及び償還期日前3日間(銀行休業日を除外する。)においては当該国債証券の預託を行うことができない。

- 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第1項に規定する返還は、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。この場合において、清算参加者は、利払期日前3日間(銀行休業日を除外する。)及び償還期日前3日間(銀行休業日を除外する。)においては当該国債証券の返還の請求を行うことができない。

4～7 (略)

(決済不履行時の資金調達の取扱い)

第25条 (略)

2 (略)

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 (略)

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き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。

(決済不履行時の資金調達の取扱い)

第25条 (略)

2 (略)

3 基礎負担額及び平均当初証拠金所要額は、毎年3月及び9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 (略)

国債店頭取引に係る当初証拠金所要額に関する規則の一部改正新旧対照表

新	旧
<p>別表 当初証拠金基礎所要額の算出に関する表</p> <p>1 各清算参加者の当初証拠金基礎所要額は、次の計算式により計算して得た額とする。</p> <p>当初証拠金基礎所要額</p> $= \text{FOS 決済に係る当初証拠金所要額} + \text{国債DVP 決済に係る当初証拠金所要額} + \text{市場インパクト・チャージ所要額}$ <p>(1) (略)</p> <p>(2) 国債DVP 決済に係る当初証拠金所要額は、次の計算式により計算して得た額とする。</p> <p>国債DVP 決済に係る当初証拠金所要額</p> $= \text{国債の再構築コスト相当額} + \text{レポレート変動リスク相当額}$ <p>a (略)</p> <p>b レポレート変動リスク相当額は、レポレート変動リスクに係るPOMA、レポレート変動リスクに係る平均POMA及びレポレート変動リスク下限額のうち最大の額とする。</p> <p>(a) レポレート変動リスクに係るPOMAは、清算対象取引に係る当該清算参加者の銘柄ごと決済日等ごとの総引渡数量と総受領数量の差引数量の時価評価額（計算日の翌日（休業日に当たるときは、順次繰り下げる。）付で日本証券</p>	<p>別表 当初証拠金基礎所要額の算出に関する表</p> <p>1 各清算参加者の当初証拠金基礎所要額は、次の計算式により計算して得た額とする。</p> <p>当初証拠金基礎所要額</p> $= \text{FOS 決済に係る当初証拠金所要額} + \text{国債DVP 決済に係る当初証拠金所要額} + \text{市場インパクト・チャージ所要額}$ <p>(1) (略)</p> <p>(2) 国債DVP 決済に係る当初証拠金所要額は、次の計算式により計算して得た額とする。</p> <p>国債DVP 決済に係る当初証拠金所要額</p> $= \text{国債の再構築コスト相当額} + \text{レポレート変動リスク相当額}$ <p>a (略)</p> <p>b レポレート変動リスク相当額は、レポレート変動リスクに係るPOMA、レポレート変動リスクに係る平均POMA及びレポレート変動リスク下限額のうち最大の額とする。</p> <p>(a) レポレート変動リスクに係るPOMAは、清算対象取引に係る当該清算参加者の銘柄ごと決済日等ごとの総引渡数量と総受領数量の差引数量の時価評価額（計算日の翌日（休業日に当たるときは、順次繰り下げる。）付で日本証券</p>

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利回りの平均値により、計算日のレギュラー受渡日（計算日から起算して3日目の日をいう。）を基準として算出する価格（当該銘柄が変動利付国債である場合にあっては、計算日の翌日（休業日に当たるときは、順次繰り下げる。）付で日本証券業協会が発表する売買参考統計値のうち価格の平均値、当該銘柄が計算日の翌日（休業日に当たるときは、順次繰り下げる。）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である場合にあっては、当社がその都度定める価格）により評価した額に、計算日のレギュラー受渡日までの日数（休業日を含む。）に応じた経過利子（額面総額に国債証券の利率を乗じて算出した額について日割をもって計算した額をいう。）を加算した額をいう。）にレポレート変動リスクファクター（レポレート変動リスクを算出するために当社が定める値をいう。以下同じ。）を乗じた額に、計算日のレギュラー受渡日の翌日から決済日等までの日数（休業日を含む。）を365で除した数値（決済日等が計算日のレギュラー受渡日より前の場合には決済日等から計算日のレギュラー受渡日の前日までの日数（休業日を含む。）を365で除した数値、決済日等が計算日のレギュラー受渡日の場合にはゼロ）を乗じた金額（以下「レポレート変動リスクgross金額」という。）について、銘柄ごとに、決済日等が計算日のレギュラー受渡日

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利回りの平均値により、計算日のレギュラー受渡日（計算日から起算して3日目の日（当該日が利払期日前3日間（銀行休業日を除外する。）に該当する場合は利払期日、当該日が償還期日前3日間（銀行休業日を除外する。）に該当する場合は償還期日）をいう。）を基準として算出する価格（当該銘柄が変動利付国債である場合にあっては、計算日の翌日（休業日に当たるときは、順次繰り下げる。）付で日本証券業協会が発表する売買参考統計値のうち価格の平均値、当該銘柄が計算日の翌日（休業日に当たるときは、順次繰り下げる。）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である場合にあっては、当社がその都度定める価格）により評価した額に、計算日のレギュラー受渡日までの日数（休業日を含む。）に応じた経過利子（額面総額に国債証券の利率を乗じて算出した額について日割をもって計算した額をいう。）を加算した額をいう。）にレポレート変動リスクファクター（レポレート変動リスクを算出するために当社が定める値をいう。以下同じ。）を乗じた額に、計算日のレギュラー受渡日の翌日から決済日等までの日数（休業日を含む。）を365で除した数値（決済日等が計算日のレギュラー受渡日より前の場合には決済日等から計算日のレギュラー受渡日の前日までの日数（休業日を含む。）を365で除した数値、決算日等が計算

以降である引渡しに係るレポレート変動リスクグロス金額と決済日等が計算日のレギュラー受渡日より前である受領に係るレポレート変動リスクグロス金額の合計額と決済日等が計算日のレギュラー受渡日以降である受領に係るレポレート変動リスクグロス金額と決済日等が計算日のレギュラー受渡日より前である引渡しに係るレポレート変動リスクグロス金額の合計額の差引額を算出し、当該差引額をすべての銘柄について合算した額とする。この場合において、当社は、レポレート変動リスクファクターについて毎月見直しを行い清算参加者に通知するものとし、その月の5日目の日の計算から適用する。ただし、当社が必要と認める場合は、レポレート変動リスクファクターについて臨時に変更することができる。

(b)・(c) (略)

(3) (略)

2 (略)

付 則

- 1 この改正規定は、平成27年10月13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

日のレギュラー受渡日の場合にはゼロ)を乗じた金額(以下「レポレート変動リスクグロス金額」という。)について、銘柄ごとに、決済日等が計算日のレギュラー受渡日以降である引渡しに係るレポレート変動リスクグロス金額と決済日等が計算日のレギュラー受渡日より前である受領に係るレポレート変動リスクグロス金額の合計額と決済日等が計算日のレギュラー受渡日以降である受領に係るレポレート変動リスクグロス金額と決済日等が計算日のレギュラー受渡日より前である引渡しに係るレポレート変動リスクグロス金額の合計額の差引額を算出し、当該差引額をすべての銘柄について合算した額とする。この場合において、当社は、レポレート変動リスクファクターについて毎月見直しを行い清算参加者に通知するものとし、その月の5日目の日の計算から適用する。ただし、当社が必要と認める場合は、レポレート変動リスクファクターについて臨時に変更することができる。

(b)・(c) (略)

(3) (略)

2 (略)

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。