国債取引の決済期間の短縮化等に伴う 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

日本証券業協会の「国債の決済期間の短縮化に関する検討ワーキング・グループ」では国債の決済期間の短縮(アウトライト・SCレポ取引:T+1、GCレポ取引:T+0)化の実現に向けた検討を経て、2018年5月1日の約定分から実施することとされた。

国債の取引の決済期間短縮化に伴って、当社では国債店頭取引清算業務において、個別銘柄を特定せずバスケット(複数の銘柄の集合体)単位で約定し、スタート決済の直前に国債の在庫から個別銘柄の割当てを行う方式による取引である銘柄後決め現先取引を導入する。

また、2013年に発行が再開された物価連動国債について清算対象化のニーズを踏まえて、 国債店頭取引清算業務において決済期間短縮化に併せて物価連動国債を新たに清算対象に追加する。加えて、自社清算参加者資格を有する清算参加者の当社に対する債務を保証できる法人について見直しを行う。

当社は、国債取引の決済期間短縮化に伴う銘柄後決め現先取引の導入及び物価連動国債の清算対象化並びに親会社保証制度の見直しに伴い、別紙のとおり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を行う。

Ⅱ. 改正概要

- 1. 銘柄後決め現先取引の導入
- (1)清算対象取引
 - ・ 銘柄後決め現先取引を清算対象取引とする。
 - ・ 銘柄後決め現先取引の対象とする取引は、現先取引のうち、次 に掲げる要件を充たすものとする。
 - ・当社が定めるバスケットを指定した取引であること。
 - ・約定日の午前7時から午後2時までに債務引受けの申込みが行われた場合はスタート決済日が約定日であること、約定日の午後2時から約定日翌日(休業日にあたる場合は順次繰り下げる。以下同じ。)の午後2時までに債務引受けの申込みが行われた場合は、スタート決済日が約定日の翌日であること。

(備 考)

- ・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4条第2項
- ・業務方法書第40条、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「取扱い」という。) 第2条

- ・エンド決済日が約定日の1年後の応当日までに到来するこ と。
- ・約定時点でエンド決済日が確定していること。
- ・スタート受渡金額が1,000万円の整数倍であること。
- ・信託勘定を当事者とする取引の場合には、ファンドコードが 特定されていること。
- ・ 当社は銘柄後決め現先取引において割当対象とする銘柄の範 |・業務方法書第4条第3 囲を特定するバスケットを設定する。

項、取扱い第2条の2

(2) 債務引受

- ・ 清算参加者は、以下の事項を内容として債務引受けの申込み行 ・ 業務方法書第40条第2 う。
 - ・渡方清算参加者及び受方清算参加者の名称
 - ・渡方清算参加者及び受方清算参加者のネッティング口座
 - ・対象取引に係るファンドコード(信託口であるネッティング 口座に係る取引の場合)
 - ・約定日
 - ・バスケット
 - ・スタート受渡金額及びエンド受渡金額
 - ・スタート決済日及びエンド決済日
 - ・有価証券等清算取次ぎである場合はその旨
- ・ 銘柄後決め現先取引の債務引受時限を1日に3回(午前7時、 午前11時及び午後2時)設ける。
- ・ 当社は、銘柄後決め現先取引に係る債務引受けの申込みに基づ |・業務方法書第44条第1 き、当該取引に関し、スタート債務、エンド債務、Unwin d債務及びRewind債務を引き受ける。
- ・ 銘柄後決め現先取引に係る債務引受時限において、渡方清算参 ・ 業務方法書第40条第5 加者と受方清算参加者との合意に基づき、取引期間中のUnw ind債務及びRewind債務が発生する。

項第4号

- · 業務方法書第40条第3 項、第44条第2項
- 項
- 項

(3) バスケットネッティング

・ 銘柄後決め現先取引に係る債務引受けが行われる都度、スター ・ 業務方法書50条の2 ト/Rewind債務及びエンド/Unwind債務ごとに、 バスケット及び決済日を同一とする債務について、それぞれネ

ッティングを行う。

(4) 割当対象銘柄及び割当可能数量の取扱い

・ 清算参加者はネッティング口座ごとに利用可能な割当対象銘 - 業務方法書第50条の3 柄及びその数量を記載した割当可能残高通知を当社に提出す る。

(5) 銘柄割当て

· 当社はバスケットネッティングの結果及び提出された割当可 |・業務方法書第50条の 能残高通知に基づいて債務引受時限において銘柄割当てを行 う。

4、取扱い第12条の3

(6) 決済

- ・ 銘柄後決め現先取引に係る国債の決済は決済時限を同一とす |・業務方法書第50条の5 るものについて銘柄ごとに差引計算した数量を授受する。金銭 の決済は国債の時価評価額と受渡調整金の金銭の授受により 行う。
 - から第50条の8まで
- ・ 銘柄後決め現先取引の決済は売買、銘柄先決め現先取引及び現 金担保付債券貸借取引と別に行う。
- ・ 銘柄後決め現先取引に係る決済時限を1日3回(渡方清算参加 ・ 業務方法書第50条の1 者と当社の決済:午前10時30分、午後1時30分及び午後 3時30分・当社と受方清算参加者の決済:午前11時、午後 2時及び午後4時) 設ける。
 - 1、取扱い第13条
- ・ 銘柄後決め現先取引に係る決済において、フェイルとなったも |・ 業務方法書第51条 のは翌日以降に繰り延べる。
- ・ 銘柄後決め現先取引に係る受渡調整金の授受について、支払方 ・業務方法書第50条の 清算参加者は、午後3時30分までに当社に金銭を支払い、受 領方清算参加者は午後4時以降当社から金銭を受領する。
 - 9、第50条の10

(7) 変動証拠金

・ 銘柄後決め現先取引に係る変動証拠金を授受する。

・取扱い第16条、第19 条

2. 物価連動国債の清算対象化

- ・ 清算対象取引の対象とする国債証券に物価連動国債を追加す ・ 取扱い第2条 る。
- 物価連動国債を対象とする取引に係る債務引受けの申込みは、 物価連動国債に係る手数料を選択している清算参加者に限り 行うことができる。
- ・取扱い第10条
- 物価連動国債を代用国債証券として預託することは物価連動 |・取扱い第24条 国債に係る手数料を選択している清算参加者に限り行うこと ができる。
- 3. その他決済期間短縮化及び物価連動国債の清算対象化に伴う見直
- (1) ネッティング口座の種類の見直し
 - ・ ネッティング口座について、通常口座、レポ専用口座及び後決 ・業務方法書第86条 めレポ専用口座の3種類を設ける。

(2) 当初証拠金等の見直し

- ・ 一日における当初証拠金所要額の算出及び預託の回数を現行 |・業務方法書第70条、第 の一回から三回に変更する。当初証拠金所要額の各構成要素に ついて、銘柄後決めレポ取引の特性を踏まえた算出方法の見直 しを行う。
 - 70条の2、第70条の 4、取扱い第21条の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、別表
- ・ 国債店頭取引清算基金所要額について毎日算出を行い、計算方 |・業務方法書第70条の 法を見直す。
- 5、第70条の6、取扱 い第21条の3、第22 条の2、国債店頭取引清 算基金所要額に関する規 則第2条、第3条、別表

(3)破綻処理スキームの見直し

- ・ 清算参加者破綻時における銘柄後決め現先取引に係るポジシ↓・業務方法書第80条の ョンを処理するためのバスケットオークションを導入する。
- 3、第80条の7、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2 から第5条の6まで等

- (4)破綻処理入札及び義務付け調達におけるレポ取引に係る取引種 類の見直し
 - ・ 破綻処理入札及び義務付け調達の結果生じる当社と清算参加 ・ 業務方法書第74条、第 者間のレポ取引を、現金担保付債券貸借取引から現先取引に変 更する。
 - 85条の2

(5) 手数料の見直し

- ・ 銘柄割当手数料を新設する。
- ・ 手数料の限度額を廃止し、債務引受手数料、残高管理手数料及 ・ 手数料規則第3条、第3 び銘柄割当手数料について、取引量の増加に応じて手数料率を 逓減させる逓減料率の採用、委託分に係る取扱いを設ける。
- ・ 債務引受手数料及び銘柄割当てに係る手数料について、物価連 ・ 手数料規則第3条、第3 動国債に係る2種類の固定料率及び従量料率の組合せを設定 し、清算参加者は手数料率の組合せを選択することができるこ ととする。

- 国債店頭取引清算業務に 関する手数料に関する規 則(以下「手数料規則」 という。) 第3条の2
- 条の2、第10条、別表 1、別表2
- 条の2、第10条の2

4. 親会社保証制度の見直し

- (1) 保証できるグループ会社の拡大
 - ・ 自社清算資格を有する清算参加者の当社に対する債務を保証 ・業務方法書第6条、第7 できる法人を親会社から親会社の子会社も含む親会社等に変 更する。
 - 条
 - ・ 親会社等保証を行う法人の特定の業態の限定を撤廃する。
- 同上

(2) 親会社等に求める財務基準

- ・ 親会社等保証を行う親会社等に求める純財産額等について、親 |・業務方法書第7条 会社等保証を受ける清算参加者の数に50億円を乗じた額(た だし、当該額が200億円に満たない場合は、200億円とす る。) 以上の額とする。

(3) 清算資格取得以降の取扱い

- ・ 自社清算資格を有する清算参加者は、自社清算資格の取得後に ・ 業務方法書第9条の3

おいても、親会社等保証制度の利用を当社に申請できるのとす る。

(4) 当初証拠金所要額割増の条件

- ・親会社等保証を受けている清算参加者に対する信用状況に応 |・業務方法書第29条の じた当初証拠金所要額割増は、当該清算参加者の信用悪化事由 と親会社等の信用悪化事由が同時に生じ、かつ、親会社等の信 用力が十分でないおそれがある場合、又は、当該親会社等の信 用力が十分でない場合のいずれかに該当することを条件とす る。
- 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3条

5. その他

・ その他、所要の改正を行う。

Ⅲ. 施行日

2018年5月1日から施行する。ただし、当社と清算参加者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、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、2018 年5月2日以後の当社が定める日から施行する。

以上

国債取引の決済期間の短縮化等に伴う 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新旧対照表

目 次

		(ページ)
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	1
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	115
3.	国債店頭取引清算業務に関する手数料に関する規則の一部改正新旧対照表	147
4.	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	161
5.	国債店頭取引清算基金所要額に関する規則の一部改正新旧対照表	184
6.	措置評価委員会規則の一部改正新旧対照表	188
7.	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の一部改正新旧対照表	189

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

旧

(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。

新

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) 「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。

(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、金融商品取引法(昭和23年法律第25号。以下「法」という。)第156条の7の規定に基づき、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(法第2条第28項に規定する金融商品債務引受業をいう。以下同じ。)その他の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。)の方法について基本的事項を定める。
- 2 本業務方法書(本業務方法書に基づく規則を 含む。) 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 債務引受業その他の業務には適用されないも のとする。

(新設)

- (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。
- <u>(7)</u> 「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/Unwind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/Unwind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

- <u>の売買等において売買決済日に国債証券の</u> 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
 - <u>b</u> 第50条の2第2項に規定するスタート/Rewind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。)及び同項に規定するエンド/Unwind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(サブスティテュー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。
- (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。

- <u>a</u> 第46条に規定する個別銘柄取引に係る証券決済債務
- <u>b スタート/Rewind国債引渡債務</u><u>(バスケット)及びエンド/Unwind</u>国債引渡債務(バスケット)
- <u>c</u> 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
- <u>d</u> 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
- <u>e</u> 当初証拠金代用預託残高に係る返還債 務
- <u>f</u> 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
- <u>h</u> 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
- <u>i</u> 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、変更後銘柄現先取引 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 変更後銘柄現先取引等
- (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 を総称していう。
 - <u>a</u> 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
 - <u>c</u> 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 <u>先取引等に係る利金相当額決済債務</u>
 - <u>e</u> 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
 - <u>f</u> 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
- <u>h</u> 第53条に規定する利金相当額に係る 支払債務
- <u>i</u> 第54条に規定する償還金相当額に係 る支払債務
- <u>j</u> 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
- 1 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

- <u>第65条及び第66条に規定する変動</u>証拠金の預託に係る債務
- <u>p</u> 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4 6条の6第1項に規定する自己資本規制比率をいう。
- (43) 「信託口」とは、信託に係る取引専用のネッ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/Rewind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/Rewind国債引渡債務 (バスケット)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、 破綻処理損失の額から原取引按分方式損失 総額を控除した額をいう。
- (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8 3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(清算参加者が信託口以外のネッティング口座を有する場合は信託口以外のネッテ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(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

- <u>引清算基金から取崩しをする額の総額をい</u> <u>う。</u>
- (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8 3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、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 <u>イテューションの対象となる銘柄先決め現</u> 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、サブスティテュ

- 一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) 「ネッティング口座」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) 「バスケットネッティング」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。
- <u>(90)</u> 「破綻等」とは、第78条第1項又 は第2項各号のいずれかに掲げる事由をい う。
- (91) 「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。
- (92) 「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。
- (93) 「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。
- (94) 「フェイルに係る決済」とは、第5 1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 が指定した決済及び第84条の3の規定により当社 より当社が指定した決済をいう。
- (95) 「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。
- (96) 「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、サブスティテュー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。
- (97) 「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。
- (98) 「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。
- (99) 「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。
 - <u>a</u> 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
 - <u> 第50条の2第2項に規定するスター</u><u> ト/Rewind金銭支払債務及びエン</u>ド/Unwind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
 - <u>e</u> 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

- <u>f</u> 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
- <u>h</u> 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/ Rewind金銭支払債務及びエンド/ Unwind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。
 - <u>a</u> 第46条に規定する個別銘柄取引に係 る証券決済債務
 - <u>b スタート/Rewind国債引渡債務</u><u>(バスケット)及びエンド/Unwind</u>国債引渡債務 (バスケット)
 - <u>c</u> 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
 - <u>d</u> 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
 - <u>e</u> 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/Rewind国債引渡債務(バスケット)及びエンド/Unwind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/Rewind国 債引渡債務 (バスケット) のうちバスケット ネッ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。

- (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

<u>しスタート受渡金額相当額の金銭を支払う</u> 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 (略)

- 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

(金融商品債務引受業等)

第2条 当社は、本業務方法書に基づいて行う国 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3条 (略)

- 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<u>(第3号に掲げるもの</u> を除く。以下同じ。)
 - (2) 国債証券の貸借及びその担保の目的で 行う金銭の授受(以下「現金担保付債券貸借 取引」という。)
 - (3) <u>国債証券の買戻又は売戻条件付売買</u> (以下「現先取引」という。)

(新設)

- (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 (略)

 $2 \sim 4$ (略)

第2章 清算参加者

(削る)

(削る)

(4) 前3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 (新設)

(休業日)

第4条 (略)

 $2 \sim 4$ (略)

第2章 清算参加者

第1節 通則

(清算参加者)

- 第5条 清算参加者とは、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(以下 「国債店頭取引清算資格」という。)を有する 者をいう。
- 2 前項に規定する国債店頭取引清算資格は、当 社が行う国債店頭取引清算業務に関して、有価 証券等清算取次ぎを行うことができない清算 資格(以下「国債店頭取引自社清算資格」とい う。)と、第3章に規定するところにより有価 証券等清算取次ぎを行うことができる清算資 格(以下「国債店頭取引他社清算資格」という。) に区分し、国債店頭取引自社清算資格を有する 清算参加者を国債店頭取引自社清算資格を有する 清算の加者を国債店頭取引自社清算参加者と、 国債店頭取引他社清算資格を有する清算参加 者を国債店頭取引他社清算参加者と称する。

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 (略)

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<u>して</u>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。<u>この場合において当該者は、</u> 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 · 4 (略)

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。

6·7 (略)

(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│第7条 前条第1項の申請に係る同条第4項の

第2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 (略)

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債務のすべてに ついて親会社(その者の総株主の議決権(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。以下 同じ。)の過半数を有している会社をいう。以 下同じ。) が保証を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。この場合において、当 該親会社は前項各号のいずれかに該当する者 に限るものとする。

3 • 4 (略)

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。 以下「預保法」という。)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。

6·7 (略)

(国債店頭取引清算資格の要件)

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。

 $(1) \cdot (2)$ (略)

(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、<u>本業務</u>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:

 $(a) \sim (d)$ (略)

- (e) 当該資格取得申請者の<u>親会社等か</u>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) ~ (e) (略)

- (f) 当該資格取得申請者の<u>親会社等か</u><u>ら親会社等保証</u>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

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) • (2) (略)

(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、<u>本業務</u>方法書その他の規則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
 - $(a) \sim (d)$ (略)
 - (e) 当該資格取得申請者の<u>親会社による保証</u>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) ~ (e) (略)
 - (f) 当該資格取得申請者の<u>親会社によ</u>る保証を受けること。
- (2) 親会社の財務基盤

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<u>親会社等(当</u> 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。 (削る)

- <u>a</u> 資本金の額<u>又は出資の総額</u>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っては、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っては、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。

(削る)

(削る)

(削る)

までに、<u>次のa又はbに掲げる区分に従い、</u> 当該資格取得申請者の<u>親会社が当該a又は</u> <u>bに定める基準</u>に適合すると見込まれるこ と。

- a 当該資格取得申請者の親会社が金融商品取引業者、証券金融会社又は短資会社である場合
 - <u>(a)</u> 資本金の額が3億円以上であること。
 - (b) 純財産額(<u>証券金融会社又は短資</u> 会社にあっては純資産額)が<u>200億円</u> 以上であること。

- (c) 金融商品取引業者にあっては、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っては、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。
- b 当該資格取得申請者の親会社が銀行、協 同組織金融機関、株式会社商工組合中央金 庫又は保険会社である場合
 - (a) <u>資本金の額又は出資の総額が3億</u> 円以上であること。
 - (b) 純資産額が200億円以上である <u>こと</u>。

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) (略)

(b) (略)

(c) (略)

- <u>f</u> 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) (略)

3 (略)

(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 (c) 国際統一基準行等にあっては、次の<u>イ</u>から<u>ハ</u>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)。

イ (略)

口 (略)

ハ (略)

- (d) 国内基準行等にあっては、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。
- (e) 保険会社にあっては、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。

(新設)

(3) (略)

3 (略)

(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<u>及び第9条</u>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<u>当社に対す</u> 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。<u>以下本章において同じ。</u>)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 び第9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、第9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未履行債務 (本業務方法書に基づく清算参加者の当社に 対する債務で未履行のもの(当社がその都度定 めるものを除く。) <u>をいう。以下同じ。</u>) 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、第41条第1項第1号、第44条第1 項第2号及び第3号を除き以下同じ。)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。

(新設)

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<u>様式による</u>清算参加者契約を締結しな ければならない。

(届出事項)

第18条 (略)

2 (略)

3 清算参加者は、<u>親会社等から親会社等保証を受けている場合には、</u>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。

(清算参加者等の調査)

第20条 当社は、清算参加者による<u>本業務方法</u> 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。

第3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 定める清算参加者契約を締結しなければなら ない。

(届出事項)

第18条 (略)

2 (略)

3 第6条第2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、第1項に規定 するほか、その親会社が同項第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。

(清算参加者等の調査)

第20条 当社は、清算参加者による<u>本業務方法</u> 書その他の規則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<u>のために親</u>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)

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 前項の規定は、当社が<u>第6条第2項の申請により国債店頭取引清算資格を取得した</u>清算参加者<u>の親会社</u>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<u>親会社</u>」と読み替えるものとする。

<u>第4節</u> 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)

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 2 (略)

(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。

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。

 $(1) \sim (3)$

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)

(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<u>(本業務方法</u> 書及び本業務方法書に基づく規則をいう。以下 同じ。)の定めが適用されるものとする。

第5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。

 $(1) \sim (3)$

(4) <u>前3号</u>のほか、清算参加者が<u>本業務方</u> <u>法書等</u>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。

$2 \sim 4$ (略)

- 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っては 信託口で処理すべき取引を除き、第2号に定め るときにあっ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(<u>当該清算参加者がその親</u>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) (略)

6 • 7 (略)

8 当社は、清算参加者の<u>ために親会社等保証を</u> 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。 (4) <u>前各号</u>のほか、清算参加者が<u>本業務方</u> 法書その他の規則</u>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。

$2 \sim 4$ (略)

- 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っては 第86条第2項に規定する信託口で処理すべ き取引を除き、第2号に定めるときにあっては 同項に規定する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 (第6条第2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あっては、当該清算参加者の親会社)の純財産額 (金融商品取引業者以外の者にあっては、純資産額)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) (略)

6 • 7 (略)

8 当社は、第6条第2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の親会社 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<u>ために親会社等保証を</u> 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 (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) 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<u>(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</u> く。) である場合

 $a \sim d$ (略)

- (2) 当該清算参加者が<u>その親会社等から親</u> 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

9 当社は、第6条第2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の親会社 が同項に規定する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 (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<u>(第70条に規定する当</u> 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) 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である場合

 $a \sim d$ (略)

- (2) 当該清算参加者が<u>第6条第2項の申請</u> 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
- 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 十分でないと当社が定める場合に該当す るとき。

(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 | 第38条 清算参加者は、前条に規定する有価証

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 一・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の信用力が十 分でないと当社が定める場合に該当する とき。

(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3条第2項第4号に掲げる取引とす る。

(委託の際の特定事項)

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) (略)
- (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) (略)
- (4) 国債証券の銘柄及び数量<u>(銘柄後決め</u>現先取引にあっては、バスケット)
- (5) (6) (略)

(清算対象取引に係る区分管理)

第39条 (略)

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 ごとにネッティングロ座を開設し、当該ネッティングロ座により区分して管理しなければな らない。

(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、<u>当社が定めるところに</u> 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。

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) (略)
- (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又は現先取引の別
- (3) (略)
- (4) 国債証券の銘柄及び数量
- (5)・(6) (略)

(清算対象取引に係る区分管理)

第39条 (略)

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 ごとにネッティングロ座(第86条第1項に規 定するネッティングロ座をいう。) を開設し、 当該ネッティングロ座により区分して管理し なければならない。

(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、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 ネッティングロ座
- <u>c</u> 約定日
- d (略)
- <u>e</u> (略)
- <u>f</u> (略)
- g (略)
- (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

- (1) 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(以下「国債証券の売買等」とい う。)
 - a 売方清算参加者 (当該清算対象取引において売買決済日(国債証券の売買等における決済日をいう。以下同じ。) に国債証券の渡方となる清算参加者をいう。以下同じ。) 及び買方清算参加者 (当該清算対象取引において売買決済日に国債証券の受方となる清算参加者をいう。以下同じ。) の名称
- b 売方清算参加者<u>のネッティング口座(第</u>86条に規定するネッティング口座をい う。以下この条において同じ。)及び買方 清算参加者のネッティング口座 (新設)
- c (略)
- d (略)
- <u>e</u> (略)
- f (略)
- (2) 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(以下「現金担保付債券 貸借取引等」という。)
 - a 貸方清算参加者 (当該清算対象取引において、取引実行日(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。以下同じ。) に国債証券の渡方となり、取引決済日(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。以下同じ。) に国債証券の受方となる清算参加者をいう。以下同じ。) 及び借方清算参加者 (当該清算対象取引において、取引実行日に国

- b 貸方清算参加者及び借方清算参加者の ネッティングロ座
- <u>c</u> 約定日
- <u>d</u> (略)
- <u>e</u> (略)
- <u>f</u> (略)
- <u>g</u> (略)
- (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 参加者のネッティングロ座
- <u>c</u> 約定日
- <u>d</u> (略)
- e スタート受渡金額及びエンド受渡金額

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。以下同 じ。) の名称

b 貸方清算参加者<u>のネッティング口座</u>及 び借方清算参加者のネッティング口座 (新設)

<u>c</u> (略)

d (略)

<u>e</u> (略)

<u>f</u> (略)

- (3) 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(以下「現先取引等」という。)
- a 現先売方清算参加者 (当該清算対象取引 において、スタート取引受渡日(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(以下「スタート取引」 という。)の受渡日をいう。以下同じ。)に 国債証券の渡方となり、エンド取引受渡日 (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(以下「エンド取引」 という。)の受渡日をいう。以下同じ。)に 国債証券の受方となる清算参加者をいう。 以下同じ。)及び現先買方清算参加者 (当 該清算対象取引において、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。以下同じ。)の名称
- b 現先売方清算参加者の<u>ネッティングロ</u> <u>座</u>及び現先買方清算参加者のネッティン グロ座

(新設)

<u>c</u> (略)

d スタート取引受渡日に授受する金銭の

<u>f</u> (略)

g (略)

(4) 銘柄後決め現先取引等

- <u>a</u> 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 参加者のネッティングロ座(現先売方清算 参加者のネッティングロ座又は現先買方 清算参加者のネッティングロ座が信託ロ である場合にあってはネッティングロ座 及びネッティングの単位を区分する事項)
- <u>c</u> 約定日
- <u>d</u> バスケット
- e スタート受渡金額及びエンド受渡金額
- <u>f</u> 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、<u>次の各号に掲げる取引</u> <u>ごとに、当該各号に定める時間内</u>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<u>時間</u>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。

額及びエンド取引受渡日に授受する金銭 の額

<u>e</u> (略)

f (略)

(新設)

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、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、その時限を変更す 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) <u>銘柄後決め現先取引等のうち約定日の</u> 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) <u>銘柄後決め現先取引等のうち約定日が</u> スタート取引受渡日であるもの <u>債務の引</u> 受けを行わせる日の午前7時から午後2時 まで

4 (略)

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Unwind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、<u>銘柄先決め現先取引等</u>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

(新設)

(新設)

(新設)

4 (略)

(新設)

(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、<u>前条第2項第3号に掲げる取引</u>について、サブスティテューション<u>(一の現先取引等について、当該現先取引等のエンド取引に係る国債</u> 証券の変更を目的として、次の各号に掲げる取

ければならない。

(削る)

<u>引を同時に行うことをいう。以下同じ。</u>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。

- (1) サブスティテューションの対象となる 現先取引等(以下「当初現先取引等」という。) 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(以下この項において単 に「現先売方清算参加者」という。)及び当 初現先取引等に係る現先買方清算参加者(以 下この項において単に「現先買方清算参加 者」という。)が、次のaからeまでに掲げ る債務を負担する取引
 - a 現先売方清算参加者が、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 現先買方清算参加者が、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のエンド取引受渡日に支払う債務
 - c 現先買方清算参加者が、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、当初現先取引等を終了させる日(以下「サブスティテューション実行日」という。) に引き渡す債務
 - d 現先売方清算参加者が、現先買方清算参加者に、次号に規定する変更後銘柄現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 現先売方清算参加者が、現先買方清算参加者に、サブスティ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

(削る)

2 · 3 (略)

(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<u>(銘柄 後決め現先取引等を除く。)</u>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、当社の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分まで(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)から第2号に掲げる債務引受基準日の前日

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(以下「当初現先取引 等の終了に係る利金相当額支払債務」とい う。)

(2) 現先売方清算参加者が、現先買方清算 参加者に、変更後の国債証券を、サブスティ テュー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現 先取引等(以下この条において「変更後銘柄 現先取引等」という。)

2 · 3 (略)

(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、当社の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時限が変更された場合は当該時限)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

の午後6時30分<u>まで</u>(第40条第3項ただし 書の規定により<u>申込みを行う時間</u>が変更され た場合は当該変更後の時間内)とする。

 $(1) \sim (3)$ (略)

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<u>第1号から第3号まで</u>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。

 $4 \sim 6$ (略)

(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 3項ただし書の規定により<u>時限</u>が変更された 場合は当該時限)までとする。

$(1) \sim (3)$ (略)

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<u>各号</u>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。

 $4 \sim 6$ (略)

(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(同条第3項 ただし書の規定により時限が変更された場合はは、当該時限)まで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 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3 0分<u>まで</u>(同条第3項ただし書の規定によ り<u>申込みを行う時間</u>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。

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3 0分(同条第3項ただし書の規定により<u>時</u> 限が変更された場合は当該<u>時限</u>)<u>まで</u>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(以下「現金担保 付債券貸借取引等に係る利金相当額支払 債務」という。)を免責的に引き 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3 0分まで(同条第3項ただし書の規定によ り<u>申込みを行う時間</u>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<u>申込みを行う時間</u>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 <u>銘柄先決め現先取引等</u>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<u>まで</u>(<u>同条</u>第3項ただし書の規定 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3 0分(同条第3項ただし書の規定により時 限が変更された場合は当該時限)から取引 実行日の午後6時30分(同項ただし書の 規定により時限が変更された場合は当該 時限)までに行われた場合

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) 現先取引等

a 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(<u>第</u> 40条第3項ただし書の規定により<u>時限</u> により<u>申込みを行う時間</u>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 <u>銘柄先決め現先取引等</u>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<u>まで</u>(同条第3項ただし書の規定 により<u>申込みを行う時間</u>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 が変更された場合は当該<u>時限</u>) <u>まで</u>に行われた場合

当社は、当該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 ド取引受渡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 (スタート取引受渡日に授受する金銭の 額に係る支払債務、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 渡日までの間にスタート取引に係る買付 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(以下「現先取引等に 係る利金相当額支払債務」という。)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 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(同 条第3項ただし書の規定により時限が変 更された場合は当該時限)からスタート取 引受渡日の午後6時30分(同項ただし書 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<u>申込みを行う時間</u>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 <u>銘柄先決め現先取引等</u>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<u>まで</u>(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<u>申込みを行う時間</u>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、当該サブスティテューションについて、当該申込みの内容に基づき、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、

の規定により<u>時限</u>が変更された場合は当該時限)までに行われた場合

当社は、当該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(エンド取引受渡日 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 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(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時限が変更された場合は当該時限)までに行われた場合

当社は、当該サブスティテューションについて、当該申込みの内容に基づき、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41条第1項第1号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、サブスティテューション実 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、サブスティテューション実行日 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

同号dに掲げる債務、同号eに掲げる債 務、サブスティテュ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 エンド取引受渡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41条第1項第1号bに掲げる 債務、同号 cに掲げる債務、サブスティテ ュ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。

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) <u>個別銘柄取引 債務の引受けを行う日</u> <u>の午後6時30分</u>

(2) <u>銘柄後決め現先取引等のうち債務の引</u> 受けの申込みが午後2時から午後9時まで 2 前項に規定する債務の引受けは、債務引受け を行う日の前日の午後6時30分(第40条第 3項ただし書(第41条第3項において準用さ れる場合を含む。)の規定により時限が変更さ れた場合は当該時限)から当日の午後6時30 分(第40条第3項ただし書(第41条第3項 において準用される場合を含む。) の規定によ り時限が変更された場合は当該時限)までに債 務の引受けの申込みが行われたものについて その日の午後6時30分に行う。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 の時限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。

(新設)

<u>に行われたもの</u> 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) <u>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</u>債務の引受けの申込みが行われた日の午前11時
- (4) <u>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</u>債務の引受けの申込みが行われた日の午後2時

 $3 \sim 6$ (略)

(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) (略)
 - (2) 現金担保付債券貸借取引等
 - a (略)
 - 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<u>申込みを行う時間</u>が変 更された場合は当該変更後の時間内)まで 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、当該申込みの内容に基づき、貸 方清算参加者がその相手方である借方清 (新設)

(新設)

 $3 \sim 6$ (略)

(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) (略)
 - (2) 現金担保付債券貸借取引等
 - a (略)
 - 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(第42条第6項に おいて準用する第40条第3項ただし書 の規定により時限が変更された場合は当 該時限)までに行われたとき

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 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 <u>銘柄先決め現先取引等</u>についてスタート取引受渡日が、<u>銘柄先決め現先取引等</u>に係るサブスティテューションについてサブスティ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 <u>銘柄先決め現先取引等</u>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<u>銘柄先決め現先取引等</u>について、当該申込みの内容に基づき、現先売

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) 現先取引等

a 現先取引等についてスタート取引受渡日が、現先取引等に係るサブスティテューションについてサブスティテューション 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 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(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時限が変更された場合は当該時限)までに行われたとき

当社は、当該<u>現先取引等</u>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 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(<u>エンド</u> 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 当社は、第42条第2項に規定する届出が行われたときは、債務引受基準日の属する月の初日(休業日に当たるときは、順次繰り下げる。)から同項第3号に掲げる債務引受申込開始日の前日の午後6時30分まで(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)に行われた同項第1号に規定する事項を内容として行われた債務の引受けの申込みについては、債務の引受けの対象外とする。

3 (略)

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ティング)

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 者に対し負担する債務(エンド取引受渡日 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 当社は、第42条第2項に規定する届出が行われたときは、債務引受基準日の属する月の初日(休業日に当たるときは、順次繰り下げる。)から同項第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時限が変更された場合は当該時限)までに行われた同項第1号に規定する事項を内容として行われた債務の引受けの申込みについては、債務の引受けの対象外とする。

3 (略)

第5章 清算対象取引の決済

(新設)

(金銭決済債務、証券決済債務及び利金相当額決 済債務)

第46条 当社は、清算参加者ごとに、第44条 第1項及び前条第1項の規定により当社及び 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。

当該清算参加者が負担する債務 (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、銘柄及び決済日等(国債 証券の売買等における売買決済日、現金担保付 債券貸借取引等における取引実行日及び取引 決済日並びに現先取引等におけるスタート取 引受渡日及びエンド取引受渡日(第41条第1 項第1号に掲げる取引におけるサブスティテ ューション実行日を含む。)をいう。以下同じ。) を同一とする債務について、金銭の支払債務に ついては差引計算し残額を得るものとし、国債 証券の引渡債務については差引計算し残数量 を得るものとする。この場合において、当該金 銭の支払債務に係る差引計算における対当額 相当額及び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 ぞれ一の残額の金銭支払債務(以下「金銭決済 債務」という。) 及び一の残数量の証券引渡債 務(以下「証券決済債務」という。)に新たに 置き換わるものとする。

2 当社は、清算参加者ごとに、第44条第1項 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「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のネッティング)

第46条の2 当社は、清算参加者ごとに、第4 4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 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、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ティング)

第46条の3 当社は、清算参加者ごとに、第4 4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 (新設)

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 <u>個別銘柄取引に係る</u>証券決済債務時価評価 額は、<u>個別銘柄取引に係る</u>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 <u>個別銘柄取引に係る</u>受渡調整金額は、<u>個別銘</u> <u>柄取引に係る</u>金銭決済債務の額と<u>個別銘柄取</u> <u>引に係る</u>証券決済債務時価評価額との差額と する。

第48条 削除

(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金銭決済 債務の履行については、次項に規定する証券決 済債務時価評価額の金銭の授受及び第3項に 規定する受渡調整金額の金銭の授受により行 う。
- 2 証券決済債務時価評価額は、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 受渡調整金額は、金銭決済債務の額と証券決 済債務時価評価額との差額とする。

(国債DVP決済の方法及び時限)

- 第48条 証券決済債務に係る数量の国債証券 の授受及び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 規定するところにより、当社との間において行 う。
 - (1) 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。

- (2) 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 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。

(個別銘柄取引に係る受渡調整金額の金銭の授受)

- 第49条 <u>個別銘柄取引に係る</u>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) <u>個別銘柄取引に係る</u>金銭決済債務の額 が<u>個別銘柄取引に係る</u>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、<u>個別銘柄取</u>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) <u>個別銘柄取引に係る</u>金銭決済債務の額 が<u>個別銘柄取引に係る</u>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、<u>個別銘柄取</u> <u>引に係る</u>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 (受渡調整金額の金銭の授受)

- 第49条 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) 金銭決済債務の額が証券決済債務時価 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、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、受渡調整金額の金銭を当社から受領するものとする。

(2) 金銭決済債務の額が証券決済債務時価 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、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、受渡調整金額の金銭を当社から受領するものとする。

当社から受領するものとする。

(<u>個別銘柄取引に係る</u>利金相当額決済債務<u>の</u>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 債務に係る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

(バスケットネッティング)

第50条の2 当社は、清算参加者ごとに、第4 4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 <u>に、バスケット及</u>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/R ewind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)

(利金相当額決済債務に係る額の金銭の授受)

第50条 利金相当額決済債務に係る支払方清 算参加者は利金相当額決済債務<u>に係る</u>額の金 銭を当社に支払うものとし、利金相当額決済債 務に係る受領方清算参加者は利金相当額決済 債務<u>に係る</u>額の金銭を当社から受領するもの とする。

(新設)

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/Un wind金銭支払債務」という。
 - (1) スタート金銭支払債務及びRewin d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/Rewind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/Rewind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/Unwind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/Unwind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 ティング)

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/Rewind国債引渡債務(個別銘柄)及びエンド/Unwind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、差別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。

(新設)

(銘柄後決め現先取引等に係る金銭のネッティ ング)

第50条の6 当社は、清算参加者ごとに、第5 0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/Rew ind金銭支払債務及びエンド/Unwin 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 (新設)

(銘柄後決め現先取引等に係る利金相当額のネッティング)

たに置き換わるものとする。

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 <u>銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務</u> 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 <u>銘柄後決め現先取引等に係る受渡調整金額</u> 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。 (新設)

- (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 (新設)

(新設)

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) <u>銘柄後決め現先取引等(第44条第2</u> <u>項第2号に定める時刻に第50条の5及び</u> <u>第50条の6の規定により新たに置き換え</u> 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) <u>銘柄後決め現先取引等(第44条第2</u> <u>項第3号に定める時刻に第50条の5及び</u> 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。

第4節 フェイル

(フェイルの取扱い)

第51条 前条に規定する決済について、国債証 | 第51条 第48条の決済について、国債証券の

(新設)

(フェイルの取扱い)

券の渡方清算参加者がフェイルを発生させた 渡方清算参加者がフェイル (決済日等において

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<u>には</u>、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<u>は、次の各号に掲げ</u> 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 前条の規定(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 前条の規定(第1項第1号、第3号及び第4号の規定を 除く。)

4 (略)

(フェイルチャージの授受)

第52条 フェイルに係る<u>決済の</u>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<u>決</u> <u>済の</u>受方清算参加者に支払うものとする。

2 (略)

同条第1項第1号に規定する時限までに国債 証券の引渡しが行われないことをいう。以下同 じ。)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は、フェイルの場合における決済日(前項の規定により繰り延べられた決済が行われる日をいう。以下同じ。)に行うものとする。
- 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」 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。

(新設)

(新設)

4 (略)

(フェイルチャージの授受)

- 第52条 前条第1項に規定する場合は、フェイルに係る渡方清算参加者は、当社が定める金額のフェイルチャージ(フェイルに係る渡方清算参加者に対し金銭負担として賦課されるものをいう。以下同じ。)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受方清算参加者に支払うものとする。
- 2 (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っては、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<u>決済の</u>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<u>決済の</u>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。

(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 前項の場合は、当該フェイルに係る受方清算 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 (略)

(バイ・イン)

第55条 当社は、<u>バイ・インを行うことができ</u> <u>る</u>。

2 (略)

(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<u>(第1項第2号から第4号までの規定を除く。)</u>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<u>第50条の11</u> 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。

3 (略)

(バイ・イン)

- 第55条 当社は、フェイルの場合において、当 該フェイルの決済を完了させることを目的と して、清算参加者から国債証券を買い付けるこ とができるものとし、当該買付け(以下「バイ・ イン」という。)は、当該フェイルに係る渡方 清算参加者の計算により当社の名において行 うものとする。
- 2 (略)

(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(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。以下同じ。)の額及び国債証券の数量とする。
- 2 <u>第48条</u>の規定は、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<u>第48条第1項</u>第1号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。

(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│第58条 フェイルに係る受方清算参加者は、フ

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 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 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)

者は、参加者バイ・インを行うことができる。

2 (略)

(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<u>(第1項第2号の規定を除</u> <u>く。)</u>は、前項に規定する金銭の授受について 準用する。

3 (略)

(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<u>決済の</u>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

エイルに係る決済を完了させることを目的として、国債証券を買い付けることができるものとし、当該買付け(以下「参加者バイ・イン」という。)は、当社の計算により当該清算参加者の名において行うものとする。

2 (略)

(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条の規定は、前項に規定する金銭の授受について準用する。

3 (略)

(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 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

<u>る証券決済債務時価評価額</u>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<u>(第1項第2号の規定を除</u> <u>く。)</u>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<u>決済の</u>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)

第61条 フェイルに係る<u>決済の</u>受方清算参加者は、当該フェイルを起因として<u>統一慣習バイ・イン</u>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

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)

第61条 フェイルに係る受方清算参加者は、当該フェイルを起因として日本証券業協会が定める統一慣習規則第4号「債券のフェイルの解消に関する規則」(以下「統一慣習規則」という。)に規定するバイ・イン(以下「統一慣習バイ・イン」という。)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<u>(第1項第2号の規定を除</u> く。) は、前項に規定する金銭の授受について 準用する。

3 (略)

(統一慣習バイ・イン通知の対象であるフェイル に係る<u>決済の</u>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<u>決済の</u>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・インに係る売買代金の額と当該統一慣習バイ・インに係る<u>個別銘柄取引に係る</u>証券決済債務時価評価額<u>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</u>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<u>(第1項第2号の規定を除</u> <u>く。)</u>は、前項に規定する金銭の授受について 準用する。

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条の規定は、前項に規定する金銭の授 受について準用する。

3 (略)

(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 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。

(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

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。

(変動証拠金の預託)

- 第65条 清算参加者は、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、<u>第44条第1項及び第45条</u> 第1項の規定により債務の引受けを行った清 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

生じた日の翌日に当社より預託を受けるものとする。

(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<u>掲げる金銭ごとに、当該各号に定める</u>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1 0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1 0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

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。

(FOS決済)

第68条 第49条、第50条、第52条、第5 3条、第54条、第65条、第66条、第67 条及び第70条の8第4項の規定により行う 金銭の授受は、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。

(新設)

(新設)

(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、次の各号に規定するところにより、当社との間において行う。
 - (1) 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。
 - (2) 受領方清算参加者は、決済日等の午前 11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。

- 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 (略)

(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。

(緊急当初証拠金<u>による当初証拠金所要額の変</u> 更)

第70条の4 <u>当社</u>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 (略)

(当初証拠金の所要額)

第70条 第15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(以下「当初 証拠金所要額」という。) は、当社が規則で定 める。

(当初証拠金の預託)

第70条の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、当該不足額が生じた日の翌日の午前11時までに当社に追加預託しなければならない。

(緊急当初証拠金の預託)

第70条の4 清算参加者は、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お いて、当該清算参加者が当社に預託している当 初証拠金が当社が定める緊急当初証拠金所要 2 当社は、<u>前項の規定により当初証拠金所要額</u> 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。

(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。 額に満たないときは、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、当該不足額 が生じた日の午後3時30分までに当初証拠 金として当社に預託しなければならない。

2 当社は、<u>緊急当初証拠金の預託を行わせる</u>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。

(国債店頭取引清算基金の所要額)

第70条の5 第15条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(以下「国債店頭取引清算基金所要額」と いう。) は、当社が規則で定める。

(国債店頭取引清算基金の預託)

第70条の6 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(第77条の2に規定する破綻等をいう。)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

(代用国債証券)

第70条の8 (略)

2 (略)

- 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

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、当該不足額が生じた日の翌日の午 前11時までに当社に追加預託しなければな らない。

(代用国債証券)

第70条の8 (略)

2 (略)

- 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<u>(第1項の規定により</u> <u>預託される国債証券をいう。以下同じ。)</u>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。

たものとみなす。

5 (略)

(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。

(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<u>参加者決済</u> <u>に係る支払債務</u>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) (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

5 (略)

(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条の2から第70条の4まで及び第70条の6から第70条の8まで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。

(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<u>金銭決済債</u> 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) (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 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6 2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) (略)
 - (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<u>銘柄先決め現先取引</u>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

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<u>金銭決済債務</u>、 証券決済債務及び<u>利金相当額決済債務</u>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4 8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) (略)
- (2) 清算参加者その他の者を相手方とした 現金担保付債券貸借取引
- 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 算参加者から現金担保付債券貸借取引により 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

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<u>銘柄先決め現先</u> 取引の相手方とならなければならない。

3 (略)

(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、850条 011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 · 3 (略)

(調達資金の返済等)

第76条 第74条第1項<u>又は</u>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 · 3 (略)

(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<u>参加者決済に係る支払債務</u>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 (略)

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<u>現金担保付</u> 債券貸借取引の相手方とならなければならな い。

3 (略)

(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、 $\underline{$ 第48条 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 $\underline{$ お いて行うものとする。

2 · 3 (略)

(調達資金の返済等)

第76条 第74条第1項<u>及び</u>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 · 3 (略)

(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<u>金銭決済債務</u>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 (略)

(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<u>破綻認</u>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) • (3) (略)

(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(第78第1項又は第2項各号のいずれかに掲げる事由をいう。以下同じ。)を認定した場合には、その旨及び当社が破綻等を認定した日(以下「破綻認定日」という。)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、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<u>(第78条</u> 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
 - $(2) \cdot (3)$ (略)

(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<u>申立て</u> があったとき。
 - $(2) \sim (6)$ (略)
 - (7) 当社と清算参加者との間の<u>参加者決済</u> <u>に係る支払債務</u>の全部又は一部を履行しな いとき。

(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<u>申立</u>が あったとき。
 - $(2) \sim (6)$ (略)
 - (7) 当社と清算参加者との間の、証券決済 債務時価評価額に係る支払債務、受渡調整金 額に係る支払債務、利金相当額決済債務、第 <u>52条に規定するフェイルチャージに係る</u> 支払債務、第53条に規定する利金相当額に 係る支払債務、第54条に規定する元利金相 当額に係る支払債務、第56条第1項及び第 57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、第57条第1項に規定す るバイ・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、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 の支払債務及び参加者バイ・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、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参加者バイ・ インの対象であるフェイルに係る証券決済 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、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

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、<u>一括清算事由</u>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。 フェイル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、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、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、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 支払債務並びに第80条の7第2項に規定 する入札対象取引に係る支払債務(以下「参 加者決済に係る支払債務」という。) の全部 又は一部を履行しないとき。

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

- 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) (略)
 - (2) 国債証券引渡返還債務については、次 oa bc c sc に掲げる債務ごとに、当該 abc c sc から c sc に定める額とする。

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4 6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 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) (略)
 - (2) 国債証券引渡返還債務については、次の a 及び b に掲げる債務ごとに、当該 a 及び b 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/Rewind国債引渡債務
 (バスケット)及びエンド/Unwind
 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)·(b) (略)

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/Rewind国債引渡 債務 (バスケット) 及びエンド/Unwi nd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)·(b) (略)

<u>スタート/Rewind国債引渡債務</u><u>(バスケット)及びエンド/Unwind</u>国債引渡債務 (バスケット)

<u>破綻処理入札の結果に基づき、当社が定</u> める金額

 $3 \sim 7$ (略)

(差引計算)

第80条 (略)

- 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) (略)
 - (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。

 $a \sim d$ (略)

e <u>個別銘柄取引に係る</u>証券決済債務<u>、銘柄</u> 後決め現先取引等に係る証券決済債務、ス a 当社が負担する国債証券引渡返還債務 次の(a)及び(b)に規定する額の合 計額

(a)·(b) (略)

b 清算参加者が負担する国債証券引渡返 環債務

次の(a)及び(b)に規定する額の合 計額

(a)·(b) (略)

(新設)

 $3 \sim 7$ (略)

(差引計算)

第80条 (略)

- 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) (略)
 - (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。

 $a \sim d$ (略)

e 証券決済債務<u>及び第55条の規定によ</u> り当社が負担するバイ・インに係る国債証

 タート/Rewind国債引渡債務 (バス

 ケット)及びエンド/Unwind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<u>銘柄先</u> 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 (略)

- 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/Unwind国債引渡債 務(バスケット)にあっ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。)を支払うことによっても履行するこ 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/Unwind国債引渡債務 (バスケット)にあっ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っても履行させることができ、か

券引渡債務

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<u>現金担</u> 保付債券貸借取引に関し当社が負担する 国債証券引渡債務

g (略)

- 3 第1項の相殺における当社が負担する<u>当初</u> 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、破 旋時証拠金代用預託残高に係る返還債務、証券 決済債務、第55条の規定により当社が負担す るバイ・インに係る国債証券引渡債務及び第8 0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 うことによっ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証券決済債務、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、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及び第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、その購入代金総額に当該購入に要した費用を加算した額の

つ、かかる履行を選択して、相殺するものとする。

5~8 (略)

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・11 (略)

(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 · 3 (略)

4 <u>前3項</u>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。 合計額をいう。)を清算参加者に支払わせることによっ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。

5~8 (略)

9 清算参加者が当社に預託した他の清算業務 (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。以下同じ。)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・11 (略)

(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<u>(第80条の3に定める破綻処理入札をいう。)</u>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。

2·3 (略)

4 <u>前各項</u>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<u>破綻清算参加者</u>を当事者とする<u>破綻処理対象ポジション</u>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、<u>次の各号に掲げる破綻処理</u> 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。
 - <u>(1)</u> バスケット破綻処理入札

スタート/Rewind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/Unwind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<u>き銘柄後</u> (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<u>清算参加者(以下「破綻清算参加者」という。)</u>を当事者とする<u>清算対象取引に基づく債権債務で未決済のもの(以下「破綻処理対象ポジション」という。)</u>の処理を目的とする<u>取引を行うための入札(以下「破</u>綻処理入札」という。)を実施することができる。
- 2 破綻処理入札は、<u>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</u>する第二段階破綻処理入札に区分する。

(新設)

(新設)

(新設)

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国債証 決め現先取引並びに国債証券の売買及び<u>銘柄</u> 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 (略)

(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 (略)

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 査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。 券の売買及び<u>現金担保付債券貸借取引</u>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 (略)

(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 (略)

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<u>清算参加者(破綻 清算参加者を除く。)</u>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<u>清算参加者(破</u> <u>旋清算参加者を除く。)</u>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<u>(証券決済債</u> 務時価評価額に係る支払債務、受渡調整金額に 係る支払債務、第54条に規定する元利金相当 額に係る支払債務、第56条第1項及び第57 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、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支払債務、第74 条第1項第2号及び第2項に規定する清算参

- 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

- 加者を相手方とした現金担保付債券貸借取引 に係る支払債務並びに第80条の7第2項に 規定する入札対象取引に係る支払債務をい う。) 及び未決済証券ポジション (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、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及 び第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。) 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(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項及び第57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、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支払債務、第55条の規定により当社若しく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又は第58条の規定により清算参加者が負

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以、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 (略)

(入札対象取引の成立等)

第80条の7 (略)

- 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

担する参加者バイ・インに係る国債証券引渡債務のいずれかが当該一括清算の対象となるときは、当該バイ・イン等の対象であるフェイルに係る証券決済債務時価評価額に係る支払債務、受渡調整金額に係る支払債務及び証券決済債務は、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 (略)

(入札対象取引の成立等)

第80条の7 (略)

2 当社及び前項の清算参加者は、<u>同項の規定による入札対象取引の成立に伴い、</u>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。

(新設)

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。
- <u>5</u> 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。

(損失負担方式の区分)

第82条 <u>破綻処理損失の生存清算参加者</u>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

- 3 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。
- 4 前3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。

(損失負担方式の区分)

第82条 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(以下「破綻処理損失」という。)の破綻清算参加者以外の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

破綻清算参加者以外の清算参加者のうち 信託口(第86条第2項に規定する信託口を いう。以下この条において同じ。)を有する 者(以下「原取引按分清算参加者」という。) 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 (略)

(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 (略)

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) が、破綻処理損失に当社が規則で定める方法 により算出した割合(以下「原取引按分方式 負担割合」という。)を乗じた額(以下「原 取引按分方式対象損失総額」という。)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) 清算基金所要額按分方式

破綻清算参加者以外の清算参加者(信託口のみを有する者を除く。以下「清算基金所要額按分清算参加者」という。)が、破綻処理損失の額から原取引按分方式対象損失総額を控除した額(以下「清算基金所要額按分方式対象損失総額」という。)について、各清算基金所要額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 (略)

(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 (略)

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 <u>清算基金所要額按分方式</u>ごとに、<u>原取引按分方</u> <u>式対象損失総額</u>及び<u>清算基金所要額按分方式</u> 対象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。
- 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 の原取引按分清算参加者第二階層負担限度 額(第3号に規定する原取引按分清算参加者 第二階層負担限度額をいう。) 及び清算基金 <u>所要額按分清算参加者第二階層負担限度額</u> (第5号に規定する清算基金所要額按分清 算参加者第二階層負担限度額をいう。) 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り崩 <u>し</u>をすべき額と<u>清算基金所要額按分方式</u>に おいて取り崩しをすべき額に按分するもの

- (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<u>取崩し</u>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)から当該額を 控除した残額を上限とする。)とする。

とする。

- (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) 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、第二階層原 取引按分清算参加者負担総額に当社が規則 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 参加者の原取引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原 取引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 (第86条第2項に規定する信託口をいう。 以下この条において同じ。) 以外のネッティ ング口座を有する場合は信託口以外のネッ ティングロ座に係る額を除く。) をいう。以 下同じ。)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

(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

- 取引清算基金から取り崩された額があるときは、当該清算参加者の原取引按分清算参加者第二階層負担限度額から当該額を控除した残額を上限とする。)とする。
- (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 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<u>清算基金所要額按分清算参加者</u>(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

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、当該額を控除 した残額))

b 当該各<u>清算基金按分清算参加者</u>(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 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))

b 当該各清算基金所要額按分清算参加者 (上記 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 二階層清算基金所要額按分清算参加者負 担総額から上記 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 清算基金所要額按分清算参加者第二階層 則で定める額を控除する。)に応じて按分した額(当該残額が当該各清算参加者の<u>第</u> 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<u>清</u> 算基金按分清算参加者の<u>第二階層清算参</u> 加者負担限度額(清算基金按分))

- 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 <u>基金按分)</u>から a 及び<u>前</u> 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
- 2 各<u>生存清算参加者</u>、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<u>生存清算参加者</u>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

- 負担限度額 (当社が規則で定める額を控除する。) に応じて按分した額 (当該残額が当該各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の総額以上である場合には、当該各清算基金所要額按分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)
- 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 した清算基金所要額按分清算参加者(上記 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、 上記 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 ていたとすれば上記 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) 第二階層清算基金 所要額按分清算参加者負担総額から上記 a 及び 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
- 2 各清算参加者(破綻清算参加者を除く。以下 本項において同じ。) 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、当社及び各清算参加者から別段の意思表示

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、<u>第</u> 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、

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5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、第70条の6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6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、<u>当社が定めるところにより</u>、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。

(<u>第二階層清算参加者負担限度額(原取引按分)</u> 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

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、<u>破綻処理単位期間の終了日の翌日の午前11時までに</u>、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破綻清算参加者以外のすべての清算参加者(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。

(原取引按分清算参加者第二階層負担限度額の 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(当該清算参加者の原取引按分清算参加者第二階層負担限度額の未負担額(当該清算参加者の原取引按分清算参加者第二階層負担限度額のうち第83条の2の規定による国債店頭取引清算基金の取り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

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。)
 - 当該破綻清算参加者に係る第二段階破 (2)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。)

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 の原取引按分清算参加者第二階層負担限度 額の未負担額(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(当該清算参加者の原取引按分清算参加者第二階層負担 限度額の未負担額(当社が規則で定める額を控除 する。) を上限とする。) 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 次取崩額及び第1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、原取引按分清算参加者第二階 層負担限度額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及び前条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(以下この条において

(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 加者の原取引按分清算参加者第二階層負担限 度額の未負担額(当該清算参加者の原取引按分 清算参加者第二階層負担限度額のうち第83 条の2及び第83条の5の規定による国債店 頭取引清算基金の取り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破綻清算参加者以外の清算参加者のうち、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

「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 (略)

(破綻時証拠金の預託)

- 第83条の9 <u>生存清算参加者</u>は、当該<u>生存清算参加者</u>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 <u>生存清算参加者</u>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 <u>第70条の5第2項</u>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。

第6節 雜則

(破綻等の認定を行った場合のフェイルの取扱 い) 下この条において「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 (略)

(破綻時証拠金の預託)

- 第83条の9 清算参加者(破綻清算参加者を除 く。以下この条において同じ。) は、当該清算 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 <u>清算参加者</u>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、 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 <u>第70条の2</u>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。

第6節 雜則

- 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1 1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。
 - <u>(1)</u> 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5 0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。

(<u>債券等の現先取引に関する基本契約書</u>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<u>債券等の現先取引に関する基本契約書</u> 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。 (新設)

(新設)

(債券貸借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<u>債券貸借取引に関する基本契約書</u>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。 (ネッティング口座)

- 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<u>ネッティング口座</u> で処理するものとする。
- 2 ネッティングロ座は、通常口座、レポ専用ロ 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、ネッティングロ座の開設に際 し、当社の定めるところにより、ネッティング ロ座ごとにネッティングロ座の種類を当社に 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、<u>信託口</u>で処 理しなければならない。

(ネッティング口座の追加の申請)

(ネッティング口座)

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<u>当社における口座</u> (以下「ネッティング口座」という。) で処理 するものとする。

(新設)

(新設)

2 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、<u>信託に係る</u> 取引専用のネッティングロ座(以下「信託口」 という。)で処理しなければならない。

(ネッティング口座の追加の申請)

第87条 (略)

2 清算参加者は、ネッテ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、<u>前条第2項に規定するネッティング口座の種類を特定して</u>ネッティング口座の追加の申請を行わなければならない。

3 (略)

(複数のネッティングロ座を開設している清算 参加者の特例)

第90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、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	金銭支払返還	ネッティング口座
第 1 6	<u>債務</u>	ごとの金銭支払返
<u>号</u>		還債務
	当社と清算参	当社と清算参加者
	加者との間の	との間のネッティ
		ング口座ごとの
第 2 条	国債証券引渡	ネッティング口座
第 2 9	返還債務	ごとの国債証券引
<u>号</u>		渡返還債務
	当社と清算参	当社と清算参加者
	加者との間の	との間のネッティ
		<u>ング口座ごとの</u>
第2条	国債店頭取引	ネッティング口座
第 3 1	清算基金所要	ごとの国債店頭取
<u>号</u>	額	引清算基金所要額
	清算参加者が	清算参加者がネッ

第87条 (略)

2 清算参加者は、ネッティングロ座を追加して 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、ネッティングロ座の 追加の申請を行わなければならない。

3 (略)

(立口三几)

(複数のネッティングロ座を開設している清算 参加者の特例)

第90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、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。

(利取)			
(新設)			
(女に三凡)	_		
(新設)			

		ティングごとに
第2条	参加者決済に	ネッティング口座
第 4 0	係る支払債務	ごとの参加者決済
<u>另 </u>	N W J J J J J J J J J J J J J J J J J J	に係る支払債務
	当社と清算参	当社と清算参加者
	加者との間の	との間のネッティ
	79H L C *2 H J * 2	<u>ング口座ごとの</u>
第2条	第二階層清算	ネッティング口座
第60	参加者負担限	ごとの第二階層清
号	度額(原取引按	算参加者負担限度
	分)	額(原取引按分)
	国債店頭取引	ネッティング口座
	清算基金所要	ごとの国債店頭取
	額	引清算基金所要額
第2条	一 第二階層清算	ネッティング口座
第 6 1	参加者負担限	ごとの第二階層清
号	度額(清算基金	算参加者負担限度
	按分)	額(清算基金按分)
	当社に預託し	当社に預託したネ
	た国債店頭取	<u>ッティング口座ご</u>
	引清算基金	との国債店頭取引
		清算基金
第 2 条	当初証拠金所	ネッティング口座
第 7 3	<u>要額</u>	ごとの当初証拠金
<u>号</u>		所要額
	清算参加者が	清算参加者がネッ
		<u>ティングごとに</u>
第 2 条	未決済資金ポ	ネッティング口座
第 9 9	ジション	ごとの未決済資金
<u>号</u>		ポジション
	当社と清算参	当社と清算参加者
	加者との間の	との間のネッティ
		ングロ座ごとの
第 2 条	未決済証券ポ	ネッティング口座

(新設)		
(4		
(新設)		
(dam = 11)	_	
(新設)		
(新設)		
(新設)		
(//// // // // // // // // // // // // /		
(新設)		

	1	Τ	1 1			
第 1 0	ジション	ごとの未決済証券				
0号		<u>ポジション</u>				
	当社と清算参	当社と清算参加者				
	加者との間の	との間のネッティ				
		ング口座ごとの				
(略)				(略)		
第 4 6	清算参加者ご	清算参加者のネッ		(新設)		
<u>条の2</u>	<u>とに</u>	<u>ティング口座ごと</u>				
		<u>12</u>				
第 4 6	清算参加者ご	清算参加者のネッ		(新設)		
条の3	とに	ティング口座ごと				
		<u>12</u>				
第 5 0	清算参加者ご	清算参加者のネッ		(新設)		
条の2	<u>とに</u>	ティング口座ごと				
		<u>12</u>				
第 5 0	清算参加者は、	清算参加者は、ネッ		(新設)		
条の3		ティング口座ごと				
第1項		<u>に</u>				
第 5 0	当社が定める	当社が定めるとこ		(新設)		
<u>条の4</u>	ところにより、	ろにより、ネッティ				
		ングロ座ごとに				
第 5 0	清算参加者ご	清算参加者のネッ		(新設)		
<u>条の5</u>	<u>とに</u>	ティング口座ごと				
		<u>12</u>				
第 5 0	清算参加者ご	清算参加者のネッ		(新設)		
条の6	<u>とに</u>	ティング口座ごと				
		<u>E</u>				
第 5 0	清算参加者ご	清算参加者のネッ		(新設)		
<u>条の7</u>	<u> 논に</u>	ティング口座ごと				
		<u>12</u>				
(略)				(略)		
(略)				(略)		
第 6 7	清算参加者は、	清算参加者は、ネッ		(新設)		
<u>条</u>		ティング口座ごと				

		12
(略)		
(削る)		
第 7 0	(略)	(略)
<u>条</u>		
	(略)	(略)
	(略)	(略)
(略)		
(略)		
(削る)		
(削る)		
第 7 0	(略)	(略)
<u>条の5</u>		
(略)		•
(略)		
(略)		
第 7 8	(略)	(略)
条第1		
項		
	(削る)	
I I		

(略)		
第 7 0	清算参加者が	清算参加者がネッ
<u>条</u>		<u>ティング口座ごと</u>
		<u>K</u>
第 7 0	(略)	(略)
条の2		
	(略)	(略)
	(略)	(略)
(略)		
(略)	Г	
第 7 0	清算参加者は	清算参加者は、ネ
<u>条の4</u>		<u>ッティング口座ご</u>
		<u>とに</u>
	当初証拠金が	ネッティング口座
		ごとの当初証拠金
		<u>が</u>
	当社が定める	ネッティング口座
	緊急当初証拠	ごとに当社が定め
	金所要額	る緊急当初証拠金
tota — a)	所要額
第 7 0	清算参加者が	清算参加者がネッ
<u>条の5</u>		<u>ティングロ座ごと</u>
第 7 0	(四女)	<u>(こ</u> (皿を)
<u>第70</u> 冬の6	(略)	(略)
<u>条の6</u> (略)		
(略)		
(略)		
第 7 8	(略)	(略)
条第1	(#1)	\#H/
項		
	 当社と清算参	当社と清算参加者
	加者との間の	との間のネッティ
I	*** H C :> In1*>	<u> </u>

	(略)	(略)
第 7 9	すべての金銭	ネッティング口座
条第1	支払返還債務	ごとのすべての金
項	及び国債証券	銭支払返還債務及
	引渡返還債務	び国債証券引渡返
		還債務
	(削る)	(削る)
	(削る)	(削る)
	(削る)	(削る)
	 (削る)	(削る)
	(11,2)	(B)(S)
	 (削る)	(削る)
	, = /	/
	(削る)	(削る)
	(削る)	(削る)
	(削る)	(削る)

		<u>ング口座ごとの、</u>
	(略)	(略)
第 7 9	すべての金銭	ネッティング口座
条第1	支払返還債務	ごとのすべての金
項		銭支払返還債務
	参加者決済に	ネッティング口座
	係る支払債務	ごとの参加者決済
		に係る支払債務
	費用相当額に	<u>ネッティング口座</u>
	係る支払債務	ごとの費用相当額
		に係る支払債務
	当初証拠金及	ネッティング口座
	び国債店頭取	ごとの当初証拠金
	引清算基金の	及び国債店頭取引
	代用国債証券	清算基金の代用国
	の利金相当額	債証券の利金相当
	に係る支払債	額に係る支払債務
	<u>務</u>	
	当初証拠金金	ネッティング口座
	銭預託残高	ごとの当初証拠金
		金銭預託残高
	金銭により	ネッティング口座
		ごとに金銭により
	国債店頭取引	ネッティング口座
	清算基金金銭	ごとの国債店頭取
	<u>預託残高</u>	引清算基金金銭預
		<u> 託残高</u>
	破綻時証拠金	ネッティング口座
	金銭預託残高	ごとの破綻時証拠
		金金銭預託残高
	<u> 証券決済債務</u>	ネッティング口座
		ごとの証券決済債

ı		
	(削る)	(削る)
	(当17)	(出して)
	(削る)	(削る)
	(削る)	(削る)
	(削る)	(削る)
	 (削る)	(削る)
	(111 30)	(11, 0)
	(mfr)	(m/r)
	(略)	(略)
(略)		
同条第	(略)	(略)
2項		
	(略)	(略)
		ネッティング口座
	に係る証券決	ごとの個別銘柄取
	済債務	引に係る証券決済
		債務
	銘柄後決め現	ネッティング口座
	先取引等に係	ごとの銘柄後決め
	る証券決済債	現先取引等に係る

	<u>務</u>
国債証券引渡	ネッティング口座
<u>債務</u>	ごとの国債証券引
	<u>渡債務</u>
当初証拠金代	<u>ネッティング口座</u>
用預託残高	ごとの当初証拠金
	代用預託残高
代用国債証券	<u>ネッティング口座</u>
により	ごとに代用国債証
	券により
国債店頭取引	<u>ネッティング口座</u>
清算基金代用	ごとの国債店頭取
預託残高	引清算基金代用預
	<u> 託残高</u>
破綻時証拠金	<u>ネッティング口座</u>
代用預託残高	ごとの破綻時証拠
	金代用預託残高
(略)	(略)
(略)	(略)
(略)	(略)
証券決済債務	ネッティング口座
	ごとの証券決済債
	務
(新設)	(新設)
	債務 当初証拠金代用預託残高 代用国債証券により 国債基金の計算基金の付用預託残高 (略) (略) (略) (略) (略) (略) (略) (略) (部) (部)

	務	証券決済債務
	スタート/R	ネッティング口座
	e w i n d 国	ごとのスタート/
	債引渡債務(バ	Rewind国債
	スケット)	引渡債務(バスケッ
		F)
	エンド/Un	<u>・・・</u> ネッティング口座
	w i n d 国債	ごとのエンド/U
	引渡債務(バス	n w i n d 国債引
	ケット)	渡債務(バスケッ
		F)
	(略)	(略)
第 8 0	未決済資金ポ	ネッティング口座
条の5	ジション <u>及</u> び	ごとの未決済資金
第1項	未決済証券ポ	ポジション <u>及び未</u>
	ジション	決済証券ポジショ
		<u>v</u>
	(削る)	(削る)
	(削る)	(削る)
	(削る)	(削る)
	(削る)	(削る)
	(略)	(略)
第83	(略)	(略)
条の2		
第1項		
第3号		
	(略)	(略)

1		
	(新設)	(新設)
	/ 	(
	(新設)	(新設)
	(略)	(略)
第 8 0	未決済資金ポ	ネッティング口座
条の5	ジション	ごとの未決済資金
第1項		ポジション
	支払債務	ネッティング口座
		ごとの支払債務
	未決済証券ポ	ネッティング口座
	ジション	ごとの未決済証券
		ポジション
	証券決済債務	ネッティング口座
		ごとの証券決済債
		 務
	国債証券引渡	ユ ネッティング口座
	債務	ごとの国債証券引
		渡債務
	(略)	(略)
第 8 3	(略)	(略)
来の 2	\#U <i>1</i>	\ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \
第1項		
第3号	(m/s)	(m/s)
I	(略)	(略)

1			
	第二階層清算	ネッティング口座	
	参加者負担限	ごとの <u>第二階層清</u>	
	度額(原取引按	算参加者負担限度	
	<u>分)</u>	額(原取引按分)	
	(削る)	(削る)	
同条第	(略)	(略)	同
1項第			1
5号			5
	第二階層清算	ネッティング口座	
	参加者負担限	ごとの <u>第二階層清</u>	
	度額(清算基金	算参加者負担限度	
	<u>按分)</u>	額(清算基金按分)	
	(削る)	(削る)	
(略)			(
(略)			(
(略)			(
第83	当社に預託し	当社に預託したネ	第
条の5	た国債店頭取	ッティング口座ご	条
	引清算基金	との国債店頭取引	
		清算基金	
	第二階層清算	ネッティング口座	
	参加者負担限	ごとの <u>第二階層清</u>	
	度額(原取引按	算参加者負担限度	
	<u>分)</u>	額(原取引按分)	
第83	(略)	(略)	第
条の6			条
	第二階層清算	ネッティング口座	
	参加者負担限	ごとの <u>第二階層清</u>	
	<u> </u>	C C 1/2 /14 /11 /11	

	原取引按分清	ネッティング口座
	算参加者第二	ごとの <u>原取引按分</u>
	階層負担限度	清算参加者第二階
	<u>額</u>	層負担限度額
	国債店頭取引	ネッティング口座
	清算基金所要	ごとの国債店頭取
	額	引清算基金所要額
同条第	(略)	(略)
1 項第		
5号		
	清算基金所要	ネッティング口座
	額按分清算参	ごとの清算基金所
	加者第二階層	要額按分清算参加
	負担限度額	者第二階層負担限
	23-1202-120	度額
		<u>ネッ</u> ティングロ座
	清算基金所要	ごとの国債店頭取
	額	引清算基金所要額
(較)	<u> </u>	<u> </u>
(略)	1 22	J11177 Sad Sad // 1 25 195
(略)		J11177 Sas and // 1 25 PM
(略)		
(略) (略) 第83	当社に預託し	当社に預託したネ
(略)	当社に預託し た国債店頭取	当社に預託したネッティング口座ご
(略) (略) 第83	当社に預託し	当社に預託したネッティングロ座ごとの国債店頭取引
(略) (略) 第83	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ティングロ座ごとの国債店頭取引清算基金
(略) (略) 第83	当社に預託し た国債店頭取 引清算基金 原取引按分清	当社に預託したネッティング口座ごとの国債店頭取引清算基金ネッティング口座
(略) (略) 第83	当社に預託し た国債店頭取 引清算基金 原取引按分清 算参加者第二	当社に預託したネッティング口座ごとの国債店頭取引 清算基金 ネッティング口座 ごとの原取引按分
(略) (略) 第83	当社に預託し た国債店頭取 引清算基金 原取引按分清 算参加者第二 階層負担限度	当社に預託したネッティング口座ごとの国債店頭取引 清算基金 ネッティング口座 ごとの原取引按分 清算参加者第二階
(略) (略) 第83 条の5	当社に預託した国債店頭取引清算基金 原取引按分清算参加者第二 階層負担限度 額	当社に預託したネッティングロ座ごとの国債店頭取引清算基金 ネッティングロ座ごとの原取引按分 清算参加者第二階 層負担限度額
(略) (略) 第83 条の5	当社に預託し た国債店頭取 引清算基金 原取引按分清 算参加者第二 階層負担限度	当社に預託したネッティング口座ごとの国債店頭取引 清算基金 ネッティング口座 ごとの原取引按分 清算参加者第二階
(略) (略) 第83 条の5	当社に預託した国債店頭取引清算基金 原取引按分清算参加者第二 階層負担限度 額	当社に預託したネッティングロ座ごとの国債店頭取引清算基金 ネッティングロ座ごとの原取引按分 清算参加者第二階 層負担限度額
(略) (略) 第83 条の5	当社に預託した国債店頭取引清算基金 原取引按分清算参加者第二 階層負担限度 額	当社に預託したネッティングロ座ごとの国債店頭取引清算基金 ネッティングロ座ごとの原取引按分 清算参加者第二階 層負担限度額
(略) (略) 第83 条の5	当社に預託した国債店頭取引清算基金 原取引按分清算参加者第二 階層負担限度 額 (略)	当社に預託したネッティングロ座ごとの国債店頭取引清算基金ネッティングロ座ごとの原取引按分清算参加者第二階層負担限度額(略)

	<u>分)</u>	額(原取引按分)
(略)		
(略)		
第 8 3	生存清算参加	生存清算参加者は、
条の9	<u>者</u> は	ネッティング口座
第1項		ごとに
(略)		
(略)		

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、一のネッティング単位(ネッティング口座 及び第40条第2項第4号bに規定するネッ 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。)を一のネッティング口座と みなして適用する。

3 (略)

4 (略)

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ティング口座とみなして適用する。

(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

	<u>額</u>	層負担限度額
(略)		
(略)		
第83	清算参加者(破	清算参加者(破綻
条の9	<u>綻清算参加者</u>	清算参加者を除
第1項	を除く。以下こ	<u>く。以下この条に</u>
	の条において	<u>おいて同じ。)</u> は、
	<u>同じ。)</u> は	ネッティング口座
		ごとに
(略)		
(略)		

(新設)

2 (略)

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70条から第70条の8まで、第73条、第78条、第80条及び第80条の2から第80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ティング口座とみなして適用する。

(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<u>決済日等</u>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 (略)

(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 生取引であって、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。

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<u>決済日</u>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 (略)

(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、当該売買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(本業務方法書に基づく規則を含む。)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

(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。

(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) (略)
 - (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
 - $(5) \sim (8)$ (略)
 - (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) (略)

2 (略)

(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。
- から生じる権利義務について紛議が生じた場 ら生じる権利義務について紛議が生じた場合

充当することができる。

(附帯業務)

第98条 当社は、金融商品債務引受業等(第2 条に規定するものに限る。) に附帯する業務を 行う。

(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 書等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3条に規定する清算対象取引に関す る事項
 - (2) (略)
 - (3) 第2章第4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5節に規定する清算参加者に 対する措置等に関する事項
 - $(5) \sim (8)$ (略)
 - (9) 前条に規定する本業務方法書等の変更 の方法に関する事項
 - (10) (略)

2 (略)

(準拠法及び合意管轄)

- 第101条 本業務方法書の準拠法は、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 | 2 当社と清算参加者との間で本業務方法書か

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 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。

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。

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

(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<u>第4条第1項</u>に規定する当 社が定める<u>もの</u>は、次の各号に掲げる<u>国債証券</u> (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。)

 $(2) \cdot (3)$ (略)

- 2 業務方法書<u>第4条第2項</u>に規定する当社が 定める<u>もの</u>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

(新設)

(清算対象取引)

- 第2条 業務方法書<u>第3条第1項</u>に規定する当 社が定める<u>国債証券</u>は、次の各号に掲げる<u>もの</u> (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(<u>物価連動国債(物価連動国</u>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。)

(2) • (3) (略)

- 2 業務方法書<u>第3条第2項</u>に規定する当社が 定める<u>取引</u>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。)(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。以下同じ。))とする。以下

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 (略)

(2) 現金担保付債券貸借取引等

a · b (略)

- c 対象国債証券の数量が額面5万円(変動 利付国債<u>及び物価連動国債</u>にあっては額 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。

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)であること。

(新設)

d (略)

(2) 現金担保付債券貸借取引等

a · b (略)

- c 対象国債証券の数量が額面5万円(変動 利付国債にあっては額面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(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)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。

<u>f</u> (略)

- 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

 $a \sim c$ (略)

- d 対象国債証券の数量が額面5万円(変動 利付国債<u>及び物価連動国債</u>にあっては額 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

(新設)

<u>e</u> (略)

(新設)

(3) 現先取引等

 $a \sim c$ (略)

- d 対象国債証券の数量が額面5万円(変動 利付国債にあっては額面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(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)であること。

(新設)

f 利付国債の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。)に経過利子(額面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。以下同じ。)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

に利払期日に支払うものをいう。) である こと。

- <u>h</u> 売買金額算出比率(<u>銘柄先決め現先取引</u> <u>等</u>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
 - <u>a</u> 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。
 - <u>c</u> 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 <u>当社は、設定したバスケットを廃止し又は指</u> 定の内容を変更することができる。

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。

g 売買金額算出比率 (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

(新設)

(新設)

- 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4 5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)
 - $(2) \sim (5)$ (略)

(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債務のすべてについて親会社が保証を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、同条第3項に規定する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)

 $(2) \sim (5)$ (略)

2 (略)

(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。

(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。

 $(1) \sim (7)$ (略)

(8) 純財産額(金融商品取引業者以外の者にあっては、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)。

 $(9) \sim (21)$ (略)

(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 2 (略)

(新設)

(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。

 $(1) \sim (7)$ (略)

(8) 純財産額(金融商品取引業者以外の者にあっては、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、当該清算参加者が業務方法書第6条第2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10億円を下回ったとき、当該清算参加者が同条第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)。

 $(9) \sim (21)$ (略)

に基づく関係会社に関する報告書を作成し <u>たとき。</u>

 $(22) \sim (37)$ (略)

- (略)
- 3 親会社等保証を受けている清算参加者にあ っては、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号にあって 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号にあっ 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 あっては、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20 0億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 4 前項において、親会社が第1項第25号に該 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 |

 $(22) \sim (37)$ (略)

- 2 (略)
- 3 業務方法書第6条第2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あ っては、同第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。
 - 親会社が第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号にあっては、 同項第5号に基づき既に親会社に係る報告 を行っている場合を、同項第6号にあって は、同項第7号に基づき既に親会社に係る報 告を行っている場合を、同項第20号にあっ ては、同項第21号に基づき既に親会社に係 る報告を行っている場合を除く。)。
 - (2) 親会社の純財産額(金融商品取引業者 以外の者にあっては、純資産額とする。)が 200億円を下回ったとき。

当することとなった場合の報告においては、第 3項本文に定めるもののほか、親会社が作成し 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。

(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。) にあっては、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って 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<u>当初証拠金所要額</u>」とあ るのは、「清算参加者のネッティング口座ごと の<u>当初証拠金所要額</u>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<u>当初証拠金所</u> 要額」とあるのは、「当該親会社等である清算 参加者のネッティング口座ごとの当初証拠金

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。

(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基礎所要額 (信託口に係るものを除く。以下第4項までに おいて同じ。)(業務方法書第6条第2項の申請 により国債店頭取引清算資格を取得した清算 参加者にあっては、当該清算参加者の当初証拠 金基礎所要額に当該清算参加者の親会社の当 初証拠金基礎所要額を加算した額、同項の申請 により国債店頭取引清算資格を取得した清算 参加者の親会社である清算参加者にあっては、 当該親会社の当初証拠金基礎所要額に同項の 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(当該親会社が同項に規定する保証 をする者に限る。) の当初証拠金基礎所要額を 加算した額)とする。
- 2 複数のネッティングロ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<u>当初証拠金基礎所要額</u>」 とあるのは、「清算参加者のネッティングロ座 ごとの<u>当初証拠金基礎所要額</u>の合計額」と、「当 該親会社の当初証拠金基礎所要額」とあるの は、「当該親会社のネッティングロ座ごとの当 初証拠金基礎所要額の合計額」と読み替えるも のとする。

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ティングロ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ために親会社等保証を行う親会社等保証を行う親会社等保証特例適用先のために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親会社等(当該親会社等保証特例適用先の規会社等(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。)のネッティングロ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 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。
- 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

- 3 業務方法書第6条第2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の親 会社が複数のネッティング口座を開設してい る場合において、同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(当該親会社 が同項に規定する保証をする者に限る。) につ いて第1項の規定を適用するときは、「当該清 算参加者の親会社の当初証拠金基礎所要額」と あるのは、「当該清算参加者の親会社のネッティング口座ごとの当初証拠金基礎所要額の合 計額」と読み替えるものとする。
- 4 <u>業務方法書第6条第2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</u>が複数のネッティング口座を開設している場合において、当該清算参加者の親会社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、「清算参加者(当該親会社が同項に規定する保証をする者に限る。)の当初証拠金基礎所要額」とあるのは、「清算参加者(当該親会社が同項に規定する保証をする者に限る。)のネッティング口座ごとの当初証拠金基礎所要額の合計額」と読み替えるものとする。
- 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<u>a(a)</u>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。
- 6 業務方法書第28条第5項第2号に規定す る当社が定める額は、当該清算参加者の信託口 の当初証拠金基礎所要額(複数の信託口を開設

いる清算参加者にあっ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。

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<u></u>同第43条第1 項<u>及び同第50条の3第1項</u>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。

(債務の引受けの申込み等)

2 業務方法書第40条第1項、同第41条第1 項及び同第42条第1項に規定する申込みで 物価連動国債を対象とする清算対象取引に係 るものは、当該申込みを行う清算参加者が国債 店頭取引清算業務に関する手数料に関する規 則第3条第3項の規定により適用を受ける物 価連動国債に係る手数料について届け出てい る場合に限り行うことができる。

(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

(債務の引受けの申込み等の方法)

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項及び同第43条第 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。

している清算参加者にあっては当該清算参加

者の信託口の当初証拠金基礎所要額の合計額)

(新設)

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<u>第48条第2項</u>(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7

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 (略)

(割当可能残高通知の取扱い)

第12条の2 業務方法書第50条の3第1項 に規定する通知に渡方となる清算参加者から 引き渡すことのできる国債証券の銘柄として 物価連動国債を含めようとする場合には、当該 通知を行う清算参加者が国債店頭取引清算業 務に関する手数料に関する規則第3条の2第 3項の規定により適用を受ける物価連動国債 に係る手数料について届け出ている場合に限 り、当該通知に含めることができる。

(銘柄割当ての方法)

第12条の3 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 0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項に規定する証券決済債務時価評価額は、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(当該銘柄が変動利付国債である場合にあっては、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(休業日を含む。)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 (略)

(新設)

て負担するバスケットネッティングが行われ た日を決済日等とするスタート/Rewin d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/Rew ind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、一のネッティ ング単位(ネッ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ることなく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<u>第50条の11第1項及び第2項</u>(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<u>清算対象取</u>引の区分に<u>応じ</u>、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) (略)
 - (b) 業務方法書<u>第50条の11第2項</u> 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)

(国債DVP決済の方法)

- 第13条 業務方法書<u>第48条第1項第1号及び第2号並びに第2項</u>(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<u>従い</u>、当該 a 又は b に定めるところにより行う。

(新設)

<u>a</u> (略)

<u>b</u> 業務方法書<u>第48条第2項</u>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

を行う。この場合において、同<u>第50条</u> 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) <u>業務方法書第50条の11第2項</u> <u>に規定する代理人の口座と当社の口座</u> 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) (略)

- 2 業務方法書<u>第50条の11</u>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

う。この場合において、同<u>第48条第2項</u> 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。

(新設)

(2) (略)

- 2 業務方法書<u>第48条第1項第1号及び第2</u> 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<u>第48条第2項</u>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

「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 (略)

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<u>第50条の11第2項</u>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) (略)

3 (略)

(フェイルチャージの計算式等)

第14条 (略)

- 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) (略)
 - (2) 受渡金額とは、フェイルに係る<u>決済の</u> 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っては、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っては、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 • 4 (略)

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 (略)

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<u>第48条第2項</u>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) (略)

3 (略)

(フェイルチャージの計算式等)

第14条 (略)

- 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) (略)
 - (2) 受渡金額とは、フェイルに係る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から起算してフェイルが解消された日の前日までの期間をいう。

3 • 4 (略)

(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 (略)

(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 <u>する。)</u>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<u>銘柄先</u> 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

(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 (略)

(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) 現金担保付債券貸借取引等及び<u>現先取</u> <u>引等</u>

決済日等ごと、銘柄ごとの現金担保付債券

貸借取引等及び<u>銘柄先決め現先取引等</u>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<u>及び</u>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、計算目 (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 貸借取引等及び<u>現先取引等</u>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<u>ごと、</u>銘柄ごとに当社が定める割引率を使用して算出した、<u>計算日の</u>レギュラー受渡日における現在価値(<u>計算日の</u>レギュラー受渡日が利払期日 (休業日に当たるときは、順次繰り下げる。以下同じ。)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とする。

(新設)

(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、計算日の レギュラー受渡日における現在価値(計算日の 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 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。

(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、<u>次の各</u> 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) 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

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。

(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、<u>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利回りの平均値により、計算日のレギュラー受渡日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(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。</u>

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Rewind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 (略)

(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。 (新設)

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利回りの平均値により、計算日のレギュラー受渡日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(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 (略)

- (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 <u>に関する規則第2条第2項に規定する三回</u> 目算出証拠金所要額に係るもの 不足額発 生日の午後5時

(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翌日の午 前10時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 | 2 前項の定めるところにより預託された金銭

(新設)

(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7 0条の2及び第70条の4第1項並びに第7 0条の6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。

に係る業務方法書第70条の3第1項及び<u>同</u> 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<u>による当初証拠金所要額の変</u> 更の取扱い)

第23条 (略)

- 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 <u>社等保証特例適用先</u>にあっては、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 あっては、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) に当社が あらかじめ定めた率を乗じた額を変更後の当 初証拠金所要額とすることで行う。
- 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、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ティング口座ご

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。

(緊急当初証拠金の取扱い)

第23条 (略)

- 2 業務方法書第70条の4第1項に規定する 緊急当初証拠金所要額は、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 する各清算参加者の当初証拠金基礎所要額(業 務方法書第6条第2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あって は、当該清算参加者の当初証拠金基礎所要額に 当該清算参加者の親会社の当初証拠金基礎所 要額を加算した額、同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の親会社 である清算参加者にあっては、当該親会社の当 初証拠金基礎所要額に同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(当該 親会社が同項に規定する保証をする者に限 る。) の当初証拠金基礎所要額を加算した額) に当社があらかじめ定めた率を乗じた額とす る。
- 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、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基礎所要額」とあるのは、「清算参加者のネッティング口座ごとの当初証拠金基礎所要額の合計額」と、「当該親会社の当初証拠金基礎所要額」とあるのは、「当該親会社のネッティング口座ごとの当初証拠金基礎所要額の合計額」と読み替えるも

との<u>当初証拠金所要額</u>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。)が複数のネッティングロ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親会社等保証を行う親会社等保証特例適用先の親会社等保証を行う親会社等保証特例適用先の規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。)のネッティングロ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。

6 (略)

(代用国債証券の取扱い)

第24条 (略)

2 <u>業務方法書第70条の8第1項に規定する</u> 代用預託で物価連動国債をもって行うものは、 のとする。

- 4 業務方法書第6条第2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の親 会社が複数のネッティングロ座を開設してい る場合において、同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(当該親会社 が同項に規定する保証をする者に限る。) につ いて第2項の規定を適用するときは、「当該清 算参加者の親会社の当初証拠金基礎所要額」と あるのは、「当該清算参加者の親会社のネッティングロ座ごとの当初証拠金基礎所要額の合 計額」と読み替えるものとする。
- 5 業務方法書第6条第2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が複 数のネッティングロ座を開設している場合に おいて、当該清算参加者の親会社である清算参 加者について第2項の規定を適用するときは、 「清算参加者(当該親会社が同項に規定する保 証をする者に限る。)の当初証拠金基礎所要額」 とあるのは、「清算参加者(当該親会社が同項 に規定する保証をする者に限る。)のネッティ ングロ座ごとの当初証拠金基礎所要額の合計 額」と読み替えるものとする。

6 (略)

(代用国債証券の取扱い)

第24条 (略)

当該代用預託を行う清算参加者が国債店頭取 引清算業務に関する手数料に関する規則第3 条第3項又は第3条の2第3項の規定により 適用を受ける物価連動国債に係る手数料につ いて届け出た場合に限り行うことができる。

3 (略)

<u>4</u> (略)

- 5 業務方法書第70条の8第1項に規定する 当社が定める<u>もの</u>は、第2条第1項に規定する 国債証券とする。
- 6 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、 <u>物価連動国債、</u>分離元本振替国債及び分離利 息振替国債を除く。)

 $a \sim f$ (略)

(2) (略)

(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95

c 残存期間5年超10年以内のもの

100分の93

d 残存期間10年超20年以内のもの

100分の93

2 (略)

3 (略)

- 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<u>国債証券</u>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 銘柄に係る利回りの平均値により、預託日を基 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、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 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、 分離元本振替国債及び分離利息振替国債を 除く。)

 $a \sim f$ (略)

(2) (略)

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93

(4) (略)

(5)(略)

<u>7</u> (略)

8 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 (略)

- 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) (略)
 - (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<u>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</u>の平均額(円位未満は切り捨てる。)とする。

3 • 4 (略)

(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

(3)(略)

(4)(略)

<u>6</u> (略)

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(休業日を含む。)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 (略)

- 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) (略)
- (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<u>当初証拠金基礎所要額</u>(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1項に規定する当初証拠金基礎所要額をいう。)の平均額(円位未満は切り捨てる。)とする。

3 • 4 (略)

(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<u>(休業日を除外する。)</u>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<u>(休業日を除外する。)</u>の日までの日数に応じた経過利子<u>(円位未満は切り捨てる。)</u>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 合に応じて、当該各号に定める日とする。
 - (1) <u>当初の決済日等が当該渡方清算参加者</u> に係る破綻認定日又は破綻認定日の翌日で <u>ある場合</u>

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

算事由が発生した日から起算して3日目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利回りの平均値により、一括清算事由が発生した日から起算して3日目の日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、一括清算事由が発生した日から起算して3日目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日目の日までの日数では、一括清算事由が発生した日から起算して3日目の日までの日数では、1000円を記算して3日目の日までの日数では、1000円にでは過利子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
 - <u>破綻認定日から起算して3日目(休業日を</u> 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

(ネッティングロ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。

(ネッティング口座の追加等の申請)

第31条 (略)

(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|第32条 業務方法書第90条第3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。

様式第1号 保証に関する書面の様式

(新設)

第27条から第30条まで 削除

(新設)

(ネッティング口座に係る申請)

第31条 (略)

(当初証拠金グループに係る届出)

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。

保証書

<u>平成</u> <u>年</u> <u>月</u> <u>日</u>

 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。)を経由して、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

<u>みますが、これに限られません。)を、本清算</u> 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。

<u>以</u>上

様式第2号 清算参加者契約に関する書面の様 式 (新設)

国債店頭取引清算参加者契約書

平成 年 月 日

 <th rowspan="2" color="1" c

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。

<u>以</u> 上

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。

国債店頭取引清算業務に関する手数料に関する規則の一部改正新旧対照表

新

1.

(口座管理手数料)

(口座管理手数料)

第2条 (略)

2 前項に規定する口座管理手数料は、月額<u>18</u> <u>0万円</u>とする。ただし、2以上のネッティング 口座等(業務方法書第86条に規定するネッティング口座及び業務方法書第90条<u>第3項</u>に 規定する当初証拠金グループをいう。以下この 条において同じ。)を開設している清算参加者 については、当該額に、当該清算参加者が開設 するネッティング口座等の数から1を減じた 数に<u>10万円</u>を乗じて得た額を加算した金額 とする。

3 (略)

(債務引受手数料)

第3条 (略)

- 2 前項に規定する債務引受手数料<u>(月額)</u>は、 各清算参加者の次の各号に掲げる取引につい て、当該各号に定めるところによる。
 - (1) 国債証券の売買等

当社が債務の引受けの申込みを受けた清算対象取引(業務方法書第43条の規定により申込みが取り消された取引を含む。以下この項において同じ。)について、業務方法書第40条第2項第1号 e に規定する売買決済日に授受する金銭の額に、次のa b 及び c に掲げる国債証券ごとに当該a b 及び c に定める率を乗じた金額

a 国庫短期証券

月間2,000億円以下の部分 万分の0.002

第2条 (略)

2 前項に規定する口座管理手数料は、月額<u>50</u>万円とする。ただし、2以上のネッティングロ座等(業務方法書第86条に規定するネッティング口座及び業務方法書第90条<u>第2項</u>に規定する当初証拠金グループをいう。以下この条において同じ。)を開設している清算参加者については、当該額に、当該清算参加者が開設するネッティング口座等の数から1を減じた数に<u>20万円</u>を乗じて得た額を加算した金額とする。

旧

3 (略)

(債務引受手数料)

第3条 (略)

2 前項に規定する債務引受手数料は、各清算参加者の次の各号に掲げる取引について、当該各号に定めるところによる。

(1) 国債証券の売買等

当社が債務の引受けの申込みを受けた清算対象取引(業務方法書第43条の規定により申込みが取り消された取引を含む。以下この項において同じ。)について、業務方法書第40条第2項第1号 dに規定する売買決済日に授受する金銭の額に、次のa及びbに掲げる国債証券ごとに当該a及びbに定める率を乗じた金額

a 国庫短期証券万分の0.0005

月間2,000億円を超え4,000億円以下の部分

万分の0.0015

月間4,000億円を超え1兆円以下の 部分

万分の0.001

月間1兆円を超え3兆円以下の部分

万分の0.00075

月間3兆円を超える部分

万分の0.0003

b <u>利付国債(物価連動国債を除く。)及び</u> 割引国債(国庫短期証券を除く。)

月間1兆円以下の部分

万分の0.004

月間1兆円を超え2兆円以下の部分

万分の0.003

月間2兆円を超え4兆円以下の部分

万分の0.002

月間4兆円を超え7兆円以下の部分

万分の0.0015

月間7兆円を超える部分

万分の0.0006

c 物価連動国債

第3項に掲げる料率Aを選択している 場合

万分の0.08

第3項に掲げる料率Bを選択している 場合

万分の0.16

(2) 現金担保付債券貸借取引等<u>、銘柄先決め</u> 現先取引等及び銘柄後決め現先取引等

当社が債務の引受けの申込みを受けた清 算対象取引について、業務方法書第40条第 2項第2号eに規定する取引決済日に授受 b <u>a に掲げるもの以外の国債証券</u> 万分の0.002

(新設)

(2) 現金担保付債券貸借取引等

当社が債務の引受けの申込みを受けた清 算対象取引について、業務方法書第40条第 2項第2号dに規定する取引決済日に授受 する金銭の額、業務方法書第40条第2項第 3号eに規定するエンド受渡金額(同第2条 第38号a (b) に規定する当初現先取引等 のエンド取引受渡日に授受する金銭の額及 び同条第96号に規定する変更後銘柄現先 取引等のエンド取引受渡日に授受する金銭 の額を含む。)及び業務方法書第40条第2 項第4号eに規定するエンド受渡金額の合 計額に、次のa、b、c及びdに掲げる取引 ごとに当該a、b、c及びdに定める金額

a オーバーナイト取引(取引決済日が取引 実行日の翌日(休業日に当たるときは、順 次繰り下げる。)である現金担保付債券貸 借取引等、エンド取引受渡日(業務方法書 第2条第38号に掲げる取引にあっては、 当初現先取引等のエンド取引受渡日)がス タート取引受渡日の翌日(同号に掲げる取 引にあっては、サブスティテューション実 行日の翌日) (休業日に当たるときは、順 次繰り下げる。) である銘柄先決め現先取 引等及びエンド取引受渡日がスタート取 引受渡日の翌日(休業日に当たるときは、 順次繰り下げる。) である銘柄後決め現先 取引等をいう。以下同じ。) のうち利付国 債(物価連動国債を除く。)、割引国債及び 銘柄後決め現先取引等のうち物価連動国 債を対象としないバスケットに係る取引 (a) に掲げる取引ごとに定める日数を乗 じた金額の合計額について、(b) に掲げ る率を乗じた金額

(a)

現金担保付債券貸借取引等 貸借期 間(取引実行日の翌日から取引決済日ま での期間(休業日を含む。)をいう。) する金銭の額に、次の a $\underline{\mathcal{B}U}$ b に掲げる取引 ごとに当該 a $\underline{\mathcal{B}U}$ b に定める率を乗じた金 額

a オーバーナイト取引(取引決済日が取引 実行日の翌日(休業日に当たるときは、順 次繰り下げる。)である取引をいう。) 万 分の0.0001に貸借期間(取引実行日 の翌日から取引決済日までの期間(休業日 を含む。)をいう。)の日数を乗じた率

(b)

月間20兆円以下の部分 万分の0.0003

月間20兆円を超え30兆円以下の 部分

万分の0.00018

月間30兆円を超え50兆円以下の 部分

万分の0.00009

月間50兆円を超え80兆円以下の 部分

万分の0.00006

月間80兆円を超え100兆円以下 の部分

<u>万分の0.00003</u> 月間100兆円を超える部分 万分の0.00001

b <u>オーバーナイト取引</u>以外の取引<u>のうち、</u> 利付国債(物価連動国債を除く。)、割引国 債及び銘柄後決め現先取引のうち物価連 動国債を対象としないバスケットに係る 取引 次に掲げる率を乗じた金額 月間1兆5,000億円以下の部分 b <u>a に掲げるもの</u>以外の取引 <u>万分の 0.</u> 0 0 1 万分の0.003

月間1兆5,000億円を超え2兆

5,000億円以下の部分

万分の0.0018

月間2兆5,000億円を超え5兆円

以下の部分

万分の0.0009

月間5兆円を超え8兆円以下の部分

万分の0.0006

月間8兆円を超え10兆円以下の部

<u>分</u>

万分の0.0003

月間10兆円を超える部分

万分の0.0001

c オーバーナイト取引のうち物価連動国 債及び銘柄後決め現先取引のうち物価連 動国債を対象とするバスケットに係る取 引 (a) に掲げる取引ごとに定める日数 を乗じた金額の合計額について、(b) に 掲げる率を乗じた金額

(a)

現金担保付債券貸借取引等 貸借期 間(取引実行日の翌日から取引決済日ま での期間(休業日を含む。)をいう。)

鉱柄先決め現先取引等 取引期間 (スタート取引受渡日の翌日からエンド取引受渡日までの期間 (業務方法書第2条38号aに掲げる取引にあっては、サブスティテューション実行日の翌日から当初現先取引等のエンド取引受渡日までの期間) (休業日を含む。) をいう。)

<u>銘柄後決め現先取引等</u>取引期間(ス <u>タート取引受渡日の翌日からエンド取</u> 引受渡日までの期間(休業日を含む。)

<u>をいう。)</u>

(b)

第3項に掲げる料率Aを選択している場合万分の0.0004第3項に掲げる料率Bを選択している場合万分の0.0012

d オーバーナイト取引以外の取引のうち 物価連動国債及び銘柄後決め現先取引の うち物価連動国債を対象とするバスケットに係る取引 次に掲げる率を乗じた金額

第3項に掲げる料率Aを選択している場合万分の0.004第3項に掲げる料率Bを選択している場合万分の0.015

(削る)

(新設)

<u>(3)</u> 現先取引等

当社が債務の引受けの申込みを受けた清算対象取引について、業務方法書第40条第2項第3号 d に規定するエンド取引受渡日に授受する金銭の額(同第41条第1項第1号 b に規定する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及び同項第2号に規定する変更後銘柄現先取引等のエンド取引受渡日に授受する金銭の額を含む。)に、次のa及び b に掲げる取引ごとに当該a及び b に定める率を乗じた金額

a オーバーナイト取引(エンド取引受渡日 (業務方法書第41条第1項第1号に掲 げる取引にあっては、当初現先取引等のエ ンド取引受渡日)がスタート取引受渡日の 翌日(同号に掲げる取引にあっては、サブ スティテューション実行日の翌日)(休業 日に当たるときは、順次繰り下げる。)で ある取引をいう。) 万分の0.0001

に取引期間(スタート取引受渡日の翌日からエンド取引受渡日までの期間(業務方法書第41条第1項第1号に掲げる取引にあっては、サブスティテューション実行日の翌日から当初現先取引等のエンド取引受渡日までの期間)(休業日を含む。)をいう。)の日数を乗じた率

 b
 a に掲げるもの以外の取引
 万分の0.

 0 0 1

(新設)

- 3 前項第1号c又は同第2号c及びdに掲げる取引について債務引受の申込みを行う清算参加者は、当社が定めるところにより料率A又は料率Bを選択しなければならない。その場合において、次の各号に掲げる金額を前項によって算出された金額に加算する。
 - (1) 国債証券の売買等

料率Aを選択している場合月額50万円料率Bを選択している場合月額10万円(2) 現金担保付債券貸借取引等、銘柄先決め現先取引等及び銘柄後決め現先取引等料率Aを選択している場合月額30万円料率Bを選択している場合月額10万円

(銘柄割当てに係る手数料)

- 第3条の2 清算参加者は、銘柄割当てに係る手 数料を当社に納入しなければならない。
- 2 前項に規定する銘柄割当てに係る手数料(月額)は、次の各号に定める金額の合計額とする。
 (1)銘柄割当手数料 銘柄割当てにおいて国債証券の渡方清算参加者について銘柄割当ての対象となるスタート/Rewind国債引渡債務(バスケット)に係る受渡金額から銘柄割当てにおいて物価連動国債が割り当てられたときの当該物価連動国債に係る

時価評価額(国債店頭取引清算業務に関する 業務方法書の取扱い第12条の3に規定す るものをいう。以下同じ。)を控除した金額 に次に掲げる率を乗じた金額

月間5,000億円以下の部分

万分の0.0036

月間 5,000億円を超え2兆5,000億 円以下の部分

万分の0.0032

月間2兆5,000億円を超え10兆円以下 の部分

万分の0.0028

月間10兆円を超え15兆円以下の部分

万分の0.0018

月間15兆円を超える部分

万分の0.0005

(2)物価連動国債割当手数料 銘柄割当てに おいて国債証券の渡方清算参加者について 銘柄割当ての対象となるスタート/Rew ind国債引渡債務 (バスケット) に係る受 渡金額のうち銘柄割当てにおいて物価連動 国債が割り当てられたときの当該物価連動 国債に係る時価評価額に次に掲げる率を乗 じた金額

第3項に掲げる料率Aを選択している場合 万分の0.003

第3項に掲げる料率Bを選択している場合方分の0.007

- (3) 超過割当手数料 超過割当て(業務方法 書の取扱い第12条の3第2項に規定する 場合に、同項の規定により行う銘柄割当てを いう。) の件数に5万円を乗じた金額
- 3 <u>銘柄後決め現先取引等の割当可能残高通知</u> に物価連動国債を含める清算参加者は、当社が

定めるところにより料率A又は料率Bを選択 しなければならない。その場合において、次の 各号に掲げる金額を前項によって算出された 金額に加算する。

料率Aを選択している場合 月額20万円 料率Bを選択している場合 月額10万円

(DVP決済手数料)

第6条 (略)

- 2 前項に規定するDVP決済手数料は、次の各 号に定める金額の合計額とする。
 - (1) 業務方法書<u>第50条の11第1項又は</u> 第2項(同第51条<u>第3項</u>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 下同じ。)に規定する国債証券の授受のため に、清算参加者(同<u>第50条の11第2項</u>に 規定する代理人を含む。)と当社との間で行 われた国債証券に係る口座振替件数に<u>15</u> 0円を乗じて得た金額
 - (2) 業務方法書第57条第1項、同第59 条第1項、同第60条第1項、同第62条第 1項及び同第63条第1項に規定する金銭 の授受の件数に150円を乗じて得た金額
- 3 業務方法書第51条<u>第4項</u>の規定によりフェイルに係る決済が行われたとき並びに同第54条第1項及び第2項の規定により金銭の授受が行われたときは、同第51条<u>第3項</u>の規定によりフェイルに係る決済が行われたものとみなして前項第1号の規定を適用する。
- 4 第一段階破綻処理入札及び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の ための国債証券及び金銭の授受については、前 3項の規定を準用する。

(DVP決済手数料)

第6条 (略)

- 2 前項に規定するDVP決済手数料は、次の各 号に定める金額の合計額とする。
 - (1) 業務方法書<u>第48条第1項又は第2項</u> (同第51条<u>第4項</u>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。以下同 じ。)に規定する国債証券の授受のために、 清算参加者(同<u>第48条第2項</u>に規定する代 理人を含む。)と当社との間で行われた国債 証券に係る口座振替件数に<u>200円</u>を乗じ て得た金額
 - (2) 業務方法書第57条第1項、同第59条第1項、同第60条第1項、同第62条第1項及び同第63条第1項に規定する金銭の授受の件数に200円を乗じて得た金額
- 3 業務方法書第51条<u>第5項</u>の規定によりフェイルに係る決済が行われたとき並びに同第54条第1項及び第2項の規定により金銭の授受が行われたときは、同第51条<u>第4項</u>の規定によりフェイルに係る決済が行われたものとみなして前項第1号の規定を適用する。

(参加者端末利用手数料)

- 第8条 清算参加者は、<u>参加者端末</u>利用手数料を 当社に納入しなければならない。
- 2 前項に規定する<u>参加者端末</u>利用手数料は、各 清算参加者が有する<u>参加者端末</u>(当社との間に おいて国債店頭取引清算業務に係る決済情報 の照会等を行うための清算参加者が設置する 端末装置をいう。)を利用するためのユーザー ID数の月中における最大の数について、1ユ ーザーIDにつき月額10,000円とする。

(証明書発行手数料)

第9条 清算参加者は、当初証拠金残高証明書、 国債店頭取引清算基金残高証明書、<u>破綻時証拠</u> 金残高証明書、特別清算料担保金残高証明書、 変動証拠金残高証明書及び参加者端末関連登 録情報証明書の交付を受けた場合には、1通に つき3,000円の証明書発行手数料を当社に 納入しなければならない。

(委託分に係る取扱い)

第10条 国債店頭取引他社清算参加者及び信託口を有する清算参加者については、第2条の規定にかかわらず、有価証券等清算取次ぎに係るネッティング口座(当社が定めるところにより当該国債店頭取引他社清算参加者と同一の企業集団(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。)に属す顧客に係るものを除く。)及び信託口であるネッティング口座(以下「委託分に係るネッティングロ座という。)に係る同条に規定する手数料の合計額は月額200万円を上限とし、第3条から第6条までの規定にかかわらず、委託分に係るネッティング口座に係る当該各条(第3条第2項

(WEB端末利用手数料)

- 第8条 清算参加者は、WEB端末利用手数料を 当社に納入しなければならない。
- 2 前項に規定するWEB端末利用手数料は、各 清算参加者が有するWEB端末(当社との間に おいて国債店頭取引清算業務に係る決済情報 の照会等を行うための清算参加者が設置する 端末装置をいう。)を利用するためのユーザー ID数の月中における最大の数について、1ユ ーザーIDにつき月額10,000円とする。

(証明書発行手数料)

第9条 清算参加者は、当初証拠金残高証明書、 国債店頭取引清算基金残高証明書、変動証拠金 残高証明書及びWeb端末関連登録情報証明 晝の交付を受けた場合には、1通につき3,0 00円の証明書発行手数料を当社に納入しな ければならない。

(手数料の限度額)

- 第10条 国債店頭取引自社清算参加者については、第2条から前条までの規定にかかわらず、当該各条に規定する手数料の合計額は、月額500万円を上限とする。
- 2 国債店頭取引他社清算参加者については、第 2条から前条までの規定にかかわらず、当該各 条に規定する手数料の合計額は、月額500万 円に有価証券等清算取次ぎに係る第3条に規 定する債務引受手数料を加算した額を上限と する。

第1号c、同第2号c及びd、第3項、第3条 の2第2項第2号並びに第3項を除く。)に規 定する手数料の合計額は、月額500万円を上 限とする。

2 委託分に係るネッティングロ座及び委託分に係るネッティングロ座以外のネッティングロ座を有する清算参加者については、当社が定めるところにより按分された委託分に係るネッティングロ座に相当する部分について前項の規定を適用する。

(物価連動国債に係る取扱い)

- 第10条の2 第3条第3項各号及び第3条の 2第3項に規定する物価連動国債に係る手数 料について清算参加者は当社が定めるところ によりそれぞれ料率A又は料率Bを選択する こと、料率を変更すること及び選択している料 率を取りやめることができる。
- 2 第3条第3項各号及び第3条の2第3項に 規定する物価連動国債に係る手数料のいずれ かについて、料率A及び料率Bのいずれも選択 していない清算参加者が新たに料率A又は料 率Bを選択する場合は、当該選択の日から1年 間に限り、当該選択に係る手数料の金額にそれ ぞれ月額10万円を加算する。
- 3 前項に規定する加算は業務方法書第6条第 4項に規定する資格取得申請者が国債店頭取 引清算参加者資格の取得時に第3条第3項各 号及び第3条の2第3項に規定する物価連動 国債に係る手数料について料率A又は料率B を選択した場合には、当該選択に係る手数料に ついては行わない。

別表1 残高管理手数料の額の計算に関する表

(新設)

別表1 残高管理手数料の額の計算に関する表

各清算参加者の残高管理手数料の金額は、計算日ごとに第1項に定める計算式により算出した金額の月間合計額に第2項に定める率を乗じた金額とする。

1 計算日ごとの対象金額

=決済日等を同一とする各清算参加者と当社 との間の金銭決済債務の額の合計額

× 次の営業日までの日数 ÷ 365

<u>2</u> 料率

月間2,000億円以下の部分

万分の0.033

月間2,000億円を超え3,000億円以下 の部分

万分の0.031

月間3,000億円を超える部分

万分の0.029

- (注) 1 金銭決済債務<u>は、個別銘柄取引に係る金銭決済債務、銘柄後決め現先取引等に係る金銭決済債務並びに第一段階破綻処理入札及び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のために授受する金銭に係る債務を含む。</u>
 - 2 個別銘柄取引に係る金銭決済債務並 びに第一段階破綻処理入札及び第二段 階破綻処理入札により成立した入札対 象取引の決済のために授受する金銭に 係る債務については、決済日等が計算日 から起算して2日目(休業日を除外す る。)の日以降に到来する債務を対象と する。

各清算参加者の<u>日々の</u>残高管理手数料の金額は、<u>次の</u>計算式により算出した<u>決済日等ごとの残高管理手数料をすべての決済日等につい</u>て合計した金額とする。

決済日等ごとの残高管理手数料

=決済日等を同一とする各清算参加者と当社 との間の金銭決済債務の額の合計額

× 次の営業日<u>の前日</u>までの日数 ÷ 36

5 <u>×</u> 万分の0.09

(新設)

(注) 1 金銭決済債務<u>については、決済日等が</u>計算日から起算して2日目(休業日を除外する。)の日以降に到来する清算対象取引に係る債務に限る。

- 3 銘柄後決め現先取引等に係る金銭決済債務については、決済日等が計算日から起算して2日目(休業日を除外する。)の日以降に到来する債務について、決済日等を同一とするエンド/Unwind国債引渡債務(バスケット)及びスタート/Rewind国債引渡債務(バスケット)を差引計算し得られた残額を対象とする。
- 4 次の営業日の前日までの日数は、計算 日から計算日の次の営業日までの日数 (休業日を含む。)とする。

別表 2 期日管理手数料の額の計算に関する表 (略)

- (注) 1 各清算参加者からその日に引き受けた 債務に係る清算対象取引は、当該清算対 象取引の決済日等(現金担保付債券貸借 取引等にあっては取引決済日、<u>銘柄先決</u> <u>め現先取引等</u>にあってはエンド取引受 渡日)が債務引受日から起算して<u>3日目</u> (休業日を除外する。)の日以降に到来 する取引に限る。
 - 2 清算対象取引における取引金額は、国 債証券の売買等については業務方法書 第40条第2項第1号<u>e</u>に規定する売 買決済日に授受する金銭の額、現金担保 付債券貸借取引等については同項第2 号<u>e</u>に規定する取引決済日に授受する 金銭の額、<u>銘柄先決め現先取引等</u>につい ては同項第3号<u>e</u>に規定する<u>エンド受</u> 渡金額(同第2条第38号bに規定する 当初現先取引等のエンド取引受渡日に 授受する金銭の額及び同条第96号に

(新設)

2 次の営業日の前日までの日数は、計算 日から計算日の次の営業日<u>の前日</u>まで の日数(休業日を含む。)とする。

別表 2 期日管理手数料の額の計算に関する表 (略)

- (注) 1 各清算参加者からその日に引き受けた 債務に係る清算対象取引は、当該清算対 象取引の決済日等(現金担保付債券貸借 取引等にあっては取引決済日、<u>現先取引</u> 等にあってはエンド取引受渡日)が債務 引受日から起算して<u>4日目</u>(休業日を除 外する。)の日以降に到来する取引に限 る。
 - 2 清算対象取引における取引金額は、国 債証券の売買等については業務方法書 第40条第2項第1号<u>d</u>に規定する売 買決済日に授受する金銭の額、現金担保 付債券貸借取引等については同項第2 号<u>d</u>に規定する取引決済日に授受する 金銭の額、<u>現先取引等</u>については同項第 3号<u>d</u>に規定するエンド取引受渡日に 授受する金銭の額(同第41条第1項第 1号bに規定する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及

規定する変更後銘柄現先取引等のエン ド取引受渡日に授受する金銭の額を含 む。)とする。

3 決済日等までの超過日数は、計算日から起算して<u>2日目</u>(休業日を除外する。)の日の翌日から決済日等(現金担保付債券貸借取引等にあっては取引決済日、<u>銘</u>柄先決め現先取引等及び銘柄後決め現 先取引等にあってはエンド取引受渡日)までの日数(休業日を含む。)とする。

付 則

- 1 この改正規定は、平成30年5月1日から施 行する。ただし第3条の2第2項第3号の超過 割当手数料は、当分の間、適用しない。
- 2 前項の規定にかかわらず第10条の2第2 項及び第3項の規定は平成31年4月1日か ら適用する。
- 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。

- び<u>同項第2号</u>に規定する変更後銘柄現 先取引等のエンド取引受渡日に授受す る金銭の額を含む。)とする。
- 3 決済日等までの超過日数は、計算日から起算して3日目(休業日を除外する。)の日の翌日から決済日等(現金担保付債券貸借取引等にあっては取引決済日、現 先取引等にあってはエンド取引受渡日)までの日数(休業日を含む。)とする。

国債店頭取引清算業務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

H.

(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2の規定に基づき、当初証拠金所要額に関する事項を定める。

新

(当初証拠金所要額)

- 第2条 各清算参加者の当初証拠金所要額は、清 算参加者ごとに別表「<u>当初証拠金所要額</u>の算出 に関する表」により算出される額とする。
- 2 前項に規定する当初証拠金所要額の算出は、 当該算出を行う日(以下「計算日」という。) の午前7時、午前11時及び午後2時に行うも のとする。この場合において、午前7時に算出 された当初証拠金所要額を「一回目算出証拠金 所要額」と、午前11時に算出された当初証拠 金所要額を「二回目算出証拠金所要額」と、午 後2時に算出された当初証拠金所要額を「三回 目算出証拠金所要額」という。
- 3 前2項の規定にかかわらず、新たに清算資格を取得した者の当初証拠金所要額は、その者の会社規模、その取引実績及び見込み、清算資格の取得の申請を行った日における各清算参加者の当初証拠金所要額を合計した額を清算参加者数で除して得た金額等を勘案のうえ、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。

(当初証拠金所要額の変更)

(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条の規定に基づき、当初証拠金所要額を 定める。

(当初証拠金所要額)

第2条 各清算参加者の当初証拠金所要額は、清算参加者ごとに別表「<u>当初証拠金基礎所要額</u>の算出に関する表」により算出される額<u>(以下「当初証拠金基礎所要額」という。)と10億円のいずれか大きい額とする。</u>

(新設)

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当初証拠金所要額は、その者の会社規模、その取引実績及び見込み、清算資格の取得の申請を行った日における各清算参加者の当初証拠金所要額を合計した額を清算参加者数で除して得た金額等を勘案のうえ、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。

(当初証拠金所要額の変更)

第3条 当社は、清算参加者が次の各号に掲げる 事項に該当することとなったときは、前条の規 定にかかわらず、当社が必要と認める期間、当 該清算参加者の当初証拠金所要額(第2号に該 当することとなった場合には信託口に係るも のを除く。)を引き上げることができる。

(1) (略)

- (2)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。以下この号において同 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。) にあっては、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。以下本号において同 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 算参加者にあっては、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)が、当該清算参加者(親会社等保 証特例適用先にあっては、当該親会社等保証 特例適用先の親会社等)の純財産額(金融商 品取引業者以外の者にあっては、純資産額又 はこれに相当する額) に当社が定める率を乗 じた額以上となったとき。
- 2 当社は、信託の受託者である清算参加者の信託口の<u>当初証拠金所要額</u>(複数の信託口を開設している清算参加者にあっては当該清算参加者の信託口の<u>当初証拠金所要額</u>の合計額)が、当該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1から別表第1項第2号<u>(注)</u>1.に定める時価変動リスクファクターのうち

第3条 当社は、清算参加者が次の各号に掲げる 事項に該当することとなったときは、前条の規 定にかかわらず、当社が必要と認める期間、当 該清算参加者の当初証拠金所要額(第2号に該 当することとなった場合には信託口に係るも のを除く。)を引き上げることができる。

(1) (略)

- (2)清算参加者の当初証拠金基礎所要額(信 託口に係るものを除く。以下この号において同 じ。)(業務方法書第6条第2項の申請により清 算資格を取得した清算参加者にあっては、当該 清算参加者の当初証拠金基礎所要額に当該清 算参加者の親会社の当初証拠金基礎所要額を 加算した額、同項の申請により清算資格を取得 した清算参加者の親会社である清算参加者に あっては、当該親会社の当初証拠金基礎所要額 に同項の申請により清算資格を取得した清算 参加者(当該親会社が同項に規定する保証をす る者に限る。) の当初証拠金基礎所要額を加算 した額)が、当該清算参加者(同項の申請によ り清算資格を取得した清算参加者にあっては、 当該清算参加者の親会社)の純財産額(金融商 品取引業者以外の者にあっては、純資産額)に 当社が定める率を乗じた額以上となったとき。
- 2 当社は、信託の受託者である清算参加者の信託口の<u>当初証拠金基礎所要額</u>(複数の信託口を開設している清算参加者にあっては当該清算参加者の信託口の<u>当初証拠金基礎所要額</u>の合計額)が、当該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1から別表第1項第2号a(a)に定める時価変動リスクファクタ

最大のものを100で除した値を差し引いた値を乗じた額に当社が定める率を乗じた額以上となったときは、前条の規定にかかわらず、当社が必要と認める期間、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っては当該清算参加者の信託口ごとの当初証拠金所要額)を引き上げることができる。

3 (略)

(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4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、次の表の上欄に掲げる 規定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 2 条	(削る)	(削る)
<u>第3項</u>		
	(略)	新たに清算資格を
		取得した者 <u>又は新</u>
		たにネッティング
		口座を開設した清
		<u>算参加者</u> のネッテ
		ィング口座ごとの
		当初証拠金所要額
(略)		
第 3 条	清算参加者の	清算参加者のネッ
第 1 項	当初証拠金所	ティング口座ごと
第2号	要額	の当初証拠金所要

一のうち最大のものを100で除した値を差し引いた値を乗じた額に当社が定める率を乗じた額以上となったときは、前条の規定にかかわらず、当社が必要と認める期間、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っては当該清算参加者の信託口ごとの当初証拠金所要額)を引き上げることができる。

3 (略)

(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4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、次の表の上欄に掲げる 規定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 2 条	新たに清算資	新たに清算資格を
第2項	格を取得した	取得した者又は新
	<u>者</u>	たにネッティング
		口座を開設した清
		算参加者
	(略)	新たに清算資格を
		取得した者のネッ
		ティング口座ごと
		の当初証拠金所要
		額
(略)		
第 3 条	清算参加者の	清算参加者のネッ
第 1 項	当初証拠金基	ティング口座ごと
第2号	· 一礎所要額	の当初証拠金基礎

		額の合計額
	当該 <u>親会社等</u>	当該親会社等であ
	である清算参	る清算参加者のネ
	加者の当初証	ッティング口座ご
	拠金所要額	との <u>当初証拠金所</u>
		要額の合計額
(略)		

2 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。)が複数のネッティングロ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次の表の上欄に掲げる規定を適用するときは、この規定の同表の中欄に掲げる字句は、同表の下欄に掲げる字句に読み替えるものとする。

第 3 条	当該親会社等	当該 <u>親会社等保証</u>
第 1 項	保証特例適用	特例適用先の親会
第2号	先の親会社等	<u>社等</u> のネッティン
	の <u>当初証拠金</u>	グロ座ごとの当 <u>初</u>
	所要額	証拠金所要額の合
		計額

3 親会社等保証特例適用先が複数のネッ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次の表の上欄に掲げる規定を適用するときは、この規定の同表の中欄に掲げる字句は、同表の下欄に掲げる字句に読み替えるものとする。

第 3 条	清算参加者(当	当該親会社等特例
		適用先のネッティ
第2号	同項に規定す	ング口座ごとの <u>当</u>

		<u>所要額</u> の合計額
	当該 <u>親会社の</u>	当該 <u>親会社</u> のネッ
	当初証拠金基	ティング口座ごと
	礎所要額	の当初証拠金基礎
		所要額の合計額
(略)		

2 <u>業務方法書第6条第2項の申請により清算</u> <u>資格を取得した清算参加者の親会社</u>が複数の ネッティングロ座を開設している場合におい て、<u>同項の申請により清算資格を取得した清算</u> 参加者(当該親会社が同項に規定する保証をす <u>る者に限る。)</u>について次の表の上欄に掲げる 規定を適用するときは、この規定の同表の中欄 に掲げる字句は、同表の下欄に掲げる字句に読 み替えるものとする。

第 3 条	当該 <u>清算参加</u>	当該 <u>清算参加者の</u>
第 1 項	者の親会社の	親会社のネッティ
第2号	当初証拠金基	ング口座ごとの <u>当</u>
	礎所要額	初証拠金基礎所要
		額の合計額

3 <u>業務方法書第6条第2項の申請により清算</u> <u>資格を取得した清算参加者</u>が複数のネッティ ングロ座を開設している場合において、当該<u>清</u> <u>算参加者の親会社</u>である清算参加者について 次の表の上欄に掲げる規定を適用するときは、 この規定の同表の中欄に掲げる字句は、同表の 下欄に掲げる字句に読み替えるものとする。

第 3 条	清算参加者(当	清算参加者(当該
		親会社が同項に規
第2号	項に規定する	定する保証をする

る保証をする初証拠金所要額の者に限る。)の合計額当初証拠金所要額

保証をする者者に限る。)のネッに限る。)ティングロ座ごと初証拠金基礎の当初証拠金基礎所要額所要額の合計額

別表

当初証拠金所要額の算出に関する表

1 各清算参加者の<u>当初証拠金所要額</u>は、次の計 算式により計算して得た額とする。

当初証拠金所要額

- = FOS決済に係る当初証拠金所要額

 + 国債の再構築コスト相当額
 + レポ
- <u>レート変動リスク相当額</u> + 市場インパクト・チャージ所要額
- (1) FOS決済に係る当初証拠金所要額は、次のaからcまでに掲げる区分に従い、当該aからcまでに定める額とする。

- <u>a</u> 一回目算出証拠金所要額に係るもの 次の(a)及び(b)に定める額の合計額
 - (a) 計算日の午前7時に行われた銘柄 割当てにより当該清算参加者が当社に 支払うこととなる銘柄後決め現先取引 等に係る受渡調整金額に相当する額
 - (b) <u>計算日の午前7時の債務の引受け</u> が行われた時点で当該清算参加者が負

別表

当初証拠金基礎所要額の算出に関する表

1 各清算参加者の<u>当初証拠金基礎所要額</u>は、次 の計算式により計算して得た額とする。

当初証拠金基礎所要額

- = FOS決済に係る当初証拠金所要額
- + 国債DVP決済に係る当初証拠金所要
- 額 + 市場インパクト・チャージ所要額
- (1) FOS決済に係る当初証拠金所要額は、計算日から起算して過去120日間(休業日を除外する。以下日数計算において同じ。)の日々の当該清算参加者のFOS決済により授受する金銭の額について、金額の大きいものから20日分の額の平均額(円位未満は切り捨てる。)の金額とする。

担している銘柄後決め現先取引等に係る債務に関し変動証拠金を算出した場合に、当該清算参加者が業務方法書第6 5条第1項の規定により変動証拠金として当社に預託することとなる金額に相当する額

b 二回目算出証拠金所要額に係るもの 次の(a)及び(b)に定める額の合計額 (新設)

- (a) 計算日の午前11時に行われた銘 柄割当てにより当該清算参加者が当社 に支払うこととなる銘柄後決め現先取 引等に係る受渡調整金額に相当する額
- (b) 計算日の午前11時の債務の引受けが行われた時点で当該清算参加者が負担している銘柄後決め現先取引等に係る債務に関し変動証拠金を算出した場合に、当該清算参加者が業務方法書第65条第1項の規定により変動証拠金として当社に預託することとなる金額に相当する額
- c 三回目算出証拠金所要額に係るもの 次の(a)及び(b)に定める額の合計額

(a) 計算日から起算して過去120日間(休業日を除外する。本項第3号(注)を除き以下日数計算において同じ。)の各日における次のイ及び口に定める額の合計額について、金額の大きいものから20日分の額の平均額(円位未満は切り捨てる。)

イ 当該清算参加者が個別銘柄取引に

係る変動証拠金として当社との間で 授受することとなる額

- ロ 個別銘柄取引に係る受渡調整金額
- (b) 計算日の午後2時の債務の引受けが行われた時点で当該清算参加者が負担している銘柄後決め現先取引等に係る債務に関し変動証拠金を算出した場合に、当該清算参加者が業務方法書第65条第1項の規定により変動証拠金として当社との間で授受することとなる金額に相当する額
- (2) 国債の再構築コスト相当額は、次の a から c までに掲げる区分に従い、当該 a から c までに定める額とする。
 - a一回目算出証拠金所要額に係るもの国債の再構築コストに係るPOMA、国債の再構築コストに係る調整POMA及び国債の再構築コスト下限額のうち最大の額
 - (a) 本 a における国債の再構築コスト に係るPOMAは、計算日の前日までに 債務の引受けを行い計算日以降の日を 決済日等とする個別銘柄取引及び計算 日の午前7時までに債務の引受けを行い計算日以降の日を決済日等とする銘 柄後決め現先取引等に係る当該清算参 加者の銘柄ごとの総引渡数量と総受領 数量の差引数量に、当該銘柄の時価変動 リスクファクターを乗じた額を全銘柄 について算出し、当社が各銘柄を残存年 限ごとに分類し定める相殺カテゴリー

(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。

国債DVP決済に係る当初証拠金所要額

- 三 国債の再構築コスト相当額+ レポレート変動リスク相当額
- a 国債の再構築コスト相当額は、国債の再構築コストに係るPOMA、国債の再構築コストに係るPOMA、国債の再構築コストに係る平均POMA、国債の再構築コストに係る調整POMA及び国債の再構築コスト下限額のうち最大の額とする。
 - (a) 国債の再構築コストに係るPOM Aは、清算対象取引に係る当該清算参加者の銘柄ごとの総引渡数量と総受領数量の差引数量に当該銘柄の時価変動リスクファクター(国債の再構築コストを算出するために過去250日間における日々の銘柄別の時価の3日間の変動率の99%をカバーする水準として当

- の組合せごとに当社が定める相殺比率 に基づいてそれぞれの額を相殺したう えで、合算した額とする。
- (b)_ 本aにおける国債の再構築コスト に係る調整POMAは、計算日の前日ま でに債務の引受けを行い計算日の翌日 以降の日を決済日等とする個別銘柄取 引及び計算日の午前7時までに債務の 引受けを行い計算日の翌日以降の日を 決済日等とする銘柄後決め現先取引等 に係る当該清算参加者の銘柄ごとの総 引渡数量と総受領数量の差引数量に、当 該銘柄の時価変動リスクファクターを 乗じた額を全銘柄について算出し、当社 が各銘柄を残存年限ごとに分類し定め <u>る相殺カテゴリーの組合せごとに当社</u> が定める相殺比率に基づいてそれぞれ の額を相殺したうえで、合算した額とす る。
- (c) 本 a における国債の再構築コスト 下限額は、計算日の前日までに債務の引 受けを行い計算日以降の日を決済日等 とする個別銘柄取引及び計算日の午前 7時までに債務の引受けを行い計算日 以降の日を決済日等とする銘柄後決め 現先取引等に係る当該清算参加者の銘 柄ごとの総引渡数量と総受領数量の差 引数量に、当該銘柄の時価変動リスクフ アクターを乗じた額を全銘柄について 算出し、これらの額を合算した額に10 0分の10を乗じた額とする。
- b 二回目算出証拠金所要額に係るもの 国債の再構築コストに係る調整 P O M A

- 社が定める値をいう。以下同じ。) を乗 じた金額を全銘柄について算出し、当社 が各銘柄を残存年限ごとに分類し定め る相殺カテゴリーの組合せごとに当社 が定める相殺比率に基づいてそれぞれ の額を相殺したうえで、合算した額とす る。この場合において、当社は、時価変 動リスクファクター、相殺カテゴリー及 び相殺比率について毎週見直しを行い 清算参加者に通知するものとし、通知日 の翌週の初日(休業日に当たるときは、 順次繰り下げる。)の計算から適用する。 ただし、当社が必要と認める場合は、時 価変動リスクファクター、相殺カテゴリ <u>一及び相殺比率について臨時に変更す</u> ることができる。
- (b) 国債の再構築コストに係る平均POMAは、計算日の前日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。)から起算して過去120日間の日々の当該清算参加者の国債の再構築コストに係るPOMAのうち、金額の大きいものから20日分の額の平均額(円位未満は切り捨てる。)とする。
- (c) 国債の再構築コストに係る調整 P OMAは、計算日の翌日(休業日に当たるときは、順次繰り下げる。)の清算対象取引に係る当該清算参加者の銘柄ごとの引渡数量と受領数量の差引数量を対象外として前(a)の規定により算出された額とする。
- (d) 国債の再構築コスト下限額は、清 算対象取引に係る当該清算参加者の銘 柄ごとの総引渡数量と総受領数量の差

<u>と国債の再構築コスト下限額のいずれか</u> 大きい額

- (a) 本bにおける国債の再構築コスト に係る調整POMAは、計算日の前日ま でに債務の引受けを行い計算日の翌日 以降の日を決済日等とする個別銘柄取 引及び計算日の午前11時までに債務 の引受けを行い計算日の翌日以降の日 を決済日等とする銘柄後決め現先取引 等に係る当該清算参加者の銘柄ごとの 総引渡数量と総受領数量の差引数量に、 当該銘柄の時価変動リスクファクター を乗じた額を全銘柄について算出し、当 社が各銘柄を残存年限ごとに分類し定 める相殺カテゴリーの組合せごとに当 社が定める相殺比率に基づいてそれぞ れの額を相殺したうえで、合算した額と する。
- (b) 本りにおける国債の再構築コスト下限額は、計算日の前日までに債務の引受けを行い計算日の翌日以降の日を決済日等とする個別銘柄取引及び計算日の午前11時までに債務の引受けを行い計算日の翌日以降の日を決済日等とする銘柄後決め現先取引等に係る当該清算参加者の銘柄ごとの総引渡数量と総受領数量の差引数量に、当該銘柄の時価変動リスクファクターを乗じた額を全銘柄について算出し、これらの額を合算した額に100分の10を乗じた額とする。
- c 三回目算出証拠金所要額に係るもの

- 引数量に前(a)に規定する時価変動リスクファクターを乗じた金額を算出し、 すべての銘柄について合算した額に1 00分の10を乗じた額とする。
- 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。
 - <u>(a)</u> レポレート変動リスクに係るPO MA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 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

国債の再構築コストに係る調整POMA、 国債の再構築コストに係る平均POMA 及び国債の再構築コスト下限額のうち最 大の額

- (a) 本 c における国債の再構築コスト に係る調整POMAは、計算日の前日ま でに債務の引受けを行い計算日の翌日 以降の日を決済日等とする個別銘柄取 引及び計算日の午後2時までに債務の 引受けを行い計算日の翌日以降の日を 決済日等とする銘柄後決め現先取引等 に係る当該清算参加者の銘柄ごとの総 引渡数量と総受領数量の差引数量に、当 該銘柄の時価変動リスクファクターを 乗じた額を全銘柄について算出し、当社 が各銘柄を残存年限ごとに分類し定め る相殺カテゴリーの組合せごとに当社 が定める相殺比率に基づいてそれぞれ の額を相殺したうえで、合算した額とす る。
- (b) 本 c における国債の再構築コスト に係る平均 P O M A は、計算日の前日 (休業日に当たるときは、順次繰り上げ る。)から起算して過去120日間の各 日における当該清算参加者の国債の再 構築コストに係る平均 P O M A 計算用 P O M A のうち、金額の大きいものから 20日分の額の平均額(円位未満は切り 捨てる。)とする。
- (c) 本 c における国債の再構築コスト 下限額は、計算日の前日までに債務の引 受けを行い計算日の翌日以降の日を決 済日等とする個別銘柄取引及び計算日

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 一受渡日の翌日から決済日等までの日 数 (休業日を含む。) を 3 6 5 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 <u>ァクターについて毎月見</u>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 の午後2時までに債務の引受けを行い 計算日の翌日以降の日を決済日等とす る銘柄後決め現先取引等に係る当該清 算参加者の銘柄ごとの総引渡数量と総 受領数量の差引数量に、当該銘柄の時価 変動リスクファクターを乗じた額を全 銘柄について算出し、これらの額を合算 した額に100分の10を乗じた額と する。

- (注) 1. 本号における「時価変動リスクファクター」とは、国債の再構築コストを算出するために過去250日間の各日における銘柄別の時価の3日間の変動率の99%をカバーする水準として当社が定める値(物価連動国債の場合は、時価変動リスクファクターの適用開始日から適用終了日までの間の各日における連動係数の3日間の変動をカバーする水準として当社が定める値を加算する。)をいう(第3項において同じ。)。
 - 2. 本号c(b)における「国債の再構築コストに係る平均POMA計算用POMA計算用POMA計算用POMA計算用POMA」とは、一の日までに債務の引受けを行い当該一の日の翌日以降の日を決済日等とする個別銘柄取引に係る証券決済債務に係る数量と当該一の日の平後2時までに債務の引受けを行い当該一の日の翌日以降の日を決済日等とする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当該清算参加者の銘柄ごとの差引数量に、当該銘柄の時価変動リスクファクターを乗じた額を全

- <u>ート変動リスクファクターについて臨</u>時に変更することができる。
- (b) レポレート変動リスクに係る平均 POMAは、計算日の前日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。)から起算して過去120日間の日々の当該清算参加者のレポレート変動リスクに係るPOMAのうち、金額の大きいものから20日分の額の平均額(円位未満は切り捨てる。)とする。
- (c) レポレート変動リスク下限額は、 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レポレート変 動リスクグロス金額について、すべての 銘柄すべての決済日等について合算し た額に100分の10を乗じた額とす る。

銘柄について算出し、当社が各銘柄を残存年限ごとに分類し定める相殺カテゴリーの組合せごとに当社が定める相殺 比率に基づいてそれぞれの額を相殺したうえで、合算した額をいう。

- (3) レポレート変動リスク相当額は、次の aからcまでに掲げる区分に従い、当該aか らcまでに定める額とする。
 - a 一回目算出証拠金所要額に係るもの レポレート変動リスクに係るPOMAと レポレート変動リスク下限額のいずれか 大きい額
 - (a) 本 a におけるレポレート変動リス クに係る P O M A は、計算日の前日まで に債務の引受けを行い計算日以降の日 を決済日等とする個別銘柄取引に係る 当該清算参加者の銘柄及び決済日等ご とのレポレート変動リスクグロス金額 に係る差引合算額並びに計算日の午前 7時までに債務の引受けを行い計算日 以降の日を決済日等とする銘柄後決め 現先取引等に係る当該清算参加者のバ スケット又は銘柄及び決済日等ごとの レポレート変動リスクグロス金額に係 る差引合算額の合計額とする。
 - (b) 本 a におけるレポレート変動リス ク下限額は、計算日の前日までに債務の 引受けを行い計算日以降の日を決済日 等とする個別銘柄取引に係る当該清算 参加者の銘柄及び決済日等ごとのレポ レート変動リスクグロス額に係る差引

合算額並びに計算日の午前7時までに 債務の引受けを行い計算日以降の日を 決済日等とする銘柄後決め現先取引等 に係る当該清算参加者のバスケット又 は銘柄及び決済日等ごとのレポレート 変動リスクグロス額に係る差引合算額 の合計額に100分の10を乗じた額 とする。

- b 二回目算出証拠金所要額に係るもの レポレート変動リスクに係るPOMAと レポレート変動リスク下限額のいずれか 大きい額
 - (a) 本りにおけるレポレート変動リスクに係るPOMAは、計算日の前日までに債務の引受けを行い計算日の翌日以降の日を決済日等とする個別銘柄取引に係る当該清算参加者の銘柄及び決済日等ごとのレポレート変動リスクグロス金額に係る差引合算額並びに計算日の午前11時までに債務の引受けを行い計算日以降の日を決済日等とする銘柄後決め現先取引等に係る当該清算参加者のバスケット又は銘柄及び決済日等ごとのレポレート変動リスクグロス金額に係る差引合算額の合計額とする。
 (b) 本りにおけるレポレート変動リス
 - (b) 本りにおけるレボレート変動リス ク下限額は、計算日の前日までに債務の 引受けを行い計算日の翌日以降の日を 決済日等とする個別銘柄取引に係る当 該清算参加者の銘柄及び決済日等ごと のレポレート変動リスクグロス額に係 る差引合算額並びに計算日の午前11

時までに債務の引受けを行い計算日以 降の日を決済日等とする銘柄後決め現 先取引等に係る当該清算参加者のバス ケット又は銘柄及び決済日等ごとのレ ポレート変動リスクグロス額に係る差 引合算額の合計額に100分の10を 乗じた額とする。

- c三回目算出証拠金所要額に係るものレポレート変動リスクに係る調整 P O MA、レポレート変動リスクに係る平均 P OM A 及びレポレート変動リスク下限額のうち最大の額
 - (a) 本 c におけるレポレート変動リスクに係る調整 P O M A は、計算日の前日までに債務の引受けを行い計算日の翌日以降の日を決済日等とする個別銘柄取引に係る当該清算参加者の銘柄及び決済日等ごとのレポレート変動リスクグロス金額に係る差引合算額並びに計算日の翌日以降を決済日等とする銘柄後決め現先取引等に係る当該清算参加者のバスケット又は銘柄及び決済日等ごとのレポレート変動リスクグロス金額に係る差引合算額の合計額とする。
 - (b) 本 c におけるレポレート変動リス クに係る平均 P O M A は、計算日の前日 (休業日に当たるときは、順次繰り上げ る。) から起算して過去120日間の各 日におけるレポレート変動リスクに係 る平均 P O M A 計算用 P O M A のうち、

金額の大きいものから20日分の額の 平均額(円位未満は切り捨てる。)とす る。

- (c) 本 c におけるレポレート変動リスク下限額は、計算日の前日までに債務の引受けを行い計算日の翌日以降の日を決済日等とする個別銘柄取引に係る当該清算参加者の銘柄及び決済日等ごとのレポレート変動リスクグロス額に係る差引合算額並びに計算日の午後2時までに債務の引受けを行い計算日の翌日以降の日を決済日等とする銘柄後決め現先取引等に係る当該清算参加者のバスケット又は銘柄及び決済日等ごとのレポレート変動リスクグロス額に係る差引合算額の合計額に100分の10を乗じた額とする。
- (注) 1. 本号における「レポレート変動リスクグロス金額」とは、清算対象取引に係る総引渡数量と総受領数量の差引数量の時価評価額(銘柄後決め現先取引等の場合にあっては、スタート受渡金額)にレポレート変動リスクファクターを乗じた額に、レギュラー受渡日の翌日から決済日等までの日数を365で除した数値(決済日等が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までの日数を365で除した数値、決済日等がレギュラー受渡日の場合にはゼロとする。)を乗じた金額をいう。
 - 2. 前(注) 1. における「時価評価額」 とは、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 ち当該銘柄に係る価格の平均値により、 レギュラー受渡日を基準として算出す る価格(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(円位未満は切り捨て る。)とする。)に、レギュラー受渡日ま での日数に応じた経過利子(円位未満は 切り捨てる。)を加算した額をいう。

- 3. (注) 1. における「レポレート変動 リスクファクター」とは、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((注) 4. において同じ。)。
- 4. 本号における「レポレート変動リスク グロス金額に係る差引合算額」とは、レ ポレート変動リスクグロス金額につい て、銘柄ごとに、次のa及びbに定める 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をいう。
 - a レギュラー受渡日以降の日を決済 日等とする清算対象取引に係るレポ レート変動リスクグロス金額のうち 引渡数量に係るもの及び計算日を決 済日等とする清算対象取引に係るレ ポレート変動リスクグロス金額のう ち受領数量に係るものの合計額
 - b 計算日のレギュラー受渡日以降の 日を決済日等とする清算対象取引に 係るレポレート変動リスクグロス金 額のうち受領数量に係るもの及び計

算日を決済日等とする清算対象取引 に係るレポレート変動リスクグロス 金額のうち受領数量にかかるものの 合計額

5. 本号 c (b) における「レポレート変動リスクに係る平均POMA計算用POMA」とは、一の日までに債務の引受けを行い当該一の日の翌日以降の日を決済日等とする個別銘柄取引に係る当該清算参加者の銘柄及び決済日等ごとのレポレート変動リスクグロス金額に係る差引合算額並びに当該一の日の平後2時までに債務の引受けを行い当該一の日の翌日以降の日を決済日等とする銘柄後決め現先取引等に係る当該清算参加者のバスケット及び決済日等ごとのレポレート変動リスクグロス金額に係る差引合算額の合計額をいう。

(4) 市場インパクト・チャージ所要額は、 次のaからcまでに掲げる区分に従い、当該 aからcまでに定める額とする。 (3) 市場インパクト・チャージ所要額は、清算対象取引に係る当該清算参加者の銘柄ごとの総引渡数量と総受領数量の差引数量に当該銘柄のベーシス・ポイント・バリュー及び当社が定める銘柄別基準スプレッドを乗じた金額(対象銘柄が変動利付国債の場合にあっては、総引渡数量と総受領数量の差引数量に銘柄別基準スプレッドを乗じた金額)を算出し、当該金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、銘柄別基準スプレッドについて毎年1月、4月、7月及び10月の初日(休業日に当たるときは、順次繰り下げる。)を基準とする清算参加者からの申告に基づき見直しを行い清算参加者に通知するものとし、その

- a 一回目算出証拠金所要額に係るもの 取引執行コスト相当額と調整取引執行コ スト相当額のいずれか大きい額
 - (a) 本aにおける取引執行コスト相当 額は、計算日の前日までに債務の引受け を行い計算日以降の日を決済日等とす る個別銘柄取引に係る当該清算参加者 の銘柄ごとの総引渡数量と総受領数量 の差引数量及び計算日の午前7時まで に債務の引受けを行い計算日以降の日 を決済日等とする銘柄後決め現先取引 等に係る当該清算参加者の銘柄ごとの 総引渡数量と総受領数量の差引数量の それぞれを当該銘柄のベーシス・ポイン ト・バリュー及び銘柄別基準スプレッド (変動利付国債又は物価連動国債を対 象とする清算対象取引の場合にあって は、当該銘柄の銘柄別基準スプレッド。 以下本号において同じ。) により評価し た額を算出し、当該金額をすべての銘柄 について合算した額とする。
 - (b) 本 a における調整取引執行コスト 相当額は、計算日の前日までに債務の引 受けを行い計算日の翌日以降の日を決 済日等とする個別銘柄取引に係る当該 清算参加者の銘柄ごとの総引渡数量と 総受領数量の差引数量及び計算日の午 前7時までに債務の引受けを行い計算 日の翌日以降の日を決済日等とする銘

月の10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、銘柄別基準 スプレッドについて臨時に変更することが できる。

柄後決め現先取引等に係る当該清算参加者の銘柄ごとの総引渡数量と総受領数量の差引数量のそれぞれを当該銘柄のベーシス・ポイント・バリュー及び銘柄別基準スプレッドにより評価した額を算出し、当該金額をすべての銘柄について合算した額とする。

<u>b</u> 二回目算出証拠金所要額に係るもの 調整取引執行コスト相当額

- (a) 本りにおける調整取引執行コスト相当額は、計算日の前日までに債務の引受けを行い計算日の翌日以降の日を決済日等とする個別銘柄取引に係る当該清算参加者の銘柄ごとの総引渡数量と総受領数量の差引数量及び計算日の午前11時までに債務の引受けを行い計算日の翌日以降の日を決済日等とする銘柄後決め現先取引等に係る当該清算参加者の銘柄ごとの総引渡数量と総受領数量の差引数量のそれぞれを当該銘柄のベーシス・ポイント・バリュー及び銘柄別基準スプレッドにより評価した額を算出し、当該金額をすべての銘柄について合算した額とする。
- c 三回目算出証拠金所要額に係るもの 調整取引執行コスト相当額と平均取引執 行コスト相当額のいずれか大きい額
 - (a) 本 c における調整取引執行コスト 相当額は、計算日の前日までに債務の引 受けを行い計算日の翌日以降の日を決

済日等とする個別銘柄取引に係る当該 清算参加者の銘柄ごとの総引渡数量と 総受領数量の差引数量及び計算日の午 後2時までに債務の引受けを行い計算 日の翌日以降の日を決済日等とする銘 柄後決め現先取引等に係る当該清算参 加者の銘柄ごとの総引渡数量と総受領 数量の差引数量のそれぞれを当該銘柄 のベーシス・ポイント・バリュー及び銘 柄別基準スプレッドを乗じた金額を算 出し、当該金額をすべての銘柄について 合算した額とする。

(b) 本 c における平均取引執行コスト相当額は、計算日の前日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。)から起算して過去120日間の各日における平均取引執行コスト相当額計算用取引執行コスト相当額のうち、金額の大きいものから20日分の額の平均額(円位未満は切り捨てる。)とする。

(注) 1. 本号c(b)における平均取引執行 コスト相当額計算用取引執行コスト 相当額とは、一の日までに債務の引受 けを行い当該一の日の翌日以降の日 を決済日等とする個別銘柄取引に係 る当該清算参加者の銘柄ごとの総引 渡数量と総受領数量の差引数量及び 当該一の日の午後2時までに債務の 引受けを行い当該一の日の翌日以降 の日を決済日等とする銘柄後決め現 先取引等に係る当該清算参加者の銘 柄ごとの総引渡数量と総受領数量の 差引数量のそれぞれに当該銘柄のべ

ーシス・ポイント・バリュー及び銘柄 別基準スプレッドを乗じた金額を算 出し、当該金額をすべての銘柄につい て合算した額をいう。

- 2 業務方法書第86条第2項第2号に規定するレポ専用口座においては前項第2号c(b)及び第4号c(b)を適用せず、業務方法書第86条第2項第3号に規定する後決めレポ専用口座においては、前項第1号c(a)、第2号c(b)、第3号c(b)及び第4号c(b)の規定は適用しない。
- 3 第1項第2号における時価変動リスクファクター及び相殺比率、同項第3号におけるレポレート変動リスクファクター並びに同項第4号における銘柄別基準スプレッド(以下「当社設定値」という。)は、次の各号に定めるところにより見直しを行い、清算参加者に通知する。
 - (1) 時価変動リスクファクター、相殺カテゴリー及び相殺比率 見直しは毎週行うものとし、清算参加者に通知した日の属する週の翌週の初日(休業日に当たるときは、順次繰り下げる。以下本項において同じ。)から見直し後の時価変動リスクファクター及び相殺比率を適用する。
 - (2) レポレート変動リスクファクター 見 直しは毎月行うものとし、見直しに係る月の 5日目の日から見直し後のレポレート変動 リスクファクターを適用する。
 - (3) <u>銘柄別基準スプレッド</u> 見直しは毎年 1月、4月、7月及び10月の初日を基準と する清算参加者からの申告により行うもの

(新設)

とし、見直しに係る月の10日目の日から見 直し後の銘柄別基準スプレッドを適用する。

- (4) 前各号の規定にかかわらず、当社は、 当社が必要と認める場合は、臨時に当社設定 値の見直しを行うことができる。
- 4 複数のネッティングロ座を開設している清 算参加者について、別表中、次の表の上欄に掲 げる規定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1項第1号	<u>当該清算参</u> 加者が	当該清算参加者がネッティング口座ごとに、
第1項第2号	(略)	当該清算参加者のネ ッティングロ座ごと <u>の</u>
(削る)		

2 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、別表中、次の表の上欄に掲 げる規定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1項第1	<u>FOS決済</u>	<u>ネッティングロ</u>
号	により授受	座ごとのFOS
	する金銭の	決済により授受
	<u>額</u>	する金銭の額
第1項第2	(略)	当該清算参加者
号 <u>a (a)</u>		のネッティング
		口座ごと <u>に、</u>
第1項第2	当該清算参	当該清算参加者
<u> 号a (b)</u>	加者の	のネッティング
<u>及び(c)</u>		<u>口座ごとの</u>
第1項第2	当該清算参	当該清算参加者
<u> 号a (d)</u>	加者の	のネッティング
		<u>口座ごとに、</u>
第1項第2	当該清算参	当該清算参加者
<u> 号b (a)</u>	加者の	のネッティング
		<u>口座ごとに、</u>
第1項第2	当該清算参	当該清算参加者
<u> 号b (b)</u>	加者の	のネッティング
		<u>口座ごとの</u>
第1項第2	当該清算参	当該清算参加者
<u> 号b (c)</u>	加者の	のネッティング
		<u>口座ごとに、</u>

第1項	(略)	当該清算参加者のネ
第3号		ッティング口座ごと
		<u>Ø</u>
第1項	当該清算参	当該清算参加者のネ
第4号	加者の	<u>ッティング口座ごと</u>
		<u>Ø</u>

第1項第3	(略)	当該清算参加者
号		のネッティング
		口座ごと <u>に、</u>
(新設)		

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、この改正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。

国債店頭取引清算基金所要額に関する規則の一部改正新旧対照表

旧

(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。

新

(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<u>毎営業日、</u>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1億円のいずれ か大きい額とする。
- 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<u>第3項</u>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<u>当初証拠金所要額</u>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。

別表 国債店頭取引清算基金所要額の算出に関する表

 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 (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5の規定に基づき、国債店頭取引清算基金所要額を定める。

(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1億円のいずれか大きい 額とする。
- 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<u>第2項</u>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<u>当初証拠金基礎所要額</u>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。

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、国債店頭取引清算基金算出日(毎週 <u>所要額の算出を行う日をいう。以下同じ。</u>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
- 最終日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。)の前日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。)の前日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。以下同じ。)をいう。以下同じ。)におけるストレス時想定損失負担額とし、当該額を当該国債店頭取引清算基金算出日からその直後の国債店頭取引清算基金算出日の前日まで適用する。なお、当社は、週の営業日数に応じて、国債店頭取引清算基金算出日を臨時に変更することができるものとする。
- 2 前項に規定するストレス時想定損失負担額 は、対応する国債店頭取引清算基金算出日にお ける担保超過リスク額が上位である清算参加 者2社(当該清算参加者を含む企業集団(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。以下同じ。) に含まれる他の清 算参加者を含む。)の担保超過リスク額の合計 額を、当該国債店頭取引清算基金算出日に計算 された第1項の各清算参加者の当初証拠金基 礎所要額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 清算参加者の国債店頭取引清算基金算出日前 日の午後6時30分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当 初証拠金所要額を差し引いた額(当該額が負数 となる場合は、0とする。)をいう。

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<u>の規定にかかわらず、信託口を有する</u> 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ロ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
- 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、第2項の規定を適用する場合には、同項中「各清算参加者の当初証拠金基礎所要額」とあるのは「各清算参加者のネッティング口座ごとの当初証拠金基礎所要額」と、それぞれ読み替えるものとする。
- 4 第2項<u>に規定する</u>担保超過リスク額を算出する場合、<u>信託口を有する清算参加者については</u>、信託口と信託口以外の<u>ネッティング</u>とを区分して算出するものと<u>し</u>、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<u>の担保超過額</u>及び当該清算参加者<u>を含む企業集団に含まれる他の清算参加者の担保超過リスク額</u>を合算しないものとする。

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<u>の規定にかかわらず、</u>信託口を有しない清算参加者の担保超過リスク額には、<u>当該清</u>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。

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、この改正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。

5 第2項<u>に規定する担保超過リスク額を算出</u>する場合、信託口を有する清算参加者の信託口以外のネッティング口座の担保超過リスク額及び信託口を有しない清算参加者の担保超過リスク額には、当該清算参加者の信託口に係る担保超過額及び当該清算参加者を含む企業集団に含まれる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。

措置評価委員会規則の一部改正新旧対照表

新

(諮問事項)

第3条 当社は、清算参加者(業務方法書第5条 第2項に規定する現物清算資格、国債先物等清 算資格、指数先物等清算資格若しくはFX清算 資格、CDS業務方法書第2条第60号に規定 するCDS清算資格、金利スワップ業務方法書 第2条第12号に規定する金利スワップ清算 資格又は国債店頭取引業務方法書<u>第2条第3</u> 3号に規定する国債店頭取引清算資格のうち いずれかの清算資格を有する者をいう。以下同 じ。)に対し次に掲げる措置又は判断を行おう とするときは、措置評価委員会に諮問するもの とする。

(2) • (3) (略)

2 · 3 (略)

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、この改正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。

旧

(諮問事項)

第3条 当社は、清算参加者(業務方法書第5条 第2項に規定する現物清算資格、国債先物等清 算資格、指数先物等清算資格若しくはFX清算 資格、CDS業務方法書第2条第60号に規定 するCDS清算資格、金利スワップ業務方法書 第2条第12号に規定する金利スワップ清算 資格又は国債店頭取引業務方法書<u>第5条第2</u> 項に規定する国債店頭取引清算資格のうちいずれかの清算資格を有する者をいう。以下同 じ。)に対し次に掲げる措置又は判断を行おうとするときは、措置評価委員会に諮問するものとする。

 $(2) \cdot (3)$ (略)

2 • 3 (略)

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の一部改正新旧対照表

新

(定義)

(定義)

- 第2条 本規則において使用する用語は、本規則 に別段の定めがある場合を除き、業務方法書に おいて使用す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) 「バスケット破綻処理入札実施日」と は、国債店頭取引破綻管理委員会の助言に基 づき、当社がその都度定めるバスケット破綻 処理入札の実施日をいう。
 - (2) (略)
 - (3) (略)
 - (4) (略)
 - (5) 「第一段階損失補填財源」とは、第一 階層国債店頭取引決済保証準備金をいう。
 - (6) 「第二段階損失補填財源」とは、第二 階層国債店頭取引決済保証準備金、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(第二階層清算参加者負担限度額を上限 とする。)、第三階層特別清算料及び第四階層 特別清算料をいう。
 - (7) 「第二階層清算参加者負担限度額」と は、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)をいう。

(破綻等の個別処理の原則)

第5条 複数の清算参加者について破綻等が認 │ 第5条 複数の清算参加者について破綻等が認 定された場合における破綻処理入札の実施、業

第2条 本規則において使用する用語は、本規則 に別段の定めがある場合を除き、業務方法書に おいて使用す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。

旧

(新設)

- (1) (略)
- _(2)_(略)
- (3) (略)
- (4) 「第一段階損失補填財源」とは、破綻 清算参加者が当社に預託した当初証拠金及 び国債店頭取引清算基金並びに第一階層国 債店頭取引決済保証準備金をいう。
- (5) 「第二段階損失補填財源」とは、第二 階層国債店頭取引決済保証準備金、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(第二階層清算参加 者負担限度額を上限とする。)、第三階層特別 清算料及び第四階層特別清算料をいう。
- (5) 「第二階層清算参加者負担限度額」と は、原取引按分清算参加者第二階層負担限度 額及び清算基金所要額按分清算参加者第二 階層負担限度額をいう。

(破綻等の個別処理の原則)

定された場合における破綻処理入札の実施、業

務方法書第80条の4の規定による協議の実 施及び同条第2項の合意の成立又は協議が不 調となった場合における未決済ポジションの 一括清算、清算参加者が当社に支払うべき特別 清算料の額の算出及びその支払い、清算参加者 が当社に預託すべき特別清算料担保金の額の 算出及びその預託、破綻処理損失の算出及びそ の補填(当該補填のためにする第一階層国債店 頭取引決済保証準備金、第二階層国債店頭取引 決済保証準備金及び国債店頭取引清算基金の 取崩しを含む。)、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の調整その他破綻 等の認定に関連する事項並びにこれらの事項 に係る本業務方法書等の規定の適用について は、本業務方法書等に別段の定めがある場合を 除き、破綻清算参加者ごとに個別に行うものと する。

第2章 破綻処理入札

第1節 バスケット破綻処理入札

(バスケット破綻処理入札に関する基本的事項) 第5条の2 当社は、国債店頭取引破綻管理委員 会の助言に基づき、次に定める要領によりバス ケット破綻処理入札を実施するものとする。

- (1) 当社は、国債 店頭取引破綻管理委員 会の助言に基づき、バスケットごとに入札対 象取引を設定する。
- (2) バスケット破綻処理入札における入札 は、バスケット破綻処理入札の対象者が、第 5条の5第1項に規定する時間内に、入札現 先レート(各入札対象取引の成立に伴い当社 及び落札参加者の間で授受されるエンド受

務方法書第80条の4の規定による協議の実 施及び同条第2項の合意の成立又は協議が不 調となった場合における未決済ポジションの 一括清算、清算参加者が当社に支払うべき特別 清算料の額の算出及びその支払い、清算参加者 が当社に預託すべき特別清算料担保金の額の 算出及びその預託、破綻処理損失の算出及びそ の補填(当該補填のためにする第一階層国債店 頭取引」決済保証準備金、第二階層国債店頭取 引決済保証準備金及び国債店頭取引清算基金 の取崩しを含む。)、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の調整その他破 綻等の認定に関連する事項並びにこれらの事 項に係る本業務方法書等の規定の適用につい ては、本業務方法書等に別段の定めがある場合 を除き、破綻清算参加者ごとに個別に行うもの とする。

第2章 破綻処理入札

(新設)

渡金額を算出するための基準となる料率をいう。以下同じ。)及び入札スタート売買金額(入札対象取引のスタート受渡金額のうち、入札を希望する金額をいう。以下同じ。)を提示することにより行う。

(バスケット破綻処理入札の対象ポジションか ら除かれるポジション)

第 5 条 の 3 業務方法書第 8 0 条 の 3 第 2 項第 1 号に規定する当社が定めるものは、次の各号 に定めるものとする。

(1) スタート/Rewind国債引渡債務(バスケット)

破綻認定日を決済日等とするもの。

(2) エンド/Unwind国債引渡債務 (バスケット)

破綻認定日の翌日を決済日等とするもの。

(バスケット破綻処理入札の実施に関する通知)

第5条の4 当社は、バスケット破綻処理入札の 実施に先立ち、バスケット破綻処理入札の対象 者に対し、当該入札対象取引の内容を通知す る。

(バスケット破綻処理入札の実施)

第5条の5 当社は、バスケット破綻処理入札実施日の国債店頭取引破綻管理委員会の助言に基づき当社が定める時刻から午後6時まで、バスケット破綻処理入札を実施する。ただし、当社は、国債店頭取引破綻管理委員会の助言に基づき、破綻処理入札の時間を変更することができる。

2 前項に規定するもののほか、バスケット破綻 処理入札の実施に関し必要な事項は、国債店頭 (新設)

(新設)

取引破綻管理委員会の助言に基づき、当社がその都度定める。

- 3 バスケット破綻処理入札における落札は、入 札対象取引ごとに、落札参加者が現先売方清算 参加者となる銘柄後決め現先取引については 入札現先レートが高いものから順に、落札参加 者が現先買方清算参加者となる銘柄後決め現 先取引については入札現先レートが低いもの から順に、入札対象取引ごとの入札スタート売 買金額が当該入札対象取引のスタート受渡金 額に満つるまで行われるものとする。
- 4 前項の場合において、同一の入札現先レート が複数あるときは、最も入札スタート売買金額 の大きい清算参加者を落札参加者とし、同一の 入札スタート売買金額が複数あるときは、抽選 により落札参加者を定めるものとする。
- (バスケット破綻処理入札に係る入札対象取引 の成立)
- 第5条の6 当社は、バスケット破綻処理入札の 終了後直ちに、当該入札に係る落札現先レート (落札される取引に係る入札現先レートをい う。以下同じ。)及び落札参加者を確定させる。
- 2 当社が前項の規定によりバスケット破綻処理入札に係る落札現先レート及び落札参加者を確定させた場合には、当該確定時点に、バスケット破綻処理入札に係る入札対象取引が当社及び落札参加者との間で成立する。
- 3 当社は、第1項の規定によりバスケット破綻 処理入札に係る落札現先レート及び落札参加 者が確定したときは、落札結果を直ちに当該バ スケット破綻処理入札において入札を行った 清算参加者に通知する。
- 4 第1項の落札現先レート及び落札者の確定

は、入札対象取引を成立させることにより当社 に生じ得る破綻処理損失の額が第一段階損失 補填財源の額以下であることを条件に行うも のとし、入札対象取引を成立させることにより 当社に生じ得る破綻処理損失の額が第一段階 損失補填財源を超過するときは、バスケット破 綻処理入札は不成立とする。

- 5 当社は、前項の規定によりバスケット破綻処理入札を不成立とした場合、当該不成立となった日の翌日に、当該不成立とした日から起算して3日目(休業日を除外する。)の日以降の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)及び当該債務に対応するエンド/Unwind(バスケット)国債引渡債務を破綻処理対象ポジションとして、バスケット破綻処理入札を実施する。
- <u>6</u> 前項のバスケット破綻処理入札の実施については、第5条の2から本条第4項までの規定を準用する。

第2節 第一段階破綻処理入札

(第一段階破綻処理入札の対象者)

第6条 業務方法書第80条の3第2項第2号 に規定する当社が定める清算参加者は、国債店 頭取引破綻管理委員会規則第5条に規定する 清算参加者リストに記載された清算参加者と する。この場合において、国債店頭取引破綻管 理委員会規則第5条第4項の規定により清算 参加者リストから抹消された清算参加者は、同 条第5項の規定により現に存する清算参加者 清算参加者リストが効力を失うまでは、当該清 算参加者リストに記載されている清算参加者 とみなす。 第1節 第一段階破綻処理入札

(第一段階破綻処理入札の対象者)

第6条 <u>第一段階破綻処理入札の対象者</u>は、国債 店頭取引破綻管理委員会規則第5条に規定す る清算参加者リストに記載された清算参加者 とする。 (第一段階破綻処理入札に関する基本的事項)

- 第7条 当社は、国債店頭取引破綻管理委員会の 助言に基づき、次に定める要領により第一段階 破綻処理入札を実施するものとする。
 - (1) 当社は、国債店頭取引破綻管理委員会 の助言に基づき、破綻処理対象ポジションを 構成する銘柄をそのリスク量(当社が定める ところにより算出したものをいう。以下同 じ。)が低減されるように組み合わせること により適当な数の入札対象取引を設定し、当 該入札対象取引ごとに入札を実施すること を基本とする。ただし、当社は、当該破綻処 理対象ポジションの規模その他の事情を勘 案し、適当と認めるときは、国債店頭取引破 綻管理委員会の助言に基づき、破綻処理対象 ポジションを構成する銘柄を単一の入札対 象取引として、一括して入札を実施すること ができる。
 - (2) 第一段階破綻処理入札における入札 は、第一段階破綻処理入札の対象者が、第9 条第1項に規定する時間内に、入札金額(各 入札対象取引の成立に伴い当社及び落札参 加者の間で授受される正数又は負数の受渡 金額(入札対象取引の決済のために当社との 間で授受する金銭の総額であって、当該額が 負数の場合は落札参加者が当該額の絶対値 に相当する額を当社に支払うこととなるも のをいう。)をいう。以下同じ。)を提示する ことにより行う。

(第一段階破綻処理入札の実施)

第9条 当社は、第一段階破綻処理入札実施日の│第9条 当社は、第一段階破綻処理入札実施日の 午前8時30分から午前9時30分まで、第一 午前9時から午前9時30分まで、第一段階破

(第一段階破綻処理入札に関する基本的事項)

- 第7条 当社は、国債店頭取引破綻管理委員会の 助言に基づき、次に定める要領により第一段階 破綻処理入札を実施するものとする。
 - (1) 当社は、破綻管理委員会の助言に基づ き、破綻処理対象ポジションを構成する銘柄 をそのリスク量が低減されるように組み合 わせることにより適当な数の入札対象取引 を設定し、当該入札対象取引ごとに入札を実 施することを基本とする。ただし、当社は、 当該破綻処理対象ポジションの規模その他 の事情を勘案し、適当と認めるときは、国債 店頭取引破綻管理委員会の助言に基づき、破 綻処理対象ポジションを構成する銘柄を単 一の入札対象取引として、一括して入札を実 施することができる。
 - (2) 第一段階破綻処理入札における入札 は、第一段階破綻処理入札の対象者が、第9 条第1項に規定する時間内に、入札金額(各 入札対象取引の成立に伴い当社及び落札参 加者の間で授受される正数又は負数の受渡 金額(入札対象取引の決済のために当社との 間で授受する金銭の総額であって、当該額が 負数の場合は落札清算参加者が当該額の絶 対値に相当する額を当社に支払うこととな るものをいう。)をいう。以下同じ。)を提示 することにより行う。

(第一段階破綻処理入札の実施)

段階破綻処理入札を実施する。ただし、当社は、 国債店頭取引破綻管理委員会の助言に基づき、 破綻処理入札の時間を変更することができる。

- 2 前項に規定するもののほか、<u>第一段階破綻処</u> 理入札の実施に関し必要な事項は、国債店頭取 引破綻管理委員会の助言に基づき、当社がその 都度定める。
- 3 第一段階破綻処理入札における落札は、<u>入札</u> 対象取引ごとに、最も低い入札金額を落札金額 とし、当該落札金額にて入札を行った破綻処理 入札参加者を落札参加者として行われるもの とする。
- 4 前項の規定にかかわらず、同一の入札対象取 引を複数口に分割して入札を行う方法による 場合は、入札口ごとに1口<u>当たり</u>の入札金額が 低いものから順に入札対象口数に満つるまで 落札参加者を決定するものとする。
- 5 前2項の場合において、最高落札金額(入札 対象取引ごとに、落札金額のうち、最も大きい 入札金額をいう。)による入札に係る入札対象 口数の合計が落札参加者の決定していない入 札対象口数を超えるときは、落札参加者の決定 していない入札対象口数については、最高落札 金額による入札に係る入札対象口数に応じた 按分により落札参加者を定め、按分できない数 量については、抽選により落札参加者を定める ものとする。

(第一段階破綻処理入札に係る入札対象取引の成立)

第10条 当社は、第一段階破綻処理入札の終了 後直ちに、<u>当該</u>入札に係る落札金額及び落札参 加者を確定させる。

- 綻処理入札を実施する。ただし、当社は、国債 店頭取引破綻管理委員会の助言に基づき、破綻 処理入札の時間を変更することができる。
- 2 前項に規定するもののほか、<u>第一段階破綻処理入札の実施条件その他破第一段階綻処理入札の実施</u>に関し必要な事項は、国債店頭取引破綻管理委員会の助言に基づき、当社がその都度定める。
- 3 第一段階破綻処理入札における落札は、最も 低い入札金額を落札金額とし、当該落札金額に て入札を行った破綻処理入札参加者を落札参 加者として行われるものとする。
- 4 前項の規定にかかわらず、同一の入札対象取 引を複数口に分割して入札を行う方法による 場合は、入札口ごとに1口<u>当り</u>の入札金額が低 いものから順に入札対象口数に満つるまで落 札参加者を決定するものとする。
- 5 <u>第3項及び前項</u>の場合において、<u>同一の入札</u> 金額が複数あるときは、抽選により落札参加者 を定めるものとする。

(第一段階破綻処理入札に係る入札対象取引の 成立)

第10条 当社は、第一段階破綻処理入札の終了 後直ちに、<u>第一段階破綻処理</u>入札に係る落札金 額及び落札参加者を確定させる。

- 2 当社が前項の規定により第一段階破綻処理 入札に係る落札金額及び落札参加者を確定さ せた場合には、当該確定時点に、<u>当該</u>入札に係 る入札対象取引が当社及び落札参加者との間 で成立する。
- 3 当社は、第1項の規定により第一段階破綻処理入札に係る落札金額及び落札参加者が確定したときは、<u>落札結果</u>を、直ちに入札を行った清算参加者に通知する。
- 4 第1項の落札金額及び落札者の確定は、入札 対象取引を成立させることにより当社に生じ 得る破綻処理損失の額が当該入札対象取引に 係る損失補填財源の額(第一段階損失補填財源 <u>(バスケット破綻処理入札において費消した 額を除く。)</u>を各入札対象取引のリスク量に応 じて按分した額をいう。)以下であることを条 件に行うものとし、入札対象取引を成立させる ことにより当社に生じ得る破綻処理損失の額 が当該入札対象取引に係る損失補填財源の額 を超過する部分については、落札金額及び落札 参加者の確定を行わないものとする。

第3節 第二段階破綻処理入札

(第二段階破綻処理入札に関する基本的事項)

第11条 当社は、<u>第5条の6第4項の規定により、バスケット破綻処理入札を不成立とした場合又は</u>前条第4項の規定により、第一段階破綻処理入札における入札対象取引の全部又は一部について落札金額及び落札参加者の確定を行わなかった場合、国債店頭取引破綻管理委員会の助言に基づき、次に定める要領により第二

- 2 当社が前項の規定により第一段階破綻処理 入札に係る落札金額及び落札参加者を確定さ せた場合には、当該確定時点に、<u>第一段階破綻</u> 処理入札に係る入札対象取引が当社及び落札 参加者との間で成立する。
- 3 当社は、第1項の規定により第一段階破綻処理入札に係る落札金額及び落札参加者が確定したときは、自社が落札参加者であるか否かの別(以下「落札結果」という。)を直ちに当該第一段階破綻処理入札において入札を行った破綻処理入札参加者に通知する。
- 4 第1項の落札金額及び落札者の確定は、入札 対象取引を成立させることにより当社に生じ 得る破綻処理損失の額が当該入札対象取引に 係る損失補填財源の額(第一段階損失補填財源 を各入札対象取引のリスク量に応じて按分し た額をいう。)以下であることを条件に行うも のとし、入札対象取引を成立させることにより 当社に生じ得る破綻処理損失の額が当該入札 対象取引に係る損失補填財源の額を超過する 部分については、落札金額及び落札参加者の確 定を行わないものとする。

第2節 第二段階破綻処理入札

(第二段階破綻処理入札に関する基本的事項)

第11条 当社は、前条第4項の規定により、第 一段階破綻処理入札における入札対象取引の 全部又は一部について落札金額及び落札参加 者の確定を行わなかった場合、国債店頭取引破 綻管理委員会の助言に基づき、次に定める要領 により第二段階破綻処理入札を実施するもの とする。 段階破綻処理入札を実施するものとする。

- (1) 当社は、バスケット破綻処理入札を不成立とした日の翌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)及び当該債務に対応するエンド/Unwind(バスケット)国債引渡債務に対する。 銘柄割当てに基づく銘柄後決め現先取引等に係る証券決済債務並びに第一段階破綻処理入札において入札を不成立とした入札対象取引に含まれる個別銘柄取引に係る証券決済債務を破綻処理対象ポジションとして、銘柄ごとに入札対象取引を設定する。
- (2) 第二段階破綻処理入札における入札 は、第二段階破綻処理入札の対象者が、第1 3条第1項に規定する時間内に、額面100 円<u>当たり</u>の入札金額及び入札額面を提示す ることにより行う。

(第二段階破綻処理入札の実施)

第13条 (略)

- 2 前項に規定するもののほか、<u>第二段階破綻処</u> 理入札の実施に関し必要な事項は、国債店頭取 引破綻管理委員会の助言に基づき、当社がその 都度定める。
- 3 第二段階破綻処理入札における落札は、入札 対象取引ごとに、額面100円<u>当たり</u>の入札金 額が低いものから順に、入札対象取引の額面に 満つるまで行われるものとする。
- 4 前項の場合において、<u>額面100円当たりの</u> 最高落札金額(入札対象取引ごとに、落札金額 のうち、最も大きな額面100円当たりの入札 金額をいう。)による入札に係る入札対象取引

(1) 当社は、第一段階破綻処理入札において入札を不成立とした入札対象取引に含まれる個々の銘柄を入札対象取引とする。

(2) 第二段階破綻処理入札における入札 は、第二段階破綻処理入札の対象者が、第1 3条第1項に規定する時間内に、額面100 円<u>あたり</u>の入札金額及び入札額面を提示す ることにより行う。

(第二段階破綻処理入札の実施)

第13条 (略)

- 2 前項に規定するもののほか、<u>第二段階破綻処理入札の実施条件その他破第二段階綻処理入札の実施</u>に関し必要な事項は、国債店頭取引破綻管理委員会の助言に基づき、当社がその都度定める。
- 3 第二段階破綻処理入札における落札は、入札 対象取引ごとに、額面100円<u>あたり</u>の入札金 額が低いものから順に、入札対象取引の額面に 満つるまで行われるものとする。
- 4 前項の場合において、同一の額面100円あたりの入札金額が複数あるときは、抽選により落札参加者を定めるものとする。

の額面の合計が、落札参加者の決定していない 入札対象取引の額面を超えるときは、落札参加 者の決定していない入札対象取引については、 最高落札金額による入札に係る入札対象取引 の額面に応じた按分により落札参加者を定め、 最低額面未満の端数が生じたときは、抽選によ り落札参加者を定めるものとする。

(第二段階破綻処理入札に係る入札対象取引の 成立)

- 第14条 当社は、第二段階破綻処理入札の終了 後直ちに、<u>当該</u>入札に係る落札金額及び落札参 加者を確定させる。
- 2 当社が前項の規定により第二段階破綻処理 入札に係る落札金額及び落札参加者を確定さ せた場合には、当該確定時点に、<u>当該</u>入札に係 る入札対象取引が当社及び落札参加者との間 で成立する。
- 3 当社は、第1項の規定により第二段階破綻処 理入札に係る落札金額及び落札参加者が確定 したときは、<u>落札結果を、</u>直ちに入札を行った 清算参加者に通知する。
- 4 前3項の規定にかかわらず、第二段階破綻処理入札に係る落札金額及び落札参加者を確定させた場合において、いずれかの生存清算参加者が負担することとなる第三階層特別清算料及び第四階層特別清算料の合計額が、当該清算参加者が当社に現に預託している当初証拠金及び破綻時証拠金の合計額を超えるときは、次の各号に定めるとおり第二段階破綻処理入札に係る落札金額及び落札参加者を確定させ、又は第二段階破綻処理入札を再実施する。

(第二段階破綻処理入札に係る入札対象取引の 成立)

- 第14条 当社は、第二段階破綻処理入札の終了 後直ちに、<u>第二段階破綻処理</u>入札に係る落札金 額及び落札参加者を確定させる。
- 2 当社が前項の規定により第二段階破綻処理 入札に係る落札金額及び落札参加者を確定さ せた場合には、当該確定時点に、<u>第二段階破綻</u> 処理入札に係る入札対象取引が当社及び落札 参加者との間で成立する。
- 3 当社は、第1項の規定により第二段階破綻処理入札に係る落札金額及び落札参加者が確定したときは、自社が落札参加者であるか否かの別(以下「落札結果」という。)を直ちに当該第二段階破綻処理入札において入札を行った破綻処理入札参加者に通知する。
- 4 前3項の規定にかかわらず、第二段階破綻処理入札に係る落札金額及び落札参加者を確定させた場合において、いずれかの<u>清算参加者(破綻清算参加者を除く。)</u>が負担することとなる第三階層特別清算料及び第四階層特別清算料の合計額が、当該清算参加者が当社に現に預託している当初証拠金及び破綻時証拠金の合計額を超えるときは、次の各号に定めるとおり第二段階破綻処理入札に係る落札金額及び落札参加者を確定させ、又は第二段階破綻処理

- (1) 当社は、第二段階破綻処理入札の終了 後直ちに、その暫定の落札結果を各生存清算 参加者に通知する。
- 当社は、第二段階破綻処理入札実施日 (2)の午後2時までに、当該第二段階破綻処理入 札に係る落札金額及び落札参加者を確定さ せたと仮定した場合に各生存清算参加者が 負担することとなる第三階層特別清算料及 び第四階層特別清算料の額並びに第30条 第1号及び第31条第1号の規定により当 社に預託すべき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の額を通知 する。
- (3) 第二段階破綻処理入札実施日の午後4 時までに、全ての生存清算参加者が当社に預 託すべき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の全額を当社に預 託した場合には、当社は、直ちに当該第二段 階破綻処理入札に係る落札金額及び落札参 加者を確定させる。第2項及び第3項の規定 は、本号の規定により当社が当該第二段階破 綻処理入札に係る落札金額及び落札参加者 を確定させた場合について準用する。
- (4) 前号に規定する場合以外の場合には、 当該第二段階破綻処理入札は不成立とし、第 11条から本条までの規定に従い、第二段階 破綻処理入札実施日の翌日に、再度、第二段 階破綻処理入札を実施する。

(協議の方法等)

第15条 業務方法書第80条の4第1項に規|第15条 当社は、第二段階破綻処理入札を実施

入札を再実施する。

- (1) 当社は、第二段階破綻処理入札の終了 後直ちに、その暫定の落札結果を各清算参加 者(破綻清算参加者を除く。以下本項におい て同じ。) に通知する。
- (2) 当社は、第二段階破綻処理入札実施日 の午後2時までに、当該第二段階破綻処理入 札に係る落札金額及び落札参加者を確定さ せたと仮定した場合に各清算参加者が負担 することとなる第三階層特別清算料及び第 四階層特別清算料の額並びに第30条第1 号及び第31条第1号の規定により当社に 預託すべき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の額を通知する。
- (3) 第二段階破綻処理入札実施日の午後4 時までに、全ての清算参加者が当社に預託す べき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の全額を当社に預託し た場合には、当社は、直ちに当該第二段階破 綻処理入札に係る落札金額及び落札参加者 を確定させる。第2項及び第3項の規定は、 本号の規定により当社が当該第二段階破綻 処理入札に係る落札金額及び落札参加者を 確定させた場合について準用する。
- (4)前号に規定する場合以外の場合には、 当該第二段階破綻処理入札は不成立とし、第 11条から本条までの規定に従い、第二段階 破綻処理入札実施日の翌日(休業日に当たる ときは、順次繰り下げる。以下同じ。) に、 再度、第二段階破綻処理入札を実施する。

(協議の方法等)

定する協議は、次の各号に定めるときその他当 社が破綻処理入札の取扱い又は当該損失の処 理に関し必要と認める場合に行う。

- (1) 第5条の6第5項の規定によりバスケット破綻処理入札を実施した場合において、次のa又はbに定めるとき。
 - a 入札スタート売買金額の合計が入札対 象取引のスタート売買金額に満たないも のがあったとき。
 - b 落札現先レート及び落札参加者を確定 させる前に、当該入札に係る入札対象取引 を成立させることにより当社に生じ得る 破綻処理損失の額を試算し、当該額が第一 段階損失補填財源を超過するとき。
- (2) 第二段階破綻処理入札を実施した場合 において、次のa又はbに定めるとき。
 - <u>a</u> 入札額面の合計が入札対象取引の額面 に満たないものがあったとき。
 - b 落札金額及び落札参加者を確定させる 前に、当該入札に係る入札対象取引を成立 させることにより当社に生じ得る破綻処 理損失の額を試算し、当該額が第二段階損 失補填財源を超過するとき。
- 2 生存清算参加者は、当該生存清算参加者の国 債店頭取引運営委員会における委員代表者若 しくは特別委員代表者又はこれに代わる当該 生存清算参加者を代表若しくは代理する者を して、当社との間における前項の協議及び業務

した場合には、その落札金額及び落札参加者を確定させる前に、当該第二段階破綻処理入札に係る入札対象取引を成立させることにより当社に生じ得る破綻処理損失の額を試算する。この場合において、当該額が第二段階損失補填財源を超過することが判明した場合には、当社及び清算参加者(破綻清算参加者を除く。以下本条及び次条において同じ。)は、直ちに業務方法書第80条の4の規定により協議を行う。(新設)

(新設)

2 <u>清算参加者</u>は、当該<u>清算参加者</u>の国債店頭取 引運営委員会における委員代表者若しくは特 別委員代表者又はこれに代わる当該清算参加 者を代表若しくは代理する者をして、当社との 間における前項の協議及び業務方法書第80 方法書第80条の4の合意を行わせるものと する。

3 (略)

4 当社は、前項の規定より協議の実施に関し定めた事項については、あらかじめすべての<u>生存</u>清算参加者に対し通知する。

5 (略)

(協議期間)

第16条 業務方法書第80条の5第1項に規定する当社が規則で定める期間は、第二段階破綻処理入札実施日から起算して2日目(休業日を除外する。)の日までの間とする。ただし、当社及びすべての生存清算参加者の間で合意した場合には、当該期間を延長することができる。

(破綻清算参加者に係る一括清算及び差引計算 における国債証券引渡返還債務等に係る評価 額の特例)

第17条 業務方法書第79条第7項及び第8 0条第5項に規定する場合の国債証券引渡返 還債務、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(以下この条において 「国債証券引渡返還債務等」という。)に係る 評価額は、次の各号に定めるところによる。

 $(1) \cdot (2)$ (略)

(未決済ポジションの一括清算)

第18条 業務方法書第80条の5第1項に規 定する未決済ポジションの一括清算における 未決済資金ポジション及び未決済証券ポジションの評価額は次の各号に規定するところに 条の4の合意を行わせるものとする。

3 (略)

4 当社は、前項の規定より協議の実施に関し定めた事項については、あらかじめすべての<u>清算</u>参加者に対し通知する。

5 (略)

(協議期間)

第16条 業務方法書第80条の5第1項に規定する当社が規則で定める期間は、第二段階破綻処理入札実施日から起算して2日目(休業日を除外する。)の日までの間とする。ただし、当社及びすべての<u>清算参加者</u>の間で合意した場合には、当該期間を延長することができる。

(破綻清算参加者に係る一括清算及び差引計算 における国債証券引渡返還債務等に係る評価 額の特例)

第17条 業務方法書第79条第7項及び第8 0条第5項に規定する場合の国債証券引渡返 還債務、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(以下この条において 「国債証券引渡返還債務等」という。)に係る 評価額は、次の各号に定めるところにより。 (1)・(2) (略)

(未決済ポジションの一括清算)

第18条 業務方法書第80条の5第1項に規 定する未決済ポジションの一括清算における 未決済資金ポジション及び未決済証券ポジションの評価額は次の各号に規定するところに よる。

- (1) 未決済資金ポジションの評価額は、当該未決済資金ポジションを構成する各債務 の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(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)を使用して算出した未決済ポジションの一括清算を行う日(以下「一括清算実行日」という。)における現在価値の合計額とする。
- (2) 未決済証券ポジション (スタート/R ewind国債引渡債務(バスケット)及び エンド/Unwind国債引渡債務(バスケ ット)を除く。)の評価額は、未決済証券ポ ジションを構成する各債務について、一括清 算実行日の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、一括清算実行日までの日数(休 業日を含む。)に応じた経過利子(円位未満 は切り捨てる。) を加算した額の合計額とす る。
- (3) スタート/Rewind国債引渡債務 (バスケット)及びエンド/Unwind国 債引渡債務(バスケット)の評価額は、当該 各債務を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(当社が必要と認

よる。

(1) 未決済資金ポジションの評価額は、当該未決済資金ポジションを構成する各債務を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(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)を使用して算出した未決済ポジションの一括清算を行う日(以下「一括清算実行日」

という。)における現在価値の合計額とする。

(2) 未決済証券ポジションの評価額は、未 決済証券ポジションを構成する各債務について、一括清算実行日の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<u>利回り</u>の平均値により算出する 価格(当該銘柄が変動利付国債である場合に あっては、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)により評価し た額(円位未満は切り捨てる。)に、一括清 算実行日までの日数(休業日を含む。)に応 じた経過利子(円位未満は切り捨てる。)を 加算した額の合計額とする。

めるときは、当社がその都度定める割引率) を使用して算出した当該各債務の一括清算 実行日における現在価値の合計額とする。

 $2 \sim 5$ (略)

(<u>原取引按分方式損失総額の算出に使用する割</u> 合)

第20条 <u>業務方法書第2条第26号に定める</u> 方法により算出する割合は、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。)に係る金額(Rewind金銭支払債務及びUnwind金銭支払債務に係る債務引受金額を除く。)に対する当該清算対象取引のうち信託口を一方当事者とするものに係る金額の割合とする。

(各原取引按分清算参加者の負担割合)

第21条 業務方法書第83条の2<u>第1項</u>第3 号に規定する各原取引按分清算参加者の負担 割合は、当社が破綻処理損失の起因となった破 綻清算参加者から債務の引受けを行った清算 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。)のうち信託口を一方当事者と するものに係る債務引受金額<u>(Rewind金</u> <u>銭支払債務及びUnwind金銭支払債務に</u> <u>係る債務引受金額を除く。)</u>に対する当該清算 対象取引のうち当該原取引按分清算参加者が 有する信託口を一方当事者とするものに係る 債務引受金額<u>(Rewind金銭支払債務及び</u> <u>Unwind金銭支払債務に係る債務引受金</u> 額を除く。)の割合とする。

(清算基金の劣後費消の対象)

 $2 \sim 5$ (略)

(原取引按分方式負担割合)

第20条 業務方法書第82条第1号に規定する原取引按分方式負担割合は、当社が破綻処理 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。)に係る債務引受金額に対する当該清算対象取引のうち信託口を一方当事者とするものに係る債務引受金額の割合とする。

(各原取引按分清算参加者の負担割合)

第21条 業務方法書第83条の2第3号に規定する各原取引按分清算参加者の負担割合は、当社が破綻処理損失の起因となった破綻清算参加者から債務の引受けを行った清算対象取引(当該清算対象取引に係る決済が未了のものに限る。)のうち信託口を一方当事者とするものに係る債務引受金額に対する当該清算対象取引のうち当該原取引按分清算参加者が有する信託口を一方当事者とするものに係る債務引受金額の割合とする。

(清算基金の劣後費消の対象)

- 第22条 業務方法書第83条の2<u>第1項</u>第5 号b及びc並びに第83条の5第2項第1号 及び第2号に規定する当社が定める額は、次の 各号に掲げる破綻処理入札の区分ごとに当該 各号に定める額とする。
 - (1) 第一段階破綻処理入札 第一段階破綻処理入札において落札した清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額に、当該清算参加者が落札した入札対象取引のリスク量の第一段階破綻処理入札における全入札対象取引のリスク量に対する割合(第8条第1項に規定する第一段階破綻処理入札における入札対象取引の概要に記載されたものをいう。)を乗じた額。
 - (2) 第二段階破綻処理入札 第二段階破綻 処理入札において落札した清算参加者の第 二階層清算参加者負担限度額に、当該清算参 加者が落札した入札対象取引のリスク量の 第二段階破綻処理入札における全入札対象 取引のリスク量に対する割合<u>(第12条に規</u> 定する第二段階破綻処理における入札対象 取引の内容に記載されたものをいう。)を乗 じた額。
- (破綻処理単位期間の終了日における清算基金 の追加預託時限)
- 第22条の2 業務方法書第83条の3第3項 に規定する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の追加預託は、破綻処 理単位期間の終了日の翌日の午前10時まで に行われるものとする。

(第三階層特別清算料及び第四階層特別清算料の支払いの方法)

- 第22条 業務方法書第83条の2第5号b及びc並びに第83条の5第2項第1号及び第2号に規定する当社が定める額は、次の各号に掲げる破綻処理入札の区分ごとに当該各号に定める額とする。
 - (1) 第一段階破綻処理入札 第一段階破綻処理入札において落札した清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額に、当該清算参加者が落札した入札対象取引のリスク量の第一段階破綻処理入札における全入札対象取引のリスク量に対する割合を乗じた額。
 - (2) 第二段階破綻処理入札 第二段階破綻 処理入札において落札した清算参加者の第 二階層清算参加者負担限度額に、当該清算参 加者が落札した入札対象取引のリスク量の 第二段階破綻処理入札における全入札対象 取引のリスク量に対する割合を乗じた額。

(新設)

(第三階層特別清算料及び第四階層特別清算料の支払いの方法)

第23条 <u>生存清算参加者は、</u>当社に預託する特別清算料担保金から充当される方法により第三階層特別清算料及び第四階層特別清算料を 当社に支払う。

(原取引按分清算参加者が負担する第三階層特別清算料の額)

第24条 原取引按分清算参加者について、業務 方法書第83条の4に規定する当社が規則で 定める第三階層特別清算料の額は、原取引按分 方式損失総額から第1号及び第2号に掲げる 金額を控除した額を第21条に規定する各原 取引按分清算参加者の負担割合に応じて按分 した額から、第3号に掲げる金額を控除した額 とする。

(1) <u>業務方法書第83条の規定により第一</u> <u>階層国債店頭取引決済保証準備金の取崩し</u> により補填した額

(2) 業務方法書第83条の2の規定により 第二階層国債店頭取引決済保証準備金一次 取崩額のうち原取引按分方式において取崩 しをすべき額の取崩しにより補填した額

(3) 業務方法書第83条の2の規定により 当該原取引按分清算参加者が預託した国債 店頭取引清算基金の取崩しにより補填した 額 第23条 <u>清算参加者は、</u>当社に預託する特別清 算料担保金から充当される方法により第三階 層特別清算料及び第四階層特別清算料を当社 に支払う。

(原取引按分清算参加者が負担する第三階層特別清算料の額)

第24条 原取引按分清算参加者について、業務 方法書第83条の4に規定する当社が規則で 定める第三階層特別清算料の額は、原取引按分 方式対象損失総額から業務方法書第83条の 規定により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した額及び業務方法 書第83条の2の規定により第二階層国債店 頭取引決済保証準備金一次取崩額のうち原取 引按分方式において取り崩しをすべき額の取 崩しにより補填した額を控除した額を第21 条に規定する各原取引按分清算参加者の負担 割合に応じて按分した額から、業務方法書第8 3条の2の規定により当該原取引按分清算参 加者が預託した国債店頭取引清算基金の取崩 しにより補填した額を控除した額とする。

(新設)

(新設)

(<u>清算基金按分清算参加者</u>が負担する第三階層 特別清算料の額等)

- 第25条 清算基金所要額按分清算参加者について、業務方法書第83条の4に規定する当社が規則で定める第三階層特別清算料の額は、次の各号に掲げる場合に応じて、当該各号に定める額とする。
 - (1) 清算基金按分方式損失総額から業務方 法書第83条の2第4号及び第5号の規定 により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及び第二階層 国債店頭取引決済保証準備金からの取崩し により補填した額を控除した額が各清算基 金按分清算参加者の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 の開始日の前日(休業日に当たるときは、順 次繰り上げる。以下同じ。) における国債店 頭取引清算基金所要額(当該破綻清算参加者 に係る破綻処理入札までに、当該各清算参加 者が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第三階層特別清 算料を負担した場合には、その負担額を控除 した残額とする。以下本項において「第三階 層特別清算料限度額」という。)の合計額を 下回る場合 次のaからcまでに掲げる順 序に従い、当該aからcまでに定める額
 - 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

(<u>清算基金所要額按分清算参加者</u>が負担する第 三階層特別清算料の額等)

- 第25条 清算基金所要額按分清算参加者について、業務方法書第83条の4に規定する当社が規則で定める第三階層特別清算料の額は、次の各号に掲げる場合に応じて、当該各号に定める額とする。
 - (1) 清算基金所要額按分方式対象損失総額 から業務方法書第83条の2第4号及び第 5号の規定により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 基金及び第二階層国債店頭取引決済保証準 備金からの取崩しにより補填した額を控除 した額が各清算基金所要額按分清算参加者 <u>(破綻清算参加者を除く。)</u>の当該破綻清算 参加者に係る破綻認定日の属する破綻処理 単位期間の開始日の前日(休業日に当たると きは、順次繰り上げる。以下同じ。)におけ る国債店頭取引清算基金所要額(当該破綻清 算参加者に係る破綻処理入札までに、当該各 清算参加者が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第三階 層特別清算料を負担した場合には、その負担 額を控除した残額とする。以下本項において 「第三階層特別清算料限度額」という。)の 合計額を下回る場合 次のaからcまでに掲 げる順序に従い、当該 a から c までに定める
 - 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第三階層特別清算料負担参加者(以下この a において「対象清算参加者」という。)の負担する第三階層特別清算料の額 清算基金按分方式損失総額を各対象清算参加者の第三階層特別清算料限度額に応じて按分した額(当該破綻処理損失の額が対象清算参加者の第三階層特別清算料限度額の総額以上である場合には、各対象清算参加者の第三階層特別清算料限度額)

- b 各第三階層特別清算料負担参加者 (前 a に掲げる第三階層特別清算料負担参加者 を除く。)の負担する第三階層特別清算料の額 清算基金按分方式損失総額から前 a に定める額の総額を控除した残額を当該各第三階層特別清算料負担参加者の第三階層特別清算料限度額から劣後負担額を控除した額に応じて按分した額(当該残額が当該各第三階層特別清算料負担参加者の第三階層特別清算料限度額の総額以上である場合には、当該各第三階層特別清算料限度額の第三階層特別清算料限度額の第三階層特別清算料限度額の第三階層特別清算料限度額)
- c 当該破綻清算参加者に係る破綻処理入 札において入札対象取引を落札した第三 階層特別清算料負担参加者の負担する第 三階層特別清算料の額 清算基金按分方 式損失総額から a 及び前 b に定める額の 総額を控除した残額を当該各第三階層特 別清算料負担参加者の劣後負担額に応じ て按分した額

- 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第三階層特別清算料負担参加者(以下この a において「対象清算参加者」という。)の負担する第三階層特別清算料の額 清算基金所要額按分方式対象損失総額 を各対象清算参加者の第三階層特別清算料限度額に応じて按分した額(当該破綻処理損失の額が対象清算参加者の第三階層特別清算料限度額の総額以上である場合には、各対象清算参加者の第三階層特別清算料限度額の
- b 各第三階層特別清算料負担参加者(上記 a に掲げる第三階層特別清算料負担参加 者を除く。)の負担する第三階層特別清算 料の額 清算基金所要額按分方式対象損失 総額から上記 a に定める額の総額を控除 した残額を当該各第三階層特別清算料負 担参加者の第三階層特別清算料限度額か ら劣後負担額を控除した額に応じて按分 した額(当該残額が当該各第三階層特別清 算料負担参加者の第三階層特別清算料限 度額の総額以上である場合には、当該各第 三階層特別清算料負担参加者の第三階層 特別清算料限度額)
- c 当該破綻清算参加者に係る破綻処理入 札において入札対象取引を落札した第三 階層特別清算料負担参加者の負担する第 三階層特別清算料の額 清算基金所要額按 分方式対象損失総額から上記 a 及び b に 定める額の総額を控除した残額を当該各 第三階層特別清算料負担参加者の劣後負 担額に応じて按分した額

(2) (略)

2 (略)

(第二階層清算参加者負担限度額(原取引按分) の未負担額の割当方法)

第26条 業務方法書第83条の5第2項第1 号に規定する当社が規則で定める方法は、対象 となる原取引按分清算参加者のうち、未負担割 合(当該原取引按分清算参加者の未負担額(第 22条第2号に定める額を控除する。) の当該 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)(第22条第2号に定める額を 控除する。) に対する割合をいう。以下この号 において同じ。) の最も大きい清算参加者の未 負担割合がその次に未負担割合の大きい清算 参加者の未負担割合と同率になるまで割当て を行い、当該二清算参加者の未負担割合が同率 となった場合は、当該二清算参加者の未負担額 がその次に未負担割合の大きい清算参加者の 大きい清算参加者の未負担割合と同率になる まで割当てを行い、順次それを繰り返す方法と する。この場合において、割当ての過程で割り 当てるべき国債店頭取引清算基金の残額が0 となった清算参加者については、その時点で割 当てを終了する。

(変動証拠金等の範囲)

- 第28条 業務方法書第83条の7第1項に規 定する変動証拠金等は、次の各号に定めるもの とし、第2号に定めるものは当社に対する国債 証券の渡方清算参加者に適用する。
 - (1) 業務方法書第49条、第50条、<u>第5</u><u>0条の9、第50条の10、</u>第52条、第53条、第54条、第65条、第66条及び第

(2) (略)

2 (略)

(<u>原取引按分清算参加者第二階層負担限度額</u>の 未負担額の割当方法)

第26条 業務方法書第83条の5第2項第1 号に規定する当社が規則で定める方法は、対象 となる原取引按分清算参加者のうち、未負担割 合(当該原取引按分清算参加者の未負担額(第 22条第2号に定める額を控除する。) の当該 清算参加者の原取引按分清算参加者第二階層 負担限度額(第22条第2号に定める額を控除 する。) に対する割合をいう。以下この号にお いて同じ。)の最も大きい参加者の未負担割合 がその次に未負担割合の大きい参加者の未負 担割合と同率になるまで割当てを行い、当該二 参加者の未負担割合が同率となった場合は、当 該二参加者の未負担額がその次に未負担割合 の大きい参加者の大きい参加者の未負担割合 と同率になるまで割当てを行い、順次それを繰 り返す方法とする。この場合において、割当て の過程で割り当てるべき清算基金の残額が0 となった清算参加者については、その時点で割 当てを終了する。

(変動証拠金等の範囲)

- 第28条 業務方法書第83条の7第1項に規 定する変動証拠金等は、次の各号に定めるもの とし、第2号に定めるものは当社に対する国債 証券の渡方清算参加者に適用する。
 - (1) 業務方法書第49条、第50条、第5 2条、第53条、第54条、第65条、第6 6条及び第67条の規定により授受すべき

- 67条の規定により授受すべき金銭
- (2) 当社が業務方法書第74条の規定により清算参加者を相手方とした<u>銘柄先決め現</u> 先取引により調達した金銭により国債証券 の渡方清算参加者に対する証券決済債務時 価評価額の支払いを行った場合における、当 該支払いを行った日から当初損失確定日ま での間の当該支払いに対応する国債証券の 時価評価額の変動額

(破綻時証拠金所要額)

- 第33条 業務方法書第83条の9の各清算参加者の破綻時証拠金所要額は、破綻処理単位期間における各日(休業日を除く。以下この条において同じ。)において、次の各号に定めるところにより算出する額とする。ただし、破綻処理単位期間の終了日における破綻時証拠金所要額は0とする。
 - (1) 破綻処理単位期間における各日において、国債店頭取引清算基金所要額に関する規則別表「国債店頭取引清算基金所要額の算出に関する表」に準じて国債店頭取引清算基金所要額に相当する額(以下「国債店頭取引清算基金所要額相当額」という。)を算出する。この場合において、同表第2項に規定する「各清算参加者の一回目算出証拠金所要額」とあるのは、「各生存清算参加者の一回目算出証拠金所要額」と読み替えるものとする。

 $(2) \cdot (3)$

第35条 業務方法書第84条第1項に規定する当社が規則で定める者は、次に掲げる清算券

(略)

(回収金の分配を受ける清算参加者)

る当社が規則で定める者は、次に掲げる清算参 加者とする。 金銭

(2) 当社が業務方法書第74条の規定により清算参加者を相手方とした<u>現金担保付き債券貸借取引</u>により調達した金銭により国債証券の渡方清算参加者に対する証券決済債務時価評価額の支払いを行った場合における、当該支払いを行った日から当初損失確定日までの間の当該支払いに対応する国債証券の時価評価額の変動額

(破綻時証拠金所要額)

- 第33条 業務方法書第83条の9の各清算参加者の破綻時証拠金所要額は、破綻処理単位期間における各日(休業日を除く。以下この条において同じ。)において、次の各号に定めるところにより算出する額とする。ただし、破綻処理単位期間の終了日における破綻時証拠金所要額は0とする。
 - (1) 破綻処理単位期間における各日において、国債店頭取引清算基金所要額に関する規則別表「国債店頭取引清算基金所要額の算出に関する表」に準じて国債店頭取引清算基金所要額に相当する額(以下「国債店頭取引清算基金所要額相当額」という。)を算出する。

(2) • (3) (略)

(回収金の分配を受ける清算参加者)

第35条 業務方法書第84条第1項に規定する当社が規則で定める者は、次に掲げる清算参加者とする。

 $(1) \sim (3)$ (略)

(4) 業務方法書第80条の5第1項の規定 により未決済ポジションの一括清算が行わ れた場合において、当該未決済ポジションの 再構築に当たり損失を被った清算参加者

(複数のネッティングロ座を開設している清算 参加者の特例)

第38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、次の表の上欄に掲げる規定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22条	国債店頭取引	ネッティング口座
<u>02</u>	清算基金	ごとの国債店頭取
		引清算基金
(略)		
第28条	(略)	ネッティング口座
		ごとの変動証拠金
		等は、ネッティン
		グロ座ごと <u>に</u>
(略)		

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

 $(1) \sim (3)$ (略)

(4) 業務方法書第80条の5第1項の規定 により未決済ポジションの一括清算が行わ れた場合において、当該未決済ポジションの 再構築にあたり損失を被った清算参加者

(複数のネッティングロ座を開設している清算 参加者の特例)

第38条 複数のネッティングロ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)		
(新設)	(新設)	(新設)
(略)		
第28条	(略)	ネッティング口座
		ごとの変動証拠金
		等は、ネッティング
		口座ごと <u>の</u>
(略)		

がその都度定める。	