

業務方法書の取扱い

(目的)

第1条 この規則は、業務方法書に基づき、当社が定める事項について規定する。

(清算対象取引)

第2条 業務方法書第3条第1項に規定する当社が定める国債証券は、次の各号に掲げるもの（流動性等を勘案し当社が適当でないとするものを除く。）とする。

- (1) 利付国債（利子を非課税扱いとするものに限り、承継国債（政府が承継した日本国有鉄道清算事業団債務に係る国債の取扱い等に関する省令（平成10年大蔵省令第35号）第1条、国が承継した石油公団債務に係る国債の取扱い等に関する省令（平成15年財務省令第22号）第1条及び政府が承継した本州四国連絡橋公団債務に係る国債の取扱い等に関する省令（平成15年財務省令第57号）第1条に規定する承継国債をいう。）、物価連動国債（物価連動国債の取扱いに関する省令（平成16年財務省令第7号）第1条に規定する物価連動国債をいう。）及び個人向け国債（個人向け国債の発行等に関する省令（平成14年財務省令第68号）第2条に規定する個人向け国債をいう。）を除く。以下同じ。)
- (2) 割引国債（次号に掲げるものを除き、分離元本振替国債（社債、株式等の振替に関する法律（平成13年法律第75号。以下「社振法」という。）第90条第2項に規定する分離元本振替国債をいう。以下同じ。）及び分離利息振替国債（同法第90条第3項に規定する分離利息振替国債をいう。以下同じ。）を含む。以下同じ。)
- (3) 国庫短期証券

2 業務方法書第3条第2項に規定する当社が定める取引は、次の各号に掲げる取引ごとに、当該各号に定める事項に適合する取引とする。

- (1) 国債証券の売買等
 - a 売買決済日が約定日の1か月後の応答日（当該応答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。）、当該応答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答日の前日（休業日に当たるときは、順次繰り上げる。以下同じ。））とする。以下同じ。）の前日までに到来すること（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。）においては、売買決済日が約定日の1か月後の応答日の前日まで、又は、発

行日に到来すること)。

- b 売買決済日が利払期日前3日間(銀行休業日を除外する。)及び償還期日前3日間(銀行休業日を除外する。)に該当しないこと。
- c 対象国債証券の数量が額面5万円(変動利付国債にあつては額面10万円、国庫短期証券にあつては額面1,000万円)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、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。
- e 当社に債務の引受けの申込みを行う時点で、対象国債証券の銘柄及び利率が確定していること。

(2) 現金担保付債券貸借取引等

- a 取引決済日が約定日の1年後の応答日までに到来すること。
- b 取引実行日及び取引決済日が利払期日前3日間(銀行休業日を除外する。)及び償還期日前3日間(銀行休業日を除外する。)に該当しないこと。
- c 当社に債務の引受けの申込みを行う時点で、取引決済日が確定していること。
- d 対象国債証券の数量が額面5万円(変動利付国債にあつては額面10万円、国庫短期証券にあつては額面1,000万円)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、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。
- f 基準担保金率(借方清算参加者が維持すべき担保金の金額を算出するために時価総額に乗じる比率をいう。)が100パーセントであること。

(3) 現先取引等

- a エンド取引受渡日が約定日の1年後の応答日までに到来すること。
- b スタート取引受渡日及びエンド取引受渡日が利払期日前3日間(銀行休業日を除外する。)及び償還期日前3日間(銀行休業日を除外する。)に該当しないこと。
- c 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。
- d エンド取引受渡日までの間に対象国債証券の償還期日が到来しないこと。
- e 対象国債証券の数量が額面5万円(変動利付国債にあつては額面10万円、国庫短期証券にあつては額面1,000万円)の整数倍であること。
- f 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。

g 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が現先売方清算参加者に利払期日に支払うものをいう。）であること。

h 売買金額算出比率（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

（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項までに規定する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） 取得しようとする清算資格の区分（業務方法書第6条第2項に規定する清算資格の取得の申請を行う場合にあつては、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自社清算資格である旨、同条第3項に規定する清算資格の取得の申請を行う場合にあつては、その者が清算資格を取得した場合において、当社が同第42条第1項及び同第42条の2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自社清算資格である旨）

（2） 商号又は名称（英文の商号又は名称を含む。）

（3） 本店又は主たる事務所の所在地

（4） 代表者名

（5） 清算資格の取得申請理由

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

（当社が定める比率）

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

（届出事項）

第5条 業務方法書第11条第1項、同第12条、同第18条及び同第40条の2第2項に規定する当社への届出は、当社が指定するときまでに、所定の届出書に当社が必要と認める書類を添付して行うものとする。

(報告事項)

第6条 業務方法書第19条に規定する当社が定める場合は、次の各号に掲げる場合とし、所定の報告書に当社が必要と認める書類を添付して報告するものとする。

- (1) 損失の危険の管理方法、業務分掌の方法その他の業務の内容及び方法を定めたとき又は変更したとき。
- (2) 事業を休止し、又は再開したとき。
- (3) 破産手続開始、再生手続開始、更生手続開始若しくは清算開始又は特別清算開始の申立てを行ったとき又はこれらの申立て若しくは通告が行われた事実を知ったとき。
- (4) 支払不能となり又は支払不能となるおそれがある状態となったとき。
- (5) 純財産額（金融商品取引業者以外の者にあつては、純資産額とする。以下この号において同じ。）が50億円及び10億円を下回ったとき（当該清算参加者が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）。
- (6) 資本金の額又は出資の総額が3億円を下回ったとき。
- (7) 金融商品取引業者にあつては、自己資本規制比率が200パーセント及び140パーセントを下回ったとき、証券金融会社又は短資会社にあつては、これに準ずる場合に該当したとき、銀行等にあつては、海外事業拠点を有する場合は国際統一基準に係る単体又は連結自己資本比率が8パーセントを、海外事業拠点を有しない場合は国内基準に係る単体又は連結自己資本比率が4パーセントを下回ったとき（外国銀行にあつては、これに準ずる場合に該当したとき）、保険会社にあつては、ソルベンシー・マージン比率が400パーセント及び200パーセントを下回ったとき。
- (7)の2 総株主の議決権（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法（平成17年法律第86号）第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含む。）又は出資に係る議決権の過半数が一の個人又は他の一の法人又その他の団体によって保有されることを知ったとき。

- (8) 大株主上位10名(自己又は他人の名義をもって所有する株式の数が多い順に10名の株主をいう。)に関し変更があったとき。
- (8)の2 役員が他の会社その他の法人の役員に就任又は退任したとき
- (9) 法令の規定により処分若しくは処罰を受けたとき又は法令の規定による処分に係る聴聞若しくは弁明の機会の付与が行われたとき。
- (10) 金融商品取引業者にあつては、役員が法第29条の4第1項第2号イからトまでに掲げる者のいずれかに該当することとなった事実を知ったとき、金融商品取引業者以外の者にあつては、役員が破産手続開始の決定、禁錮以上の刑又は法令の規定により罰金の刑を受けた事実を知ったとき。
- (11) 金融商品取引業者の主要株主(法第29条の4第2項に規定する主要株主をいう。以下この号において同じ。)が法第29条の4第1項第5号ニ又はホに該当することとなった事実を知ったとき(外国法人にあつては、主要株主に準ずるものが同号へに該当することとなった事実を知ったとき)。
- (12) 民事事件に係る訴え(訴訟の目的の価額が10億円未満のものを除く。)を提起され若しくは当該訴訟について判決等があったとき(上訴の場合を含む。)又は民事調停法による調停(調停を求める事項の価額が10億円未満のものを除く。)を申し立てられ若しくは当該調停事件が終結したとき。
- (13) 法第56条の2に基づくモニタリング調査表(証券金融会社又は短資会社にあつては、これに準ずるもの、他社清算参加者である登録金融機関にあつては、当社が定める主要勘定状況表とする。)を作成したとき。
- (14) 金融商品取引業者にあつては、事業報告書を作成したとき、銀行等又は保険会社にあつては、業務報告書又は中間業務報告書を作成したとき、証券金融会社にあつては、事業報告書又は中間決算状況表を作成したとき、短資会社にあつては、業務報告書を作成したとき。
- (15) 当社が定める決算概況表又は中間決算概況表を作成したとき。
- (16) 外国法人である金融商品取引業者にあつては、法第49条の3第1項に規定する貸借対照表、損益計算書その他財務計算に関する書類を作成したとき。
- 2 前項第14号に掲げる場合の報告においては、同項本文に定めるもののほか、同項第14号において作成した書面(中間業務報告書又は中間決算状況表を除く。)に添付される計算書類に係る会計監査人の監査報告書(これに準ずるものとして当社が適当と認めるものを含む。)を添付するものとする。
- 3 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つては、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。

- (1) 親会社が第1項第2号から第4号まで、第6号、第7号及び第12号から第16号までに該当することとなったとき。
- (2) 親会社の純財産額（金融商品取引業者以外の者にあつては、純資産額とする。）が200億円を下回ったとき。

4 前項において、親会社が第1項第14号に該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、親会社が第1項第14号において作成した書面（中間業務報告書又は中間決算状況表を除く。）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。

（清算資格の喪失申請）

第7条 業務方法書第21条に規定する清算資格の喪失申請は、清算資格の喪失申請者が、次の各号に掲げる事項を記載した所定の清算資格喪失申請書を当社に提出して行うものとする。

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

2 前項に規定する清算資格喪失申請書には、次の各号に掲げる書類を添付しなければならない。

- (1) 清算資格の喪失に係る日程表
- (2) その他当社が必要と認める書類

（純財産額等として維持すべき額）

第8条 業務方法書第28条第5項に規定する当社が定める額は、クリアリング・ファンド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クリアリング・ファンド基礎所要額（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つては、当該清算参加者のクリアリング・ファンド基礎所要額に当該清算参加者の親会社のクリアリング・ファンド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つては、当該親会社のクリアリング・ファンド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。）のクリアリング・ファンド基礎所要額を加算した額）とする。

- 2 複数のネットィング口座を開設している清算参加者について、前項の規定を適用する場合には、「清算参加者のクリアリング・ファンド基礎所要額」とあるのは、「清算参加者のネットィング口座ごとのクリアリング・ファンド基礎所要額の合計額」と、「当該親会社のクリアリング・ファンド基礎所要額」とあるのは、「当該親会社のネットィング口座ごとのクリアリング・ファンド基礎所要額の合計額」と読み替えるものとする。
- 3 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の親会社が複数のネットィング口座を開設している場合において、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。）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クリアリング・ファンド基礎所要額」とあるのは、「当該清算参加者の親会社のネットィング口座ごとのクリアリング・ファンド基礎所要額の合計額」と読み替えるものとする。
- 4 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が複数のネットィング口座を開設している場合において、当該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。）のクリアリング・ファンド基礎所要額」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。）のネットィング口座ごとのクリアリング・ファンド基礎所要額の合計額」と読み替えるものとする。

（債務の引受けの申込み等の方法）

第9条 業務方法書第39条第1項、同第40条第1項、同第40条の2第1項及び同第41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。

（代理人の承認手続き）

第10条 清算参加者は、業務方法書第39条第4項（同第40条第3項及び同第40条の2第6項の規定により準用される場合を含む。）、同第41条第3項、同第45条第2項（同第48条第4項及び同第52条第2項の規定により準用される場合を含む。）、同第65条第2項（同第53条第2項、同第55条第2項、同第56条第2項、同第58条第2項及び同第59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66条第11項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65条第2項及び同第66条第11項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11条 業務方法書第44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 決済日等の日付で日本証券業協会から売買参考統計値が発表されない銘柄に係る前項に規定する価格については、当社がその都度定める。

(国債証券及び金銭の授受方法)

第12条 業務方法書第45条第1項第1号及び第2号並びに第2項(同第48条第4項及び同第52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、社振法に基づき日本銀行に開設された口座の振替により行うものとし、この場合における国債資金同時受渡依頼は、次の各号に定めるところによる。

(1) 渡方清算参加者と当社との間の決済については、次のa又はbに掲げる区分に従い、当該a又はbに定めるところにより行う。

a 渡方清算参加者の口座と当社の口座との間で振替を行う場合

渡方清算参加者が、日本銀行に対して国債資金同時受渡依頼を行う。

b 業務方法書第45条第2項に規定する代理人の口座と当社の口座との間で振替を行う場合

当該代理人が、日本銀行に対して国債資金同時受渡依頼を行う。この場合において、同第45条第2項に規定する承認を得た渡方清算参加者は、当該代理人に対し必要な指示を行うものとする。

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

2 業務方法書第45条第1項第1号及び第2号並びに第2項に規定する金銭の授受は、次の各号に規定するところにより行うものとする。

(1) 金銭を支払う清算参加者は、日本銀行金融ネットワークシステムを利用した国債資金同時受渡に伴う金銭の受払いを行うために日本銀行に設けられた当該清算参加者の当座勘定(業務方法書第45条第2項の定めるところにより代理人を通じて同条第1項第1号及び第2号に規定する金銭の授受を行う場合には、当該代理人の当座勘定)のうちから、当該清算参加者が指定した当座勘定(以下「指定当座勘定」という。)

から、日本銀行に設けられた当社の当座勘定に振り替えるものとする。この場合における資金受渡依頼は、次の a 又は b に規定するところにより行うものとする。

a 金銭を支払う清算参加者の当座勘定から振り替える場合

金銭を支払う清算参加者が、日本銀行に対して資金受渡依頼を行う。

b 代理人の当座勘定から振り替える場合

当該代理人が、日本銀行に対して資金受渡依頼を行う。この場合において、業務方法書第 4 5 条第 2 項に規定する承認を得た金銭を支払う清算参加者は、当該代理人に対し必要な指示を行うものとする。

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

- 3 前 2 項に規定する受渡依頼は、当社が指定する数量又は金額ごとに行うものとする。この場合において、当社は、各受渡依頼に係る国債証券の額面総額が 5 0 億円を超えないように指定するものとする。

(利払期日が到来した場合に償還期日が到来したものとして取扱う国債証券)

第 1 3 条 業務方法書第 5 0 条第 1 項及び同第 6 6 条第 1 0 項に規定する当社が定める国債証券は、分離利息振替国債とする。

(マージンコールに係る現在価値)

第 1 4 条 業務方法書第 6 1 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 4 日目の日（当該日が利払期日前 3 日間（銀行休業日を除外する。）に該当する場合は利払期日、当該日が償還期日前 3 日間（銀行休業日を除外する。）に該当する場合は償還期日）をいう。以下同じ。）が当該銘柄の利払期日（計算日以降最初に到来するものに限る。以下同じ。）の 4 日前の日までに到来する場合においては、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（計算日のレギュラー受渡日が当該銘柄の利払期日以降に到来する

場合においては、決済日等が当該利払期日の4日前の日までに到来する国債証券の売買等に係る金銭の受領額の現在価値から利金相当額を減じた額と、支払額の現在価値から利金相当額を減じた額の差引額)を、受領又は支払いの別ごとに合算した額とする。

(2) 現金担保付債券貸借取引等及び現先取引等

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現先取引等に係る金銭の受領額と支払額の差引額について、それぞれ、決済日等ごと、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(計算日のレギュラー受渡日が利払期日又はその翌日(休業日に当たるときは、順次繰り下げる。以下同じ。))に到来する場合においては、現金担保付債券貸借取引等及び現先取引等に係る金銭の受領額の現在価値から利金相当額を減じた額と、支払額の現在価値から利金相当額を減じた額の差引額)を、受領又は支払いの別ごとに合算した額とする。

(フェイルに係る現在価値)

第15条 業務方法書第62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又はその翌日に到来する場合においては、フェイルに係る金銭の受領額の現在価値から利金相当額を減じた額と、フェイルに係る金銭の支払額の現在価値から利金相当額を減じた額の差引額)を、受領又は支払いの別ごとに合算した額とする。

(現在価値の算出に使用する割引率)

第16条 前2条の現在価値の算出における当社が定める割引率は、日本銀行から公表される東京レポ・レート(レファレンス先平均値)をもとに当社が定める割引率とする。ただし、当社が必要と認めるときは、当社がその都度定める割引率とする。

2 前項ただし書の規定により当社が割引率を定めるときは、当社は、清算参加者に対し、当該割引率決定のため当社が必要と認めるレポレートの申告を求めることができる。

(マージンコールに係る時価評価額)

第17条 業務方法書第61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、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。

- 2 業務方法書第62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 計算日翌日付で日本証券業協会から売買参考統計値が発表されない銘柄に係る前2項に規定する価格については、当社がその都度定める。

（マージンコールに付す利息の利率）

第18条 業務方法書第63条第1項及び第2項に規定する当社が定める利率は、返還を行う日の前日に日本銀行が公表する無担保コールオーバーナイト物レートの加重平均値をもとに当社が定めるレートとする。

（FOS決済の方法）

第19条 業務方法書第65条第1項及び第2項（同第53条第2項、同第55条第2項、同第56条第2項、同第58条第2項及び同第59条第2項の規定により準用される場合を含む。以下この条において同じ。）に規定する金銭の受払いは、次の各号に規定するところにより行うものとする。

- （1） 金銭を支払う清算参加者は、当該清算参加者の当座勘定（業務方法書第65条第2項の定めるところにより代理人を通じて同条第1項に規定する金銭の授受を行う場合には、当該代理人の当座勘定）のうちから当該清算参加者が指定した当座勘定から、当社の当座勘定に振り替えるものとする。
- （2） 金銭を受領する清算参加者は、前号の規定により指定した当座勘定において受領するものとする。

(クリアリング・ファンドの金銭の取扱い)

第20条 業務方法書第66条第2項及び第5項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66条第11項の定めるところにより代理人を通じて同条第2項及び第5項に規定する金銭の預託を行う場合には、当該代理人の当座勘定。以下この条において同じ。）から当社の当座勘定への振替により行うものとする。

2 前項の定めるところにより預託された金銭に係る業務方法書第66条第3項に規定する返還は、日本銀行当座預金取引における当社の当座勘定から清算参加者の当座勘定への振替により行うものとする。

(クリアリング・ファンドを当日に預託する場合の取扱い)

第21条 業務方法書第66条第5項に規定する当社が定める基準は、長期国債先物取引（株式会社東京証券取引所（以下「東証」という。）が定める長期国債標準物に関する国債証券に係る法第2条第21項第1号に掲げる取引をいう。以下同じ。）のうち中心限月取引（最も流動性が高いものとして当社が定める限月取引をいう。）について、午前立会終了時の約定値段（東証が定めるところにより気配表示された気配値段を含む。）と前日の午後立会終了時の約定値段（東証が定めるところにより気配表示された気配値段を含む。）との差が、当社があらかじめ定めた数値を超えた場合とする。

2 業務方法書第66条第5項に規定する当社が定める額は、クリアリング・ファンド所要額に関する規則第2条に規定する各清算参加者のクリアリング・ファンド基礎所要額（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つては、当該清算参加者のクリアリング・ファンド基礎所要額に当該清算参加者の親会社のクリアリング・ファンド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つては、当該親会社のクリアリング・ファンド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。）のクリアリング・ファンド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 複数のネット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、「清算参加者のクリアリング・ファンド基礎所要額」とあるのは、「清算参加者のネットィング口座ごとのクリアリング・ファンド基礎所要額の合計額」と、「当該親会社のクリアリング・ファンド基礎所要額」とあるのは、「当該親会社のネットィング口座ごとのクリアリング・ファンド基礎所要額の合計額」と読み替えるものとする。

4 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の親会社が複数のネットィング口座を開設している場合において、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。）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クリアリング・ファンド基礎所要額」とあるのは、「当該清算参加者の親会社のネットィング口座ごとのクリアリング・ファンド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項の申請により清算資格を取得した清算参加者が複数のネットィング口座を開設している場合において、当該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。）のクリアリング・ファンド基礎所要額」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。）のネットィング口座ごとのクリアリング・ファンド基礎所要額の合計額」と読み替えるものとする。
- 6 業務方法書第66条第6項に規定する当社が定める時刻は、東証における長期国債先物取引の午前立会終了時とする。

（クリアリング・ファンドの代用国債証券の取扱い）

第22条 業務方法書第66条第7項に規定する当社が定める額は、5億円とする。

- 2 業務方法書第66条第7項に規定する国債証券の預託は、社振法に基づき日本銀行に設けられた清算参加者の口座（同条第11項の定めるところにより代理人を通じて同条第7項に規定する代用国債証券の預託を行う場合には、当該代理人の口座。以下この条において同じ。）から当社の口座への振替により行うものとする。この場合において、清算参加者は、利払期日前3日間（銀行休業日を除外する。）及び償還期日前3日間（銀行休業日を除外する。）においては当該国債証券の預託を行うことができない。
- 3 前項の定めるところにより預託された国債証券に係る業務方法書第66条第3項に規定する返還は、社振法に基づき日本銀行に設けられた当社の口座から清算参加者の口座への振替により行うものとする。この場合において、清算参加者は、利払期日前3日間（銀行休業日を除外する。）及び償還期日前3日間（銀行休業日を除外する。）においては当該国債証券の返還の請求を行うことができない。
- 4 業務方法書第66条第7項に規定する当社が定める国債証券は、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66条第8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 残存期間1年以内のもの	100分の99
b 残存期間1年超5年以内のもの	100分の99
c 残存期間5年超10年以内のもの	100分の97
d 残存期間10年超20年以内のもの	100分の97
e 残存期間20年超30年以内のもの	100分の96
f 残存期間30年超のもの	100分の95

(2) 変動利付国債

a 残存期間1年以内のもの	100分の98
b 残存期間1年超5年以内のもの	100分の98
c 残存期間5年超10年以内のもの	100分の96
d 残存期間10年超20年以内のもの	100分の96

(3) 分離元本振替国債及び分離利息振替国債

a 残存期間1年以内のもの	100分の98
b 残存期間1年超5年以内のもの	100分の98
c 残存期間5年超10年以内のもの	100分の96
d 残存期間10年超20年以内のもの	100分の96
e 残存期間20年超30年以内のもの	100分の94
f 残存期間30年超のもの	100分の92

(4) 国庫短期証券 100分の99

6 前項に規定する時価がない銘柄の時価及び時価に乗すべき率については、当社がその都度定める。

7 代用国債証券の評価額は、当該国債証券について、業務方法書第66条第8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23条 業務方法書第70条第2項に規定する当社が定める清算参加者は、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引のうち、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を相手方とし、当社が資金調達を行う日を決済日等とする一の銘柄に係る清算対象取引（当該清算対象取引に係る決済が行われたものを除く。）、同第48条の規定によるフェイルに関する一の銘柄に係る清算対象取引又は同第81条の規定により不履行となっている支払債務に係る一の銘柄に係る清算対象取引において、引き渡すべき国

債証券の数量を合計した数量が受領すべき国債証券の数量を合計した数量を上回っている者とする。

- 2 前項に規定する清算参加者に、業務方法書第70条第2項の規定により調達すべき額を按分する場合には、当該額に同条第1項第2号、第3号又は第4号の規定により清算参加者から資金調達を行った額を加算した額について、前項に規定する一の銘柄に係る清算対象取引における受領すべき金銭の額の合計額から支払うべき金銭の額の合計額を減じた額をすべての銘柄について合算した額（以下この条において「資金調達按分基準額」という。）で按分し、当該按分額から業務方法書第70条第1項第2号、第3号又は第4号の規定により各清算参加者から資金調達を行った額をそれぞれ減じるものとする。
- 3 清算参加者が合併した場合その他当社が必要と認めた場合には、当社がその都度定める金額を前項に規定する資金調達按分基準額とする。

（国債証券引渡返還債務の評価に使用する時価総額）

第24条 業務方法書第75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（休業日を含む。）に応じた経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。

（損失負担金の取扱い）

第25条 業務方法書第78条第1項に規定する当社が定める清算参加者は、不履行参加者を当事者とし、不履行発生日を決済日等とする清算対象取引（当該清算対象取引に係る決済が行われたものを除く。）、決済日等が到来していない清算対象取引、同第48条の規定によるフェイルに係る清算対象取引又は同第81条の規定により不履行となっている支払債務に係る清算対象取引の相手方である者とする。

- 2 前項に規定する清算参加者に、業務方法書第78条第1項の規定により不履行損失を按分する場合には、前項に規定する清算対象取引について当社が業務方法書第42条第1項及び同第42条の2第1項の規定により引き受けた債務の額（現金担保付貸借取引

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。)の合計額で按分するものとする。

- 3 清算参加者が合併した場合その他当社が必要と認めた場合には、当社がその都度定める金額を前項の合計額とする。

(当社が負担する損失額)

第26条 業務方法書第79条第1項に規定する当社が定める額は、同条第2項に規定する当社の剰余金相当額の100分の25の金額とする。ただし、当社が必要と認める場合は、当該剰余金相当額を上限として当該金額を変更することができる。

(追加損失負担金の取扱い)

第27条 業務方法書第79条第3項に規定する規定により同項に規定する超過額を不履行発生日の清算参加者に按分する場合には、当該超過額を、不履行発生日の清算参加者に各清算参加者1億円を上限として均等に按分するものとし、なお補填し得ない損失がある場合には、当該補填し得ない損失を不履行発生日の前日における各清算参加者のクリアリング・ファンド所要額で按分するものとする。

- 2 清算参加者が合併した場合その他当社が必要と認めた場合には、当社がその都度定める金額を前項に規定するクリアリング・ファンド所要額とする。

(遅延損害金の額)

第28条 業務方法書第82条に規定する当社が定める額は、支払債務の額100円につき1日4銭とする。

(ネットィング口座に係る申請)

第29条 業務方法書第84条第2項に規定する申請及び同第85条第1項に規定する申請は、所定の申請書に当社が必要と認める書類を添付して行うものとする。

(当社が委任する事務)

第30条 当社は、業務方法書第91条第1項の規定により、次の各号に掲げる者に対し、当該各号に定める事務を委任するものとする。

- (1) 株式会社日本証券クリアリング機構

清算参加者からの申請、届出及び報告の受理並びにそれに付随する事務

- (2) 株式会社証券保管振替機構

清算参加者との間の債務の引受けに関する情報の授受に係る事務

付 則

- 1 この規則は、平成17年5月2日から施行する。ただし、第3条及び第4条の規定は、平成17年4月22日から施行する。
- 2 施行日における第27条第1項の適用については、同項中「不履行発生日の前日」とあるのは「不履行発生日」とする。

付 則

この改正規定は、平成17年10月14日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成17年11月7日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成18年5月1日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成18年11月14日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成19年9月30日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成19年10月25日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成20年6月16日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成20年7月28日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成20年10月17日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成20年10月30日から施行する。

付 則

- 1 この改正規定は、平成21年1月28日から施行する。
- 2 割引短期国債又は政府短期証券として発行された国債については、国庫短期証券とみなして、改正後の規定を適用する。

付 則

この改正規定は、平成21年10月29日から施行する。