

「国債の即時グロス決済に関するガイドライン」の一部改正について

平成 23 年 6 月 9 日

日本証券業協会

1. 改正の趣旨

本協会では、平成 12 年 8 月、日銀ネットにおける当座預金決済及び国債決済の即時グロス決済（Real Time Gross Settlement、以下「RTGS」という。）化が実現されるに当たり、その円滑な移行の実現や、国債決済 RTGS 下における決済リスクの軽減及び決済の円滑性の確保を図るために遵守すべき市場慣行等を取りまとめた「国債の即時グロス決済に関するガイドライン」を公表し、その後もフェイルチャージの導入等に伴い、同ガイドラインの改正を行ってきたところである。

本協会の「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、国債のアウトライイト取引 T + 2 の実現に向け、ポストトレード事務の効率化を図るため、約定照合事務の電子化やネットティング照合事務の標準化等の検討を行ってきた。今般、所要の整備を図るため、同ガイドライン「 . 二当事者間におけるネットティングに関するガイドライン」の一部を改正することとする。

なお、本協会の「証券受渡・決済制度改革懇談会」及び「証券決済制度改革推進会議」において、平成 24 年 4 月 23 日約定分より、国債の売買（アウトライイト）取引における決済日を約定日から起算して、現行の「4 営業日目（T + 3）」から「3 営業日目（T + 2）」に短縮することが決定された。

2. 改正の骨子

- (1) 「標準的なネットティング・スキーム」の対象となる取引について、受渡日前営業日の約定照合時限の目安までに約定照合が完了した取引を対象とする。

(. 1 . (4))

- (2) 「標準的なネットティング・スキームに準じたネットティング」の対象に異額面の国債に係るネットティングを含めることとする。

(. 2 . (1))

- (3) 「標準的なネットティング・スキームに準じたネットティング」を行う際の取扱いを規定する。

(. 2 . (2))

- (4) 照合通知の送付方法について、当事者間の合意に基づく方法を選択できることとする。

る。

(． 3 .(4))

- (5) その他、「標準的なネットティング・スキーム」及び「標準的なネットティング・スキームに準じたネットティング」の対象を変更することに伴う所要の整備を図る。

3 . 実施の時期

この改正は、平成 24 年 4 月 23 日から実施する。

以 上

「国債の即時グロス決済に関するガイドライン」の一部改正について

平成 23 年 6 月 9 日
(下 線 部 分 変 更)

新	旧
・総論 1. 目的 近年、金融取引に係る「決済リスク対策」の必要性が国際的な高まりを示すなか、わが国においては日本銀行が、平成13 年 1 月4 日に日本銀行金融ネットワークシステム（以下「日銀ネット」という。）における当座預金決済及び国債決済の即時グロス決済（Real Time Gross Settlement、以下「RTGS」という。）化を実施した。 国債決済のRTGS 化に伴い、市場参加者においては、従来とは全く異なる決済処理手続きへの移行及び決済事務の増加等に適切に対応する必要があると考えられることから、本協会では、証券会社、銀行、信託銀行及び生命保険会社の各業態からのメンバーにより組成される「国債決済RTGS 化に関する研究会」を設置して検討を進め、国債のRTGSに関する市場慣行等について提言を取りまとめ、公表を行った。 さらに本協会では、上記の提言を踏まえ、市場参加者が日銀ネットにおけるRTGS 関連の諸規程を前提として国債のRTGS への円滑な移行を実現し、国債決済RTGS 化後の決済環境下における決済リスクの軽減及び決済の円滑性の確保を図るために遵守すべき市場慣行等を「国債の即時グロス決済に関するガイドライン」として取りまとめ、平成12年8 月に公表したところである。また、本協会では、その後も適宜ガイドラインの改正を行っているところである。 平成21年5月には、前年に起こった世界的な金融危機を踏まえ、本協会公社債委員会の下部機関として、「債券のフェイル慣行の見直しに関するワーキング・グループ」を設置し、フェイルの頻発を抑制しつつ、フェイル慣行の更なる定	・総論 1. 目的 近年、金融取引に係る「決済リスク対策」の必要性が国際的な高まりを示すなか、わが国においては日本銀行が、平成13 年 1 月4 日に日本銀行金融ネットワークシステム（以下「日銀ネット」という。）における当座預金決済及び国債決済の即時グロス決済（Real Time Gross Settlement、以下「RTGS」という。）化を実施した。 国債決済のRTGS 化に伴い、市場参加者においては、従来とは全く異なる決済処理手続きへの移行及び決済事務の増加等に適切に対応する必要があると考えられることから、本協会では、証券会社、銀行、信託銀行及び生命保険会社の各業態からのメンバーにより組成される「国債決済RTGS 化に関する研究会」を設置して検討を進め、国債のRTGSに関する市場慣行等について提言を取りまとめ、公表を行った。 さらに本協会では、上記の提言を踏まえ、市場参加者が日銀ネットにおけるRTGS 関連の諸規程を前提として国債のRTGS への円滑な移行を実現し、国債決済RTGS 化後の決済環境下における決済リスクの軽減及び決済の円滑性の確保を図るために遵守すべき市場慣行等を「国債の即時グロス決済に関するガイドライン」として取りまとめ、平成12年8 月に公表したところである。また、本協会では、その後も適宜ガイドラインの改正を行っているところである。 平成21年5月には、前年に起こった世界的な金融危機以降、市場参加者において債券決済におけるフェイル慣行等を改めて見直す必要性が強く認識されたことを踏まえ、フェイルの頻発を抑制しつつ、フェイル慣行の更なる定着を図る

新	旧
着を図る観点から、オフショア円決済など国際的な決済動向を踏まえた、フェイルとして取り扱うDVP決済の範囲の見直しも含む検討を行い、平成22年4月に最終報告書を公表した。これを踏まえ、平成22年6月、本ガイドラインについて改正を行い、同年11月1日から実施した。 平成21年9月には、本協会「証券受渡・決済制度改革懇談会」及び「証券決済制度改革推進会議」の下部機関である「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」を設置し、国債取引の決済リスクの軽減を図る観点から、決済期間の短縮に関する検討を行い、平成22年12月に中間報告書を公表した。平成23年3月には、国債の売買（アウトライト）取引における標準的な決済期間をT+3からT+2に短縮することに伴う、相対ネットリング照合事務の電子化等や異額面のペイメント・ネットリングの取扱いを取りまとめた。これを踏まえ、平成23年6月、本ガイドラインの「<u>二当事者間におけるネットリングに関するガイドライン</u>」について改正を行い、平成24年4月23日から実施した。 本協会では、国債のRTGSに際して、多くの市場参加者が本ガイドラインを参考にされることによって国債取引が一層円滑に行われることを望むものである。 なお、本ガイドラインは、市場参加者の法律上の権利を何ら制限するものではない。	観点から、本協会公社債委員会の下部機関として、市場横断的なメンバーにより組成される「債券のフェイル慣行の見直しに関するワーキング・グループ」を設置した。同ワーキング・グループでは、オフショア円決済など国際的な決済動向を踏まえた、フェイルとして取り扱うDVP決済の範囲の見直しも含め、<u>フェイル慣行の更なる定着に向けた見直しについて検討を行い</u>、平成22年4月に最終報告書を公表した。これを踏まえ、平成22年6月、本ガイドラインについて改正を行った。 本協会では、国債のRTGSに際して、多くの市場参加者が本ガイドラインを参考にされることによって国債取引が一層円滑に行われることを望むものである。 なお、本ガイドラインは、市場参加者の法律上の権利を何ら制限するものではない
2. 実施時期 本ガイドラインの実施日は、<u>平成24年4月23日</u>とする。 ・決済の円滑化に関するガイドライン （ 現行どおり ） ・フェイルに関するガイドライン （ 現行どおり ） ・二当事者間におけるネットリングに関するガイドライン 1. 標準的なネットリング・スキーム 市場参加者は、以下の取扱いを行うに当たり、	2. 実施時期 本ガイドラインの実施日は、<u>平成22年11月1日</u>とする。 ・決済の円滑化に関するガイドライン （ 省 略 ） ・フェイルに関するガイドライン （ 省 略 ） ・二当事者間におけるネットリングに関するガイドライン 1. 標準的なネットリング・スキーム 市場参加者は、以下の取扱いを行うに当たり、

新	旧
書面の有無は問われないものの、当事者間で事前に本取扱いを行う旨の合意が成立している必要があることに留意する^(注4)。 (1) } ・ (現行どおり) (3) } (4) 対象となる取引の約定照合時限 受渡日を基準とし、受渡日前営業日の<u>約定照合時限の目安(午後3時30分から午後3時45分)までに約定照合が完了した</u>^(注5)取引を対象とする。 <u>(注5) ㈱証券保管振替機構が提供する決済照合システムを使用した約定照合の場合、「約定照合が完了した」とは、同システムを通じて売買報告データが承認されたこと又は一致したことをいう。</u> (5) 対象となる取引種別 売買(条件付売買を含む。)取引同士及び現金担保付貸借取引同士、並びにこれらの取引相互間を対象とする^(注6)。 <u>(注6) 条件付売買取引はスタート取引及びエンド取引、現金担保付貸借取引は貸出及び返済を対象とする。</u> (6) (現行どおり) (7) (現行どおり) (8) ペア付けの方法 受渡金額をキーとして、受渡金額の<u>大きいもの</u>から順にペア付けを行う。 なお、同一受渡金額の取引が存在する場合の取扱いは、取引当事者間で確認することで対応する。 (9) (現行どおり) (10) (現行どおり) 2. 標準的なネットティング・スキームに準じたネットティング (1) <u>市場全体としての決済量の圧縮等による事務効率の向上、資金負担の削減の観点から、当事者間の合意がある場合には、上記1.に示す「標準的なネットティング・スキーム」の「バイラテラルのペイメント・ネットティング」を前提としたうえで、上記1.の(2)及び(8)の項目を</u>	書面の有無は問われないものの、当事者間で事前に本取扱いを行う旨の合意が成立している必要があることに留意する^(注4)。 (1) } ・ (省 略) (3) } (4) 対象となる取引の約定時限 受渡日を基準とし、受渡日前営業日の<u>正午までに約定した取引</u>を対象とする。 (新 設) (5) 対象となる取引種別 売買(現先売買を含む。)取引同士及び貸借取引同士、並びにこれらの取引相互間を対象とする。 (新 設) (6) (省 略) (7) (省 略) (8) ペア付けの方法 受渡金額をキーとして、受渡金額の<u>高いもの</u>から順にペア付けを行う。 なお、同一受渡金額の取引が存在する場合の取扱いは、取引当事者間で確認することで対応する。 (9) (省 略) (10) (省 略) 2. 標準的なネットティング・スキームに準じたネットティング (新 設)

新	旧
<u>変更した、同一銘柄・異額面の国債に係る取引のネットティング（以下「異額面のペイメント・ネットティング」という。）を「標準的なネットティング・スキームに準じたネットティング」として行うことができる。</u> <u>ただし、この場合においても、決済の円滑性確保等の観点から上記１．の(3)～(7)、(9)及び(10)の項目は、標準的なネットティング・スキームに基づいて行うこととする。</u> <u>(2) (1)に基づいて、異額面のペイメント・ネットティングを行う場合には、「１対１の異額面のペイメント・ネットティング」又は「集約方式の異額面のペイメント・ネットティング」のいずれの方法を選択するか当事者間で合意したうえで、上記１．の(8)の項目によらず、以下の取扱いを行う。</u> <u>１対１の異額面のペイメント・ネットティング</u> <u>１対１の異額面のペイメント・ネットティングを行う場合のペア付けは、標準的なネットティング・スキームにおけるペアオフの対象とならなかった取引に関し、次の手順により行う。</u> <u>(イ) ペアオフの対象とならなかった取引に関し、額面金額をキーとして、額面金額の大きいものから順にペア付けを行う。</u> <u>(ロ) 額面金額が同一の取引が複数ある場合には、受渡金額の大きいものから順にペア付けを行う。</u> <u>(ハ) 額面金額及び受渡金額が同一の取引が複数ある場合には、約定日付の古いものから順にペア付けを行う。</u> <u>(ニ) 額面金額、受渡金額及び約定日付が同一の取引が存在する場合の取扱いは、当事者間で確認することに対応する。</u> <u>集約方式の異額面のペイメント・ネットティング</u> <u>集約方式の異額面のペイメント・ネットティングとは、標準的なネットティング・スキームにおけるペアオフの対象とならなかった取引に関し、同一銘柄における決済総額を算出し、その</u>	(新 設) (新 設) (新 設)

新	旧
<u>差引額を決済する方式の異額面のペイメント・ネットティングをいう。</u> <u>集約方式の異額面のペイメント・ネットティングは、次の手順により行う。</u> <u>(イ) ペアオフの対象とならなかった取引に関し、銘柄ごとに、国債の渡し方となっている全ての取引の引渡総額と、国債の受け方となっている全ての取引の受取総額を算出する</u> <u>(注7)。</u> <u>(ロ) (イ)の引渡総額と受取総額のいずれか大きい方を構成する全ての取引を次の手順に従って順位付けする。</u> <u>(a) 額面金額をキーとして、額面金額の大きいものから順位付けする。</u> <u>(b) 額面金額が同一の取引が複数ある場合には、受渡金額の大きいものから順位付けする。</u> <u>(c) 額面金額及び受渡金額が同一の取引が複数ある場合には、約定日付の古いものから順位付けする。</u> <u>(d) 額面金額、受渡金額及び約定日付が同一の取引が存在する場合の取扱いは、当事者間で確認することに対応する。</u> <u>(ハ) (ロ)における順位付けの高い取引から、(イ)の引渡総額と受取総額のいずれか小さい方の金額を超えるまで、取引の額面金額を集計する。</u> <u>(ニ) (イ)の引渡総額と受取総額のいずれか小さい方を構成する全ての取引と、(ハ)で額面金額を集計した取引を対象に異額面のペイメント・ネットティングを行う。</u> <u>(ホ) (ニ)において、異額面のペイメント・ネットティングの対象外とされた取引は、グロス決済とする。</u> <u>(注7) 引渡総額及び受取総額は、額面金額で算出する。</u> <u>(3) 市場全体としての決済量圧縮の観点から、各市場参加者のネットティング導入を一層容易にするため、上記1.に示す「標準的なネットティング・スキーム」の「バイラテラルのペイメント・ネットティング」における「ペアオフ」を前提と</u>	(1) 市場全体としての決済量圧縮の観点から、各市場参加者のネットティング導入を一層容易にするため、上記に示す「標準的なネットティング・スキーム」の「バイラテラルのペイメント・ネットティング」における「ペアオフ」を前提とし

新	旧
したうえで、上記 1 . の(3)～(5)の項目を当事者間の合意によって変更したネットィングを「標準的なネットィング・スキームに準じたネットィング」として行うことも可能とする^(注8)。 ただし、この場合においても、決済の円滑性確保等の観点から上記 1 . の(6)～(10)の項目は、標準的なネットィング・スキームに基づいて行うこととする。 (注8) 例えば、FOP 決済のペアオフ、無担保の債券貸借取引同士のペアオフ等がある。 (4) (現行どおり)	たうえで、上記 1 . の(3)～(6)の項目を当事者間の合意によって変更したネットィング(以下「標準的なネットィング・スキームに準じたネットィング」という。)を行うことも可能とする^(注5)。 ただし、この場合においても、決済の円滑性確保等の観点から上記 1 . の(7)～(10)の項目は、標準的なネットィング・スキームに基づいて行うこととする。 (注5) 例えば、FOP 決済のペアオフ、無担保の債券貸借取引同士のペアオフ等がある。 (2) (省 略)
3 . 事務手続き	3 . 事務手続き
(1) ペア付け及び順位付けの指図 当事者間の合意に基づき、その都度連絡は行わず、<u>ペアオフや異額面のペイメント・ネットィングのペア付け及び順位付け</u>をすることとする。 (2) ネットィングの照合通知 受渡日前営業日の<u>午後 4 時</u>までに両当事者で合意したネットィング対象取引を照合通知に記載し、相互に同通知を送付する。<u>照合通知については、「相対ネットィング照合等の実務に関する取扱指針」で定める様式を利用するものとする。</u> (3) ネットィングの照合時限 受渡日前営業日の午後 <u>5 時</u>までに照合を完了する。 (4) 照合通知の送付方法 <u>当事者間の合意に基づく方法</u>を利用する^(注9)。 (注9) 具体的な送付方法の例については、「<u>相対ネットィング照合等の実務に関する取扱指針</u>」を参照。 (5) (現行どおり) (6) 異議の通知 内容に異議等がある場合は、受渡日前営業日の午後 <u>5 時</u>までに最終的に正しい照合通知を送付することにより、照合を完了させることとする。 (7) (現行どおり)	(1) ペア付けの指図 当事者間の合意に基づき、その都度連絡は行わず、ペア付けすることとする。 (2) ネットィングの照合通知 受渡日前営業日の<u>正午</u>までに両当事者で合意したネットィング対象取引を照合通知書(参考様式 1 参照)に記載し、相互に同通知書を送付する。 (3) ネットィングの照合時限 受渡日前営業日の午後 <u>3 時</u>までに照合を完了する。 (4) 照合通知の送付方法 <u>FAX 等</u>を利用する。 (新 設) (5) (省 略) (6) 異議の通知 内容に異議等がある場合は、受渡日前営業日の午後 <u>3 時</u>までに最終的に正しい照合通知書を送付することにより、照合を完了させることとする。 (7) (省 略)

新	旧
4 事前確認書及び事前通知書の参考様式並びに照合通知との関係 市場参加者は、任意に事前確認書（参考様式 1 参照）及び事前通知書（参考様式 2 参照）を取り交わすこととするが、これらの書面を取り交わすことにより、容易に「標準的なネットティング・スキーム」及び「標準的なネットティング・スキームに準じたネットティング」を行う際の合意内容、資金決済口座及び担当者名等を確認できる。 事前に当事者間の合意により事前確認書及び事前通知書を取り交わす場合は、次の点に留意して対応する必要がある。 (1) (現行どおり) (2) 事前確認書及び事前通知書並びに照合通知書上に「日本証券業協会の『国債の即時グロス決済に関するガイドライン』の『<u>二当事者間におけるネットティングに関するガイドライン</u>』に基づいたネットティング」と明記していることから、これらの書面のいずれを用いても「標準的なネットティング・スキーム」及び「標準的なネットティング・スキームに準じたネットティング」の合意を容易に確認することができる。 なお、<u>照合通知を電子的に送付する場合には、日本証券業協会の『国債の即時グロス決済に関するガイドライン』の『二当事者間におけるネットティングに関するガイドライン』に基づいたネットティングである旨を当該照合通知上に記載することが実務上困難であることも考えられるため、事前に事前確認書及び事前通知書を取り交わすことにより、照合通知の送付方法や同旨の確認を行うことが適当と考えられる。</u>また、照合通知に押印することは実務上困難であり、記名押印によって合意形成の確認を望む市場参加者にとっては、事前確認書及び事前通知書により確認を行うことが適当と考えられる。 (3) 事前確認書及び事前通知書を取り交わした場合、同書で確認したネットティングの内容と照合通知に記載される取引の内容に齟齬が生じることも想定される。その場合の事前確認書と照合通知の関係については、まず当事者間で直	4 事前確認書及び事前通知書の参考様式並びに照合通知書との関係 市場参加者は、任意に事前確認書（参考様式 2 参照）及び事前通知書（参考様式 3 参照）を取り交わすこととするが、これらの書面を取り交わすことにより、容易に「標準的なネットティング・スキーム」及び「標準的なネットティング・スキームに準じたネットティング」を行う際の合意内容、資金決済口座及び担当者名等を確認できる。 事前に当事者間の合意により事前確認書及び事前通知書を取り交わす場合は、次の点に留意して対応する必要がある。 (1) (省 略) (2) 事前確認書及び事前通知書並びに照合通知書上に「日本証券業協会の『国債の即時グロス決済に関するガイドライン』の『<u>ネットティングに関するガイドライン</u>』に基づいたネットティング」と明記していることから、これらの書面のいずれを用いても「標準的なネットティング・スキーム」及び「標準的なネットティング・スキームに準じたネットティング」の合意を容易に確認することができる。 なお、照合通知書に押印することは実務上困難であり、記名押印によって合意形成の確認を望む市場参加者にとっては、事前確認書及び事前通知書により確認を行うことが適当と考えられる。 (3) 事前確認書及び事前通知書を取り交わした場合、同書で確認したネットティングの内容と照合通知書に記載される取引の内容に齟齬が生じることも想定される。その場合の事前確認書と照合通知書の関係については、まず当事者間

新	旧
前に確認した結果である照合通知の内容が優先するが、当事者間で照合通知に記載された内容に合意できない場合は、事前確認書の内容にしたがって処理することとする。 5.「バイラテラルのペイメント・ネットティング」以外のネットティングについて 市場参加者間において、「標準的なネットティング・スキーム」によるネットティング及び「標準的なネットティング・スキームに準じたネットティング」によらず、決済量の圧縮等による事務効率の向上、資金負担の削減が期待できる「バイラテラルのペイメント・ネットティング」以外のネットティング(注10)を行う旨を合意することも考えられるが、こうしたネットティングの取扱いを行うに当たっては、次の点に留意して対応する必要がある。 (注10) 例えば、オブリゲーション・ネットティング(当事者間において履行期を同じくする複数の債権と債務が発生する場合に、新たな債権が発生する都度、履行期の到来を待つことなく債権と債務の差引きを行い、その履行期に履行すべき債権を一本化して決済する方式)がある。 (1) (現行どおり) (2) (現行どおり) (3) 「バイラテラルのペイメント・ネットティング」以外のネットティングを行うに当たっては、取り決めたネットティング・スキームの法的有効性を当事者間で正確に認識して行う必要がある。	で直前に確認した結果である照合通知書の内容が優先するが、当事者間で照合通知書に記載された内容に合意できない場合は、事前確認書の内容にしたがって処理することとする。 5.「バイラテラルのペイメント・ネットティングにおけるペアオフ」以外のネットティングについて 市場参加者間において、「標準的なネットティング・スキーム」及び「標準的なネットティングに準じたネットティング」によらず、決済量の圧縮等による事務効率の向上、資金負担の削減が期待できる「バイラテラルのペイメント・ネットティングにおけるペアオフ」以外のネットティング(注6)を行う旨を合意することも考えられるが、こうしたネットティングの取扱いを行うに当たっては、次の点に留意して対応する必要がある。 (注6) 例えば、集約方式(各当事者が同一銘柄における決済総額を算出し、その差引額を決済する方式)によるペイメント・ネットティング、同一銘柄で額面の異なる国債を差引額で決済する方式によるペイメント・ネットティング及びオブリゲーション・ネットティング(当事者間において履行期を同じくする複数の債権と債務が発生する場合に、新たな債権が発生する都度、履行期の到来を待つことなく債権と債務の差引きを行い、その履行期に履行すべき債権を一本化して決済する方式)がある。 (1) (省 略) (2) (省 略) (3) 「バイラテラルのペイメント・ネットティング」以外のネットティングを行うに当たっては、取り決めたネットティング・スキームの法的有効性を当事者間で正確に認識して行う必要がある。なお、額面の異なる国債を差引額で決済する等の、同一銘柄におけるペアオフ以外の「バイラテラルのペイメント・ネットティング」に係る法的有効性については、「標準的なネットティング・スキーム」と同様である。

新

(削 除)

(参考様式 1)

YYYY 年 MM 月 DD 日

XXXXXXXXXX 御中

会社名XXXX

部署名XXXX

責任者名XXXX印

連絡先XXXX

国債のネットティングに係る事前確認書

日本証券業協会の「国債の即時グロス決済に関するガイドライン」の「 、二当事者間におけるネットティングに関するガイドライン」に基づき、貴社と当社の間で行う国債決済のネットティングについて、下記の事項を確認するために本確認書を御送付致します。

1．ネットティングの概要

ネットティ ングの方法	ガイドラインの <u> </u> 、1．で定める標準的なネットティング・スキーム及び事務手続きにより行うネットティング		
	ガイドラインの <u> </u> 、2．(1) 及び (2) で定める標準的なネットティング・スキームに準じた異額面のペイメント・ネットティング	1 対 1 の異額面のペイメント・ネットティング	
		集約方式の異額面のペイメント・ネットティング	
	ガイドラインの <u> </u> 、2．(3) で定める標準的なネットティング・スキームに準じたネットティング		

2．ガイドラインの 、2．(3) で定めるネットティングにおける確認事項（ガイドラインの 、2．(3) で定めるネットティングを行わない場合には記載不要）

(削除)	(削除)	
対象となる 決済方法	DVP 取引同士の決済のみ	
	FOP 取引同士の決済のみ	
	DVP 取引同士間、FOP 取引同士間及び DVP 取引、FOP 取引の相互間の決済	
対象となる 取引種別	売買（含条件付売買）取引同士、現金担保付貸借取引同士、及び売買（含条件付売買現先）取引・現金担保付貸借取引の相互間	
	売買（含条件付売買）取引同士間のみ	
	現金担保付貸借取引同士間のみ	
	その他（例、無担保貸借取引同士間）	
(削除)	(削除)	
対象となる 取引の約定 照合時限	受渡日前営業日の約定照合時限の目安（午後 3 時 30 分から午後 3 時 45 分）までに約定照合が完了した取引	
	受渡日○○○（○時）までの約定照合完了分	
	当該約定照合時限の変更に伴い合意した時限を併記	
	ネットティングの通知・取消時限	受渡日○○○（○時）まで
	ネットティングの照合時限	受渡日○○○（○時）まで
	異議等の連絡時限	受渡日○○○（○時）まで

3．対象となる口座等

別途、当社から指定した場合を除き、当社口座のすべてを上記確認事項に基づきネットティングする	
以下にあげる口座等	

4．照合通知の送付方法

5．その他補足・追記事項（ネットティング照合通知データに関する依頼事項等）

旧

(参考様式 1)

(参考様式 2)

YYYY 年 MM 月 DD 日

XXXXXXXXXX 御中

会社名XXXX

部署名XXXX

責任者名XXXX印

連絡先XXXX

国債のネットティングに係る事前確認書

日本証券業協会の「国債の即時グロス決済に関するガイドライン」の「 、二当事者間におけるネットティングに関するガイドライン」に基づき、貴社と当社の間で行う国債決済のネットティングについて、下記の事項を確認するために本確認書を御送付致します。

1．ネットティングの概要

ネットティ ングの方法		ガイドラインにおける標準的なネットティング・スキーム及び事務手続きにより行うネットティング
		標準的なネットティング・スキームに準ずるネットティング

2．標準的なネットティング・スキームに準ずるネットティングにおける確認事項

対象となる 決済数量		標準的なネットティング・スキームに基づくペア・オフ
		ペア・オフ以外を含む（※詳細はその他補足・追記事項を参照）
対象となる 決済方法		標準的なネットティング・スキームに基づく DVP 取引同士の決済のみ
		FOP 取引同士の決済のみ
		DVP、FOP 取引同士間及び DVP、FOP 取引の相互間の決済
対象となる 取引種別		標準的なネットティング・スキームに基づく売買（含現先）取引同士、(現金担保付) 貸借取引同士、及び売買（含現先）取引・(現金担保付) 貸借取引の相互間
		売買（含現先）取引同士間のみ
		(現金担保付) 貸借取引同士間のみ
		その他（例、無担保貸借取引同士間）
対象となる 保有形態		標準的なネットティング・スキームに基づく振替国債同士間のみ
		登録国債同士間のみ
		振替国債、登録国債同士間および振替国債、登録国債の相互間
対象となる 取引の約定 時限		標準的なネットティング・スキームに基づく受渡日前営業日正午までの約定分
		受渡日○○○（○時）までの約定分
	当該約定時限の変更に伴い合意した時限を併記	
	ネットティングの通知・解消時限	受渡日○○○（○時）まで
	ネットティングの照合時限	受渡日○○○（○時）まで
	異議等の連絡時限	受渡日○○○（○時）まで

3．対象となる口座等

別途、当社から指定した場合を除き、当社口座のすべてを上記確認事項に基づきネットティングする	
以下にあげる口座等	

その他補足・追記事項

9

新	旧																																																														
(参考様式2) YYYY年MM月DD日 XXXXXXXX 御中 <table><tr><td>会社名</td><td>XXXX</td></tr><tr><td>部署名</td><td>XXXX</td></tr><tr><td>責任者名</td><td>XXXX</td><td>印</td></tr><tr><td>連絡先</td><td>XXXX</td></tr></table> 国債のネットtingに係る事前通知書兼変更連絡書 日本証券業協会の「国債の即時グロス決済に関するガイドライン」の「 二当事者間におけるネットtingに関するガイドライン」に基づき、貴社と当社の間で行う国債決済のネットtingについて、下記の事項（新規・変更）を事前に御連絡致します。 （変更連絡書として使用する場合は、変更を行う項目の番号に○印を付ける。） 記 1. 資金決済口座 <table><tr><td colspan="2">日銀資金決済口座</td></tr><tr><td>1</td><td>金融機関名（漢字）</td></tr><tr><td>2</td><td>口座名称</td></tr><tr><td>3</td><td>口座番号</td></tr></table> 対象口座により決済口座が異なる場合には、対象となる口座を別途、補足事項欄に記載する。 2. 責任者・担当者および連絡先 <table><tr><td>1</td><td>担当部署名</td></tr><tr><td>2</td><td>責任者</td></tr><tr><td>3</td><td>担当者</td></tr><tr><td>4</td><td>TEL（1）</td></tr><tr><td>5</td><td>FAX（1）</td></tr><tr><td>6</td><td>TEL（2）</td></tr><tr><td>7</td><td>FAX（2）</td></tr></table> 3. 補足事項欄 適宜、利用 <記入例> 日銀当座を原則とし、市中銀行口座は補足事項欄に表記する。<u>Web サービス利用等電子データ授受の時は必要事項等を補足事項欄に記載する。</u>	会社名	XXXX	部署名	XXXX	責任者名	XXXX	印	連絡先	XXXX	日銀資金決済口座		1	金融機関名（漢字）	2	口座名称	3	口座番号	1	担当部署名	2	責任者	3	担当者	4	TEL（1）	5	FAX（1）	6	TEL（2）	7	FAX（2）	(参考様式3) YYYY年MM月DD日 XXXXXXXX 御中 <table><tr><td>会社名</td><td>XXXX</td></tr><tr><td>部署名</td><td>XXXX</td></tr><tr><td>責任者名</td><td>XXXX</td><td>印</td></tr><tr><td>連絡先</td><td>XXXX</td></tr></table> 国債のネットtingに係る事前通知書兼変更連絡書 日本証券業協会の「国債の即時グロス決済に関するガイドライン」の「 二当事者間におけるネットtingに関するガイドライン」に基づき、貴社と当社の間で行う国債決済のネットtingについて、下記の事項（新規・変更）を事前に御連絡致します。 （変更連絡書として使用する場合は、変更を行う項目の番号に○印を付ける。） 記 1. 資金決済口座 <table><tr><td colspan="2">日銀資金決済口座</td></tr><tr><td>1</td><td>金融機関名（漢字）</td></tr><tr><td>2</td><td>口座名称</td></tr><tr><td>3</td><td>口座番号</td></tr></table> 対象口座により決済口座が異なる場合には、対象となる口座を別途、補足事項欄に記載する。 2. 責任者・担当者および連絡先 <table><tr><td>1</td><td>担当部署名</td></tr><tr><td>2</td><td>責任者</td></tr><tr><td>3</td><td>担当者</td></tr><tr><td>4</td><td>TEL（1）</td></tr><tr><td>5</td><td>FAX（1）</td></tr><tr><td>6</td><td>TEL（2）</td></tr><tr><td>7</td><td>FAX（2）</td></tr></table> 3. 補足事項欄 適宜、利用 <記入例> 日銀当座を原則とし、市中銀行口座は補足事項欄に表記する。	会社名	XXXX	部署名	XXXX	責任者名	XXXX	印	連絡先	XXXX	日銀資金決済口座		1	金融機関名（漢字）	2	口座名称	3	口座番号	1	担当部署名	2	責任者	3	担当者	4	TEL（1）	5	FAX（1）	6	TEL（2）	7	FAX（2）
会社名	XXXX																																																														
部署名	XXXX																																																														
責任者名	XXXX	印																																																													
連絡先	XXXX																																																														
日銀資金決済口座																																																															
1	金融機関名（漢字）																																																														
2	口座名称																																																														
3	口座番号																																																														
1	担当部署名																																																														
2	責任者																																																														
3	担当者																																																														
4	TEL（1）																																																														
5	FAX（1）																																																														
6	TEL（2）																																																														
7	FAX（2）																																																														
会社名	XXXX																																																														
部署名	XXXX																																																														
責任者名	XXXX	印																																																													
連絡先	XXXX																																																														
日銀資金決済口座																																																															
1	金融機関名（漢字）																																																														
2	口座名称																																																														
3	口座番号																																																														
1	担当部署名																																																														
2	責任者																																																														
3	担当者																																																														
4	TEL（1）																																																														
5	FAX（1）																																																														
6	TEL（2）																																																														
7	FAX（2）																																																														

以 上