

「金融市場インフラのための原則」に基づく 清算機関の定量的情報開示について

2023年12月31日現在

株式会社ほふりクリアリング

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|-----|---|-------|-----------------------------------|------|---------|--|------------|
| 4.1 | 参加者破綻財源(当初証拠金及び変動証拠金を除く)の総額の内訳。清算業務毎にデフォルトファンドを分別管理している場合は清算業務毎の内訳。 | 4.1.1 | 事前拠出分-自身の資本(参加者拠出に先立つ部分) 四半期末 | 四半期毎 | 該当なし | <p>当社は、確保資産(受入予定証券評価額、担保指定証券評価額及び参加者基金預託額の合計※)の範囲内で債務引受けを行うことから、確保資産以外で、デフォルトファンドや自己資本による補填といった事前拠出型の資源及び自己や親会社のファンドによる補填といった事後コミット型の資源を保有する必要はない。</p> <p>※受入予定証券…DVP振替に係る受渡対象証券を当該証券の受方DVP参加者に引き渡す前に当社の口座に留め置く証券。 担保指定証券…DVP参加者から当社に差し入れられた証券。対象は機構取扱有価証券及び国債証券。 参加者基金…すべてのDVP参加者に対して予め一定の基準によって計算された金額の預託を求める現金。なお、求める金額以上を任意で預託することも可能。</p> | - |
| 4.1 | 同上 | 4.1.2 | 事前拠出分-自身の資本(参加者拠出と同時) 四半期末 | 四半期毎 | 該当なし | 4.1.1に同じ | - |
| 4.1 | 同上 | 4.1.3 | 事前拠出分-自身の資本(参加者拠出の後) 四半期末 | 四半期毎 | 該当なし | 4.1.1に同じ | - |
| 4.1 | 同上 | 4.1.4 | 事前拠出分-参加者拠出分の総額(所要額) 四半期末 | 四半期毎 | 該当なし | 4.1.1に同じ | - |
| 4.1 | 同上 | 4.1.5 | 事前拠出分-参加者拠出分の総額(ヘアカット後の額) 四半期末 | 四半期毎 | 該当なし | 4.1.1に同じ | - |
| 4.1 | 同上 | 4.1.6 | 事前拠出分-その他 四半期末 | 四半期毎 | 該当なし | 4.1.1に同じ | - |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|-----|---|--------|--|------|---------|--|------------|
| 4.1 | 同上 | 4.1.7 | コミット額-清算機関自身又はその親会社の資金で参加者破綻(又は複数参加者破綻)へ対応するためにコミットされているもの 四半期末 | 四半期毎 | 該当なし | 4.4.1に同じ | - |
| 4.1 | 同上 | 4.1.8 | コミット額-参加者破綻(又は複数参加者破綻の初回ラウンド)へ対応するための参加者のコミット額の総額 四半期末 | 四半期毎 | 該当なし | 一定の金額を設定しているわけではないが、参加者の確保資産を売却してもなお支払債務が残る場合には、損失負担金・追加損失負担金により参加者から資金を調達し、財務資源の補填を行う。 | 原則4.7 |
| 4.1 | 同上 | 4.1.9 | コミット額-初回の参加者破綻(又は複数参加者破綻)以降の参加者破綻(又は複数参加者破綻)へ対応するための参加者の補充コミット額の総額 四半期末 | 四半期毎 | 該当なし | 4.1.8に同じ | - |
| 4.1 | 同上 | 4.1.10 | コミット額-その他 四半期末 | 四半期毎 | 該当なし | 4.1.8に同じ | - |
| 4.2 | 仮想所要自己資本額 | 4.2.1 | 仮想所要自己資本額は関連法の下で「適格清算機関」となることを追求するCCPのみが報告することが必要である。 | 四半期毎 | 対象外 | 当社の場合、デフォルトファンドを保有しておらず、また、決済日当日のみの債務引受けで未決済残高は発生しないことから、トレード・エクスポージャーはゼロとなる。このため、銀行等は当社向けエクスポージャーの信用リスク・アセットの額を算出する必要はない。 | - |
| 4.3 | 清算業務毎の事前拋出分の破綻財源(当初証拠金及び変動証拠金を除く)の価額の総額及び内訳 | 4.3.1 | 関連する通貨の発行主体である中央銀行の現預金 四半期末;ヘアカット前とヘアカット後 | 四半期毎 | 該当なし | 4.1.1に同じ | - |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|-----|------|-------|--|------|---------|----------|------------|
| 4.3 | 同上 | 4.3.2 | その他中央銀行の現金預金 四半期末;ヘアカット前とヘアカット後 | 四半期毎 | 該当なし | 4.1.1に同じ | - |
| 4.3 | 同上 | 4.3.3 | 商業銀行における保全された現金預金 (リバースレポを含む) 四半期末;ヘアカット前とヘアカット後 | 四半期毎 | 該当なし | 4.1.1に同じ | - |
| 4.3 | 同上 | 4.3.4 | 商業銀行における未保全の現金預金 四半期末;ヘアカット前とヘアカット後 | 四半期毎 | 該当なし | 4.1.1に同じ | - |
| 4.3 | 同上 | 4.3.5 | 現金以外のソブリン債(自国債) 四半期末;ヘアカット前とヘアカット後 | 四半期毎 | 該当なし | 4.1.1に同じ | - |
| 4.3 | 同上 | 4.3.6 | 現金以外のソブリン債(その他) 四半期末;ヘアカット前とヘアカット後 | 四半期毎 | 該当なし | 4.1.1に同じ | - |
| 4.3 | 同上 | 4.3.7 | 現金以外の政府機関債 四半期末;ヘアカット前とヘアカット後 | 四半期毎 | 該当なし | 4.1.1に同じ | - |
| 4.3 | 同上 | 4.3.8 | 現金以外の地方債 四半期末;ヘアカット前とヘアカット後 | 四半期毎 | 該当なし | 4.1.1に同じ | - |
| 4.3 | 同上 | 4.3.9 | 現金以外の社債 | 四半期毎 | 該当なし | 4.1.1に同じ | - |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|-----|----------|--------|---|------|--------------|---|------------|
| 4.3 | 同上 | 4.3.10 | 現金以外の株式 四半期末;ヘアカット前とヘアカット後 | 四半期毎 | 該当なし | 4.1.1に同じ | - |
| 4.3 | 同上 | 4.3.11 | 現金以外のコモディティ-金 四半期末;ヘアカット前とヘアカット後 | 四半期毎 | 該当なし | 4.1.1に同じ | - |
| 4.3 | 同上 | 4.3.12 | 現金以外のコモディティ-その他 四半期末;ヘアカット前とヘアカット後 | 四半期毎 | 該当なし | 4.1.1に同じ | - |
| 4.3 | 同上 | 4.3.13 | 現金以外のコモディティ-投資信託 /UCIT 四半期末;ヘアカット前とヘアカット後 | 四半期毎 | 該当なし | 4.1.1に同じ | - |
| 4.3 | 同上 | 4.3.14 | 現金以外-その他 四半期末;ヘアカット前とヘアカット後 | 四半期毎 | 該当なし | 4.1.1に同じ | - |
| 4.3 | 同上 | 4.3.15 | 合計 四半期末;ヘアカット前とヘアカット後 | 四半期毎 | 該当なし | 4.1.1に同じ | - |
| 4.4 | 信用リスクの開示 | 4.4.1 | 事前拠出分の破綻財源の総額に関する 「Cover 1」又は「Cover 2」のいずれが最低限の要件の対象になるか | 四半期毎 | Cover1に該当する。 | 当社は、複雑なリスク特性を伴う清算業務に従事するCCP及び複数の法域においてシステム的に重要なCCPに該当しないため、Cover1に該当する。 なお、当社は、確保資産の範囲内で債務引受けを行うスキームであるため、参加者の差引支払額は確保資産以下である。 | 原則4.4 |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|-----|------|-------|---|------|------------------|--|------------|
| 4.4 | 同上 | 4.4.2 | 各清算業務において、デフォルトファンドによってカバーすることが必要な潜在的な信用エクスポージャー額を算出する際にCCPが想定するクローズアウト期間(日数) | 四半期毎 | 2営業日 | 当社は、デフォルトファンドは保有していないが、確保資産の流動化に必要な期間は左記のとおりである。 | - |
| 4.4 | 同上 | 4.4.3 | 各清算業務につき、極端であるが現実により起こり得る市場環境において単独の清算参加者とその関係法人の破綻によって生じる信用エクスポージャーの(当初証拠金を超える)推定最大総額(間接参加者・顧客のために清算される取引分も含む)。過去12ヶ月における最大額と平均額 | 四半期毎 | 最大額 0円 平均額 0円 | 日次で実施しているストレステスト(制度開始(2004年)以降の2営業日間の価格変動及び1987年ブラックマンデー時の2営業日間の価格変動のうち最大のものを適用)の結果において、参加者(1先+関係法人)の差引支払額が当該参加者の確保資産(受入予定証券評価額、担保指定証券評価額及び参加者基金預託額の合計額)を上回る事象はなかった。 | 原則4.5 |
| 4.4 | 同上 | 4.4.4 | 4.4.3の金額が事前拠出分の破綻財源総額を実際に超えた(当初証拠金を超えた)日があれば、その営業日数 | 四半期毎 | 該当なし | 4.4.3に同じ | - |
| 4.4 | 同上 | 4.4.5 | 4.4.3の金額が事前拠出分の破綻財源総額を実際に超えた(当初証拠金を超えた)日があれば、その超過額 | 四半期毎 | 該当なし | 4.4.3に同じ | - |
| 4.4 | 同上 | 4.4.6 | 各清算業務につき、単独の清算参加者とその関係法人の破綻によって生じる信用エクスポージャーの(当初証拠金を超える)実際の最大総額(間接参加者・顧客のために清算される取引分も含む)。過去12ヶ月における最大額と平均額 | 四半期毎 | 最大額 0円 平均額 0円 | 日次で実施しているバックテストの結果において、参加者(1先+関係法人)の差引支払額が当該参加者の確保資産(受入予定証券評価額、担保指定証券評価額及び参加者基金預託額の合計額)を上回る事象はなかった。 | - |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|-----|------|--------|--|------|------------------|--|------------|
| 4.4 | 同上 | 4.4.7 | 各清算業務につき、極端であるが現実 に起こり得る市場環境において最大2先 の清算参加者とその関係法人の破綻に よって生じる信用エクスポージャーの (当初証拠金を超える)推定最大総額 (間接参加者・顧客のために清算される 取引分も含む) 過去12ヶ月における最大額と平均額 | 四半期毎 | 最大額 0円 平均額 0円 | 日次で実施しているストレステスト(制度開始(2004年)以降 の2営業日間の価格変動及び1987年ブラックマンデー時の2 営業日間の価格変動のうち最大のものを適用)の結果にお いて、参加者(2先+関係法人)の差引支払額が当該参加者 の確保資産(受入予定証券評価額、担保指定証券評価額及 び参加者基金預託額の合計額)を上回る事象はなかった。 | 原則4.5 |
| 4.4 | 同上 | 4.4.8 | 4.4.7の金額が事前拋出分の破綻財源 総額を実際に超えた(当初証拠金を超 えた)日があれば、その営業日数 | 四半期毎 | 該当なし | 4.4.7に同じ | - |
| 4.4 | 同上 | 4.4.9 | 4.4.7の金額が事前拋出分の破綻財源 総額を実際に超えた(当初証拠金を超 えた)日があれば、その超過額 | 四半期毎 | 該当なし | 4.4.7に同じ | - |
| 4.4 | 同上 | 4.4.10 | 各清算業務につき、最大2先の清算参 加者とその関係法人の破綻によって生 じる信用エクスポージャーの(当初証拠 金を超える)実際の最大総額(間接参加 者・顧客のために清算される取引分も 含む) 過去12か月における最大額と平均額 | 四半期毎 | 最大額 0円 平均額 0円 | 日次で実施しているバックテストの結果において、参加者(1 先+関係法人)の差引支払額が当該参加者の確保資産(受 入予定証券評価額、担保指定証券評価額及び参加者基金 預託額の合計額)を上回る事象はなかった。 | - |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|-----|--|-------|--|------|--|--|------------|
| 5.1 | 当初証拠金として預託可能資産及びそれぞれの担保資産に適用されるヘアカット | 5.1.1 | 当初証拠金として預託可能資産及びそれぞれの担保資産に適用されるヘアカット | 随時 | 該当なし | 当社は、差引支払額が確保資産評価額の範囲内である場合に限り債務引受けを行うことにより、信用エクスポージャーをカバーしているため、当初証拠金制度を採用していない。 | 原則5.2 |
| 5.2 | 破綻財源に対する参加者事前抛出に利用可能な担保資産及びそれぞれの担保資産に適用されるヘアカット(5.1と異なる場合) | 5.2.1 | 破綻財源に対する参加者事前抛出に利用可能な担保資産及びそれぞれの担保資産に適用されるヘアカット(5.1と異なる場合) | 随時 | 当社は確保資産として、現金、機構取扱有価証券及び国債の預託を認めており、機構取扱有価証券及び国債については以下の掛目を設定している。 https://www.jasdec.com/rule/dvp/w/hole/ (業務方法書の取扱い別表第3項及び第5項) | | 原則5.1 |
| 5.3 | ヘアカットに係るテスト結果 | 5.3.1 | ヘアカットの算出において目標とする信頼水準 | 四半期毎 | 信頼区間は設けていない。 | 掛目については日次で行うバックテストによりその安全性を検証し、テスト結果は四半期毎に取締役会へ報告しており、その中で仮に掛目でカバーできない下落率が発生した場合には報告することとしている。 | 原則5.2 |
| 5.3 | 同上 | 5.3.2 | 受入担保の想定流動化期間 | 四半期毎 | 2営業日 | | 原則5.2 |
| 5.3 | 同上 | 5.3.3 | ヘアカットに係る(バック)テストの際に用いる参照期間 | 四半期毎 | 2営業日 | 2営業日間の価格変動についてバックテストによりその安全性を検証している。 | 原則5.3 |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|-----|---|-------|---|------|-------------------------------------|----------|------------|
| 5.3 | 同上 | 5.3.4 | 当該参照期間において、想定流動化期間内における担保資産の価値減少分が当該担保資産のヘアカットを上回った日数 | 四半期毎 | 参照期間において確保資産の売却額が評価額を下回る事象は発生しなかった。 | | - |
| 6.1 | 清算業務毎の当初証拠金の総所要額の自己・委託別の内訳(分別管理されていない場合は合計金額) | 6.1.1 | 当初証拠金の総所要額の自己・委託(グロス)・委託(ネット)(分別管理されていない場合は合計金額) | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1に同じ | 原則6 |
| 6.2 | 自己・委託別の清算業務毎の当初証拠金の預託総額 | 6.2.1 | 関連する通貨の発行主体である中央銀行の現金預金 自己及び委託 ヘアカット前及び後 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1に同じ | - |
| 6.2 | 同上 | 6.2.2 | その他中央銀行の現金預金 自己及び委託 ヘアカット前及び後 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1に同じ | - |
| 6.2 | 同上 | 6.2.3 | 商業銀行における保全された現金預金(リバースレポを含む) 自己及び委託 ヘアカット前及び後 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1に同じ | - |
| 6.2 | 同上 | 6.2.4 | 商業銀行における未保全の現金預金 自己及び委託 ヘアカット前及び後 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1に同じ | - |
| 6.2 | 同上 | 6.2.5 | 現金以外のソブリン債(自国債) 自己及び委託 ヘアカット前及び後 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1に同じ | - |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|-----|------|--------|--|------|---------|-----------|------------|
| 6.2 | 同上 | 6.2.6 | 現金以外のソブリン債(その他の国) 自己及び委託 ヘアカット前及び後 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1 に同じ | - |
| 6.2 | 同上 | 6.2.7 | 現金以外の政府機関債 自己及び委託 ヘアカット前及び後 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1 に同じ | - |
| 6.2 | 同上 | 6.2.8 | 現金以外の地方債 自己及び委託 ヘアカット前及び後 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1 に同じ | - |
| 6.2 | 同上 | 6.2.9 | 現金以外の社債 自己及び委託 ヘアカット前及び後 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1 に同じ | - |
| 6.2 | 同上 | 6.2.10 | 現金以外の株式 自己及び委託 ヘアカット前及び後 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1 に同じ | - |
| 6.2 | 同上 | 6.2.11 | 現金以外のコモディティ(金) 自己及び委託 ヘアカット前及び後 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1 に同じ | - |
| 6.2 | 同上 | 6.2.12 | 現金以外のコモディティ(その他) 自己及び委託 ヘアカット前及び後 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1 に同じ | - |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|-----|--|--------|--|------|---------|-----------|------------|
| 6.2 | 同上 | 6.2.13 | 現金以外の投資信託/UCIT 自己及び委託 ヘアカット前及び後 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1 に同じ | - |
| 6.2 | 同上 | 6.2.14 | 現金以外のその他 自己及び委託 ヘアカット前及び後 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1 に同じ | - |
| 6.2 | 同上 | 6.2.15 | 関連する通貨の発行主体である中央銀行の現金預金の総額(分別されていない場合)自己及び委託、ヘアカット前及び後 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1 に同じ | - |
| 6.3 | (CCPがそのような率を設定している場合)CCPが設定する各契約の当初証拠金率 | 6.3.1 | (CCPがそのような率を設定している場合)CCPが設定する各契約の当初証拠金率 | 随時 | 該当なし | 5.1.1 に同じ | - |
| 6.4 | 各清算業務に適用される当初証拠金算出モデル(例えば、ポートフォリオシミュレーション、リスク合算モデル)及びモデル上の主要なパラメータ | 6.4.1 | 当初証拠金算出モデル | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1 に同じ | - |
| 6.4 | 同上 | 6.4.2 | 当初証拠金算出モデルの変更日 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1 に同じ | - |
| 6.4 | 同上 | 6.4.3 | 当初証拠金算出モデルの名前 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1 に同じ | - |
| 6.4 | 同上 | 6.4.4 | 当初証拠金算出モデルの名前の変更日 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1 に同じ | - |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|-----|------|--------|-----------------|------|---------|----------|------------|
| 6.4 | 同上 | 6.4.5 | 片側信頼水準 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1に同じ | - |
| 6.4 | 同上 | 6.4.6 | 片側信頼水準の変更日 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1に同じ | - |
| 6.4 | 同上 | 6.4.7 | 参照期間 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1に同じ | - |
| 6.4 | 同上 | 6.4.8 | 参照期間の変更日 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1に同じ | - |
| 6.4 | 同上 | 6.4.9 | 調整計数 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1に同じ | - |
| 6.4 | 同上 | 6.4.10 | 調整計数の変更日 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1に同じ | - |
| 6.4 | 同上 | 6.4.11 | クローズアウト期間 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1に同じ | - |
| 6.4 | 同上 | 6.4.12 | クローズアウト期間の変更日 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1に同じ | - |
| 6.4 | 同上 | 6.4.13 | 当初証拠金率へのリンク | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1に同じ | - |
| 6.4 | 同上 | 6.4.14 | パラメータ見直しの頻度 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1に同じ | - |
| 6.4 | 同上 | 6.4.15 | パラメータ見直しの頻度の変更日 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1に同じ | - |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|-----|---|---------|--|------|---------|-----------|------------|
| 6.5 | 当初証拠金に係るバックテストの結果。これには少なくとも、各清算業務と当該清算業務に適用される当初証拠金算出モデル毎の以下の情報が含まれる。 | 6.5.1.1 | 直近12か月間で、各口座における証拠金のカバレッジ水準が当該口座における実際の値洗い額を下回った回数 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1 に同じ | - |
| 6.5 | バックテストの実施は日中に行われているか、継続的に行われているか、1日1回か明示する。1日1回の場合は時間を明示する。 | 6.5.1.2 | バックテストの実施頻度 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1 に同じ | - |
| 6.5 | 同上 | 6.5.1.3 | バックテストが1日1回の場合はその実施時間 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1 に同じ | - |
| 6.5 | 当初証拠金に係るバックテストの結果。これには少なくとも、各清算業務と当該清算業務に適用される当初証拠金算出モデル毎の以下の情報が含まれる。 | 6.5.2 | 参照数 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1 に同じ | - |
| 6.5 | 同上 | 6.5.3 | 達成されたカバレッジレベル | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1 に同じ | - |
| 6.5 | 同上 | 6.5.4 | 当初証拠金カバレッジのブリーチが発生した場合の未カバーのエクスポージャーの最大額 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1 に同じ | - |
| 6.5 | 同上 | 6.5.5 | 当初証拠金カバレッジのブリーチが発生した場合の未カバーのエクスポージャーの平均額 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1 に同じ | - |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|-----|---|-------|--|------|--|---|------------|
| 6.6 | 各営業日において参加者からCCPに支払われる変動証拠金総額の平均額 | 6.6.1 | 各営業日において参加者からCCPに支払われる変動証拠金総額の平均額 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1に同じ | - |
| 6.7 | 対象期間において参加者からCCPに支払われる変動証拠金総額の日次最大額 | 6.7.1 | 対象期間において参加者からCCPに支払われる変動証拠金総額の日次最大額 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1に同じ | - |
| 6.8 | 対象期間において参加者にコールがかけられた当初証拠金の追加預託要求総額の日次最大額 | 6.8.1 | 対象期間において参加者からCCPに支払われる変動証拠金総額の日次最大額 | 四半期毎 | 該当なし | 5.1.1に同じ | - |
| 7.1 | 流動性リスク | 7.1.1 | 清算業務がカバー1・カバー2のいずれを対象として十分な流動性資源を維持しているか | 四半期毎 | 最大の流動性資源を必要とするDVP参加者(単体ベース)2先に加えて、1先+関係法人(Cover1に該当)の破綻についてもカバーする水準の資金流動性(600億円)を流動性供給銀行1行が破綻しても確保できるよう保持している。 | 最大の総支払債務をもたらす可能性のある1先+関係法人が破綻した場合にも対応できるよう、1先+関係法人の差引支払限度額合計に上限(600億円)を設けている。 | 原則7.4 |
| 7.1 | 同上 | 7.1.2 | 清算業務毎の適格流動性資源の規模及び構成 (a)関連する通貨の発行主体である中央銀行の現金預金 | 四半期毎 | 0円 | | 原則7.5 |
| 7.1 | 同上 | 7.1.3 | 清算業務毎の適格流動性資源の規模及び構成 (b)その他中央銀行の現金預金 | 四半期毎 | 0円 | | 原則7.5 |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|-----|------|-------|---|------|---------|---|------------|
| 7.1 | 同上 | 7.1.4 | 清算業務毎の適格流動性資源の規模及び構成 (c)商業銀行における保全された現金預金(リバースレボを含む) | 四半期毎 | 150億円 | 参加者基金は信託銀行を受託者として信託設定を行っている。 | 原則7.5 |
| 7.1 | 同上 | 7.1.5 | 清算業務毎の適格流動性資源の規模及び構成 (d)商業銀行における未保全の現金預金 | 四半期毎 | 0円 | | 原則7.5 |
| 7.1 | 同上 | 7.1.6 | 清算業務毎の適格流動性資源の規模及び構成 (e)コミットされた有担保信用供与枠(CCPが引き出そうとした場合に担保/証券が提供されるもの)、コミットされた外為スワップ及びコミットされたレボ取引を含む。 | 四半期毎 | 0円 | | 原則7.5 |
| 7.1 | 同上 | 7.1.7 | 清算業務毎の適格流動性資源の規模及び構成 (f)コミットされた無担保信用供与枠(即ち、CCPが担保/証券の供与なしに引き出すことができるもの) | 四半期毎 | 450億円 | コミットメントライン契約に基づく銀行融資枠で450億円を確保している(流動性供給銀行1行が破綻した場合でも450億円を確保。) | 原則7.5 |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|-----|----------------------------------|--------|---|------|--|--|------------|
| 7.1 | 同上 | 7.1.8 | 清算業務毎の適格流動性資源の規模及び構成 (g)カストディにおいて保持された高い市場性を有する担保及び投資資産であって、事前にアレンジされた信頼性の高い資金調達アレンジメントに基づき、極端ではあるが現実には起こり得る市場環境下においても即時に利用可能で現金に転換可能なもの | 四半期毎 | 0円 | | 原則7.5 |
| 7.1 | 同上 | 7.1.9 | 清算業務毎の適格流動性資源の規模及び構成 (h)その他 | 四半期毎 | 0円 | | 原則7.5 |
| 7.1 | 同上 | 7.1.10 | CCPは中央銀行の流動性/流動性供給ファシリティに恒常的にアクセス可能か | 四半期毎 | 該当なし | 当社は、中央銀行から与信を受ける取決めを結んでいない。 | 原則7.5 |
| 7.1 | 同上 | 7.1.11 | 適格流動性資源を用いる際、CCPが支払債務に充当するために優先順位をつけることが許容または求められる場合における、支払スケジュールまたは支払割当の優先順位、それらの決定に際して適用される規定、方針、手続き、ガバナンス | 四半期毎 | 参加者の資金支払時限である15時10分までに支払いがなかった場合、当社は直ちに資金を調達し、当日中に資金決済を行う。流動性資金の割当優先順位は①参加者基金→②流動性供給銀行からの資金の借入れとなっている。 | | 原則7.2 |
| 7.2 | 適格流動性資源に加えて清算業務毎の補完的な流動性資源の規模と構成 | 7.2.1 | 7.1の適格流動性資源に加えて清算業務毎の補完的な流動性資源の規模と構成 | 四半期毎 | 該当なし | 制度上、債務引受額に上限を設けていることから追加的な流動性資源は保有していない。 | 原則7.6 |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|-----|--------|-------|---|------|-----------------|---|------------|
| 7.3 | 流動性リスク | 7.3.1 | 極端ではあるが起り得る市場環境において参加者1先及びその関連法人(間接参加者・顧客のために清算される取引分も含む)の破綻から生じ得る同日支払債務、及び関連するものがある場合は日中支払債務と複数日支払債務の推定最大総額 フォワードルッキングな推計値を四半期毎 | 四半期毎 | 35,473,235,530円 | 過去12か月における1日あたり最大額を記載。 なお、2017年3月31日から、最大の総支払債務をもたらす可能性のある1先+関係法人が破綻した場合にも対応できるよう、1先+関係法人の差引支払限度額合計に上限(600億円)を設けている。 | - |
| 7.3 | 同上 | 7.3.2 | 上記の金額が適格流動性資源(7.1に規定しているもので、ブリーチ発生時点の利用可能額)を超えた場合、その営業日数と超過金額 四半期中の日数 | 四半期毎 | 0日 | 7.1.1に同じ | - |
| 7.3 | 同上 | 7.3.3 | 上記の金額が適格流動性資源(7.1に規定しているもので、ブリーチ発生時点の利用可能額)を超えた場合、その営業日数と超過金額 各超過日における超過額 | 四半期毎 | 0円 | 7.1.1に同じ | - |
| 7.3 | 同上 | 7.3.4 | 参加者1先及びその関連法人(間接参加者・顧客のために清算される取引分も含む)の実際の日中/複数日支払債務額の最大額。 過去12か月における1日あたり最大額 | 四半期毎 | 35,473,235,530円 | 7.1.1に同じ | - |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|------|-----------------------------------|--------|---|------|-----------------|-------------|------------|
| 7.3 | 同上 | 7.3.5 | 極端ではあるが起こり得る市場環境において参加者1先及びその関連法人(間接参加者・顧客のために清算される取引分も含む)の破綻から生じ得る同日支払債務、及び関連するものがある場合は日中支払債務と複数日支払債務の関連通貨毎の推定最大総額(通貨毎に)。フォワードルッキングな推計値を四半期毎 | 四半期毎 | 35,473,235,530円 | 7.3.1に同じ | - |
| 7.3 | 同上 | 7.3.6 | 上記の金額が各関連通貨につき適格流動性資源(7.1に規定しているもので、ブリーチ発生時点の利用可能額)を超えた場合、その営業日数と超過金額 四半期中の日数 | 四半期毎 | 0日 | 7.1.1に同じ | - |
| 7.3 | 同上 | 7.3.7 | 上記の金額が各関連通貨につき適格流動性資源(7.1に規定しているもので、ブリーチ発生時点の利用可能額)を超えた場合、その営業日数と超過金額 各超過日における超過額 | 四半期毎 | 0円 | 7.1.1に同じ | - |
| 12.1 | DvP、DvD又はPvP型決済システムを利用した決済の金額別の割合 | 12.1.1 | DvP型決済システムを利用した決済の金額別の割合 | 四半期毎 | 100% | 全てDVP決済である。 | 原則12.1 |
| 12.1 | 同上 | 12.1.2 | DvD型決済システムを利用した決済の金額別の割合 | 四半期毎 | 0% | 12.1.1に同じ | - |
| 12.1 | 同上 | 12.1.3 | PvP型決済システムを利用した決済の金額別の割合 | 四半期毎 | 0% | 12.1.1に同じ | - |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|------|---------------------------------|----------|--|------|---------|-----------|------------|
| 12.2 | DvP、DvD又はPvP決済メカニズムを利用する決済数量の比率 | 12.2.1 | DvP型決済システムを利用した決済の取引高別の割合 | 四半期毎 | 100% | 12.1.1に同じ | - |
| 12.2 | 同上 | 12.2.2 | DvD型決済システムを利用した決済の取引高別の割合 | 四半期毎 | 0% | 12.1.1に同じ | - |
| 12.2 | 同上 | 12.2.3 | PvP型決済システムを利用した決済の取引高別の割合 | 四半期毎 | 0% | 12.1.1に同じ | - |
| 13.1 | 参加者破綻に関する定量情報 | 13.1.1 | 参加者破綻に関する定量情報 損失額及び当初証拠金額 | 随時 | 該当なし | | - |
| 13.1 | 同上 | 13.1.2 | 参加者破綻に関する定量情報 損失を補てんするために用いられたその 他財務資源の額 | 随時 | 該当なし | | - |
| 13.1 | 同上 | 13.1.3.1 | 参加者破綻に関する定量情報 手仕舞いされた顧客ポジション | 随時 | 該当なし | | - |
| 13.1 | 同上 | 13.1.3.2 | 参加者破綻に関する定量情報 移管された顧客ポジション | 随時 | 該当なし | | - |
| 13.1 | 同上 | 13.1.4 | 参加者破綻に関する定量情報 参加者破綻に係るその他開示文書 への適切な参照 | 随時 | 該当なし | | - |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|------|--|--------|--|------|------------------------------|--|------------|
| 14.1 | 清算業務毎に保持されている総顧客ポジション(清算済想定元本価額又は現物取引の決済代金の割合) | 14.1.1 | 顧客分別管理口座における総顧客ポジション | 四半期毎 | 該当なし | 当社は現物取引のみを対象としている。また、債権債務関係は当社とDVP参加者との間で成立していることから、DVP参加者の顧客のポジションと関連する担保に関する分別管理及び勘定移管の取決めを設けていない。 | 原則14 |
| 14.1 | 同上 | 14.1.2 | LSOC(法的には分別され、実務上混蔵されている)口座以外の顧客のみのオムニバス口座における総顧客ポジション | 四半期毎 | 該当なし | 14.1.1に同じ | - |
| 14.1 | 同上 | 14.1.3 | LSOC口座における総顧客ポジション | 四半期毎 | 該当なし | 14.1.1に同じ | - |
| 14.1 | 同上 | 14.1.4 | 自己委託が混蔵されている口座における総顧客ポジション | 四半期毎 | 該当なし | 14.1.1に同じ | - |
| 15.1 | ビジネスリスク | 15.1.1 | 資本を財源としたネットベースの流動資産 | 年次 | 【2023年3月期】 1,922,068,735円 | | - |
| 15.1 | 同上 | 15.1.2 | 6カ月分の当期営業費用 | 年次 | 【2023年3月期】 441,438,982円 | | - |
| 15.2 | ビジネスリスク(金融資産の開示) | 15.2.1 | 総収益 | 年次 | 【2023年3月期】 1,067,938,688円 | | - |
| 15.2 | 同上 | 15.2.2 | 総支出 | 年次 | 【2023年3月期】 887,215,032円 | | - |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|------|----------------|--------|--|------|---|----|------------|
| 15.2 | 同上 | 15.2.3 | 利益 | 年次 | 【2023年3月期】 76,981,250円 | | - |
| 15.2 | 同上 | 15.2.4 | 総資産 | 年次 | 【2023年3月期】 67,858,251,097円 | | - |
| 15.2 | 同上 | 15.2.5 | 総負債 | 年次 | 【2023年3月期】 65,925,462,576円 | | - |
| 15.2 | 同上 | 15.2.6 | 清算機関のバランスシートに計上又は計上されない清算参加者から差し入れる担保があれば記述せよ。 | 年次 | 【2023年3月期】 参加者基金特定資産／預り参加者基金 65,649,522,871円 担保指定証券残高 33,419,595,133円 | | - |
| 15.2 | 同上 | 15.2.7 | その他必要な事項 | 年次 | 【2023年3月期】 なし | | - |
| 15.3 | ビジネスリスク(収入の内訳) | 15.3.1 | 清算業務の提供に関する手数料の総収入に占める割合 | 年次 | 【2023年3月期】 99.9% | | - |
| 15.3 | 同上 | 15.3.2 | 清算参加者が提供する資産の再投資(又は再担保)から生ずる収益の総収入に占める割合 | 年次 | 【2023年3月期】 0.04% | | - |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|------|--|--------|--|------|---------|--|------------|
| 16.1 | 保有、預託又は投資の形態を問わず、参加者から受領した現金(有価証券は除く)の合計。当初証拠金又はデフォルトファンドの内訳 | 16.1.1 | 保有、預託又は投資の形態を問わず、参加者から受領した当初証拠金の現金(有価証券は除く)の合計 | 四半期毎 | 該当なし | 当社は証拠金制度及びデフォルトファンドは採用していないが、確保資産のうち、参加者基金として現金の預託を求めている。参加者基金はすべて信託銀行を受託者として信託設定を行っている。 | 原則16.2 |
| 16.1 | 同上 | 16.1.2 | 保有、預託又は投資の形態を問わず、参加者から受領したデフォルトファンドの現金(有価証券は除く)の合計 | 四半期毎 | 該当なし | 16.1.1.に同じ | - |
| 16.2 | 参加者から受領した現金(項番16.1に記載)の保持、預金又は投資 | 16.2.1 | 現預金(リバースレポを含む)で保持されている参加者の現金の割合 | 四半期毎 | 該当なし | 16.1.1.に同じ | - |
| 16.2 | 同上 | 16.2.2 | 関連する通貨の発行主体である中央銀行の現預金(リバースレポを含む)で保持されている参加者の現金の割合 | 四半期毎 | 該当なし | 16.1.1.に同じ | - |
| 16.2 | 同上 | 16.2.3 | その他の中央銀行の現預金(リバースレポを含む)で保持されている参加者の現金の割合 | 四半期毎 | 該当なし | 16.1.1.に同じ | - |
| 16.2 | 同上 | 16.2.4 | 商業銀行のマナー(担保保全されているもの(リバースレポを含む))で保持されている参加者の現金の割合 | 四半期毎 | 該当なし | 16.1.1.に同じ | - |
| 16.2 | 同上 | 16.2.5 | 商業銀行のマナー(担保保全されていないもの)で保持されている参加者の現金(リバースレポを含む)の割合 | 四半期毎 | 該当なし | 16.1.1.に同じ | - |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|------|------|---------|--|------|---------|-------------|------------|
| 16.2 | 同上 | 16.2.6 | MMF(マネーマーケットファンド)で保持されている参加者の現金(リバースレポを含む)の割合 | 四半期毎 | 該当なし | 16.1.1.1に同じ | - |
| 16.2 | 同上 | 16.2.7 | その他の方法で保持されている参加者の現金(リバースレポを含む)の割合 | 四半期毎 | 該当なし | 16.1.1.1に同じ | - |
| 16.2 | 同上 | 16.2.8 | 参加者から預託された現金にかかるこれらの現金預金(リバースレポを含む)及びMMFの通貨ごとの割合 | 四半期毎 | 該当なし | 16.1.1.1に同じ | - |
| 16.2 | 同上 | 16.2.9 | 参加者から預託された現金にかかるこれらの現金預金(リバースレポを含む)及びMMFの平均残存期間 | 四半期毎 | 該当なし | 16.1.1.1に同じ | - |
| 16.2 | 同上 | 16.2.10 | 国内のソブリン債に投資されている参加者の現金の割合 | 四半期毎 | 該当なし | 16.1.1.1に同じ | - |
| 16.2 | 同上 | 16.2.11 | 国外のソブリン債に投資されている参加者の現金の割合 | 四半期毎 | 該当なし | 16.1.1.1に同じ | - |
| 16.2 | 同上 | 16.2.12 | 政府機関債に投資されている参加者の現金の割合 | 四半期毎 | 該当なし | 16.1.1.1に同じ | - |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|------|------|---------|---|------|---------|------------|------------|
| 16.2 | 同上 | 16.2.13 | 地方債に投資されている参加者の現金の割合 | 四半期毎 | 該当なし | 16.1.1.に同じ | - |
| 16.2 | 同上 | 16.2.14 | その他金融商品に投資されている参加者の現金の割合 | 四半期毎 | 該当なし | 16.1.1.に同じ | - |
| 16.2 | 同上 | 16.2.15 | 有価証券に投資している参加者から預託された現金の通貨毎の購入割合 | 四半期毎 | 該当なし | 16.1.1.に同じ | - |
| 16.2 | 同上 | 16.2.16 | 有価証券の平均残存期間 | 四半期毎 | 該当なし | 16.1.1.に同じ | - |
| 16.2 | 同上 | 16.2.17 | 投資ポートフォリオ(中央銀行の預金及び商業銀行の預金を除く)において想定するリスク量(1日分の価格変動、99%カバーのVaRベース、又はそれと同等の情報) | 四半期毎 | 該当なし | 16.1.1.に同じ | - |
| 16.2 | 同上 | 16.2.18 | CCPの投資ポリシーにおいて、単一の相手方に対する投資割合を定めているのであれば、その限界の大きさ | 四半期毎 | 該当なし | 16.1.1.に同じ | - |
| 16.2 | 同上 | 16.2.19 | 前四半期において前述の投資制限を超えた実績 | 四半期毎 | 該当なし | 16.1.1.に同じ | - |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|------|---------------------------|---------|---|------|---------|--|------------|
| 16.2 | 同上 | 16.2.20 | 有価証券に投資されている参加者の現金の割合(合計) | 四半期毎 | 該当なし | 16.1.1.1に同じ | - |
| 16.3 | 参加者資産(非現金担保)のCCPIによる再担保提供 | 16.3.1 | 再投資されている非現金担保の総額(当初証拠金) | 四半期毎 | 該当なし | 当社は証拠金制度及びデフォルトファンドを採用していない。なお、担保指定証券の預託を受けているが、当該資産を用いた投資は行っていない。 | 原則16.4 |
| 16.3 | 同上 | 16.3.2 | 再投資されている非現金担保の総額(デフォルトファンド) | 四半期毎 | 該当なし | 16.3.1に同じ | - |
| 16.3 | 同上 | 16.3.3 | 再投資されている非現金担保の満期(当初証拠金) オーバーナイト～1日 1日～1週間 1週間～1か月 1か月～1年 1年～2年 2年以上 | 四半期毎 | 該当なし | 16.3.1に同じ | - |
| 16.3 | 同上 | 16.3.4 | 再投資されている非現金担保の満期(デフォルトファンド) オーバーナイト～1日 1日～1週間 1週間～1か月 1か月～1年 1年～2年 2年以上 | 四半期毎 | 該当なし | 16.3.1に同じ | - |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|------|---|----------|---|------|--------------|---|------------|
| 17.1 | 清算業務に係るコアシステム(アウトソースの有無に関わらず)における特定期間における当該システムの稼働目標(例えば、12か月間で99.99%等) | 17.1.1 | 清算業務に係るコアシステム(アウトソースの有無に関わらず)における特定期間における当該システムの稼働目標(例えば、12か月間で99.99%等) | 四半期毎 | 12か月間で99.99% | 当社はシステムの開発・運用を親会社である株式会社証券保管振替機構に委託している。 | 原則17.3 |
| 17.2 | 直近12か月間における当該コアシステムの特定期間におけるシステムの稼働実績 | 17.2.1 | 直近12か月間における当該コアシステムの特定期間におけるシステムの稼働実績 | 四半期毎 | 100.00% | | - |
| 17.3 | 障害の発生件数と障害持続時間 | 17.3.1 | 清算業務に係る当該コアシステムに影響する、直近12か月間に発生した障害の発生件数と障害持続時間 | 四半期毎 | 0件 | | - |
| 17.4 | 復旧目標 | 17.4.1 | 復旧目標(例えば2時間等) | 四半期毎 | 2時間以内 | バックアップセンタに設置している情報システムへの切替えを行い、業務を再開する場合。 | 原則17.6 |
| 18.1 | 業務毎の清算参加者数 | 18.1.1.1 | 総清算参加者の数 | 四半期毎 | 48社 | | - |
| 18.1 | 同上 | 18.1.1.2 | 直接清算参加者の数 | 四半期毎 | 48社 | 当社のDVP参加者は全て直接参加者である。 | - |
| 18.1 | 同上 | 18.1.1.3 | それ以外の清算参加者の数 | 四半期毎 | 該当なし | | - |
| 18.1 | 同上 | 18.1.2.1 | 参加者である中央銀行の数 | 四半期毎 | 0社 | | - |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|------|-------|----------|--|------|---------|---------------------------------------|------------|
| 18.1 | 同上 | 18.1.2.2 | 参加者である清算機関の数 | 四半期毎 | 0社 | | - |
| 18.1 | 同上 | 18.1.2.3 | 参加者である銀行の数 | 四半期毎 | 11社 | | - |
| 18.1 | 同上 | 18.1.2.4 | それ以外の参加者の数 | 四半期毎 | 37社 | 内訳は証券会社が36社、証券金融会社が1社となっている。 | - |
| 18.1 | 同上 | 18.1.3.1 | 国内の参加者の数 | 四半期毎 | 45社 | | - |
| 18.1 | 同上 | 18.1.3.2 | 海外の参加者の数 | 四半期毎 | 3社 | 内訳は外国証券会社が1社、外国銀行が2社となっている。 | - |
| 18.2 | 建玉の集中 | 18.2.1 | 各清算業務において清算参加者数が10社以上25社未満の場合 トップ5社の清算参加者が保有する自己委託合わせた建玉の全体に占める合計割合 前四半期の平均値 | 四半期毎 | 該当なし | 当社は決済日当日のみの債務引受けとなっているため、未決済残高は発生しない。 | - |
| 18.2 | 同上 | 18.2.2 | 各清算業務において清算参加者数が25社以上の場合 トップ5社の清算参加者が保有する自己委託合わせた建玉の全体に占める合計割合 前四半期の平均値 | 四半期毎 | 0 | 18.2.1に同じ | - |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|------|--------------|--------|---|------|---------|------------------------------|------------|
| 18.2 | 同上 | 18.2.3 | 各清算業務において清算参加者数が25社以上の場合 トップ10社の清算参加者が保有する自己委託合わせた建玉の全体に占める合計割合 前四半期の平均値 | 四半期毎 | 0 | 18.2.1に同じ | - |
| 18.3 | 当初証拠金の集中 | 18.3.1 | 各清算業務において清算参加者数が10社以上25社未満の場合 トップ5社の清算参加者が保有する自己委託合わせた当初証拠金の全体に占める合計割合 前四半期の平均値 | 四半期毎 | 該当なし | 当社は証拠金制度及びデフォルトファンドを採用していない。 | - |
| 18.3 | 同上 | 18.3.2 | 各清算業務において清算参加者数が25社以上の場合 トップ5社の清算参加者が保有する自己委託合わせた当初証拠金の全体に占める合計割合 前四半期の平均値 | 四半期毎 | 該当なし | 18.3.1に同じ | - |
| 18.3 | 同上 | 18.3.3 | 各清算業務において清算参加者数が25社以上の場合 トップ10社の清算参加者が保有する自己委託合わせた当初証拠金の全体に占める合計割合 前四半期の平均値 | 四半期毎 | 該当なし | 18.3.1に同じ | - |
| 18.4 | 分別された清算基金の集中 | 18.4.1 | 各清算業務において清算参加者数が10社以上25社未満の場合 トップ5社の清算参加者が保有する清算基金の全体に占める割合 | 四半期毎 | 該当なし | 18.3.1に同じ | - |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|------|-------------------|----------|--|------|---------|---|------------|
| 18.4 | 同上 | 18.4.2 | 各清算業務において清算参加者数が25社以上の場合 トップ5社の清算参加者が保有する清算基金の全体に占める割合 | 四半期毎 | 該当なし | 18.3.1に同じ | - |
| 18.4 | 同上 | 18.4.3 | 各清算業務において清算参加者数が25社以上の場合 トップ10社の清算参加者が保有する清算基金の全体に占める割合 | 四半期毎 | 該当なし | 18.3.1に同じ | - |
| 19.1 | 階層的参加形態、顧客取引の集中度合 | 19.1.1 | 顧客数(把握している場合) | 四半期毎 | 該当なし | 当社のDVP参加者は全て直接参加者であり、当社との債権債務関係は、直接参加者であるDVP参加者との間で発生することとなる。 | 原則19 |
| 19.1 | 同上 | 19.1.2 | 顧客の為に清算を行う直接参加者の数 | 四半期毎 | 該当なし | 19.1.1に同じ | - |
| 19.1 | 同上 | 19.1.3.1 | (清算参加者数が10社以上の場合)トップ5社の清算参加者の実施する清算業務毎の顧客取引の最大割合 | 四半期毎 | 該当なし | 19.1.1に同じ | - |
| 19.1 | 同上 | 19.1.3.2 | (清算参加者数が10社以上の場合)トップ5社の清算参加者の実施する清算業務毎の顧客取引の平均割合 | 四半期毎 | 該当なし | 19.1.1に同じ | - |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|------|-----------------------------|----------|---|------|---------|-----------------------|----------------|
| 19.1 | 同上 | 19.1.4.1 | (清算参加者数が25社以上の場合)トップ10社の清算参加者の実施する清算業務毎の顧客取引の最大割合 | 四半期毎 | 該当なし | 19.1.1に同じ | - |
| 19.1 | 同上 | 19.1.4.2 | (清算参加者数が25社以上の場合)トップ10社の清算参加者の実施する清算業務毎の顧客取引の平均割合 | 四半期毎 | 該当なし | 19.1.1に同じ | - |
| 20.1 | FMI間リンク。取引価額 | 20.1.1 | 各リンクを通じて清算される取引の価値 - 合計取引価値のシェア/清算済合計元本価額 | 四半期毎 | 該当なし | 当社は他のCCPとのリンクは行っていない。 | 原則20.7及び原則20.8 |
| 20.2 | FMI間リンク。当初証拠金又は供給される同等の財務資源 | 20.2.1 | リンクを介して清算される約定についてリンク先CCPのポテンシャル・フューチャー・エクスポージャーをカバーするためにCCPが各リンク先CCPに対して提供した当初証拠金又は同等の財源 | 四半期毎 | 該当なし | 20.1.1に同じ | - |
| 20.3 | FMI間リンク。当初証拠金又は徴収される同等の財務資源 | 20.3.1 | リンクを介して清算される約定(市場価額でかつヘアカット適用後)についてリンク先CCPに対するポテンシャル・フューチャー・エクスポージャーをカバーするために各リンク先CCPから徴収した当初証拠金又は同等の財源 | 四半期毎 | 該当なし | 20.1.1に同じ | - |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|------|----------------------------|----------|---|------|---------|-----------|------------|
| 20.4 | FMI間リンク。バックテストによるカバーレージの結果 | 20.4.1.1 | 過去12か月の期間において、各リンク先CCPに対して保管されている証拠金及び同等の財源によって提供される損失補填財源が当該リンク先CCPに対する実際の時価エクスポージャーを下回った回数 - 日々のバックテストの結果に基づく。日中又は継続的又は1日1回 | 四半期毎 | 該当なし | 20.1.1に同じ | - |
| 20.4 | 同上 | 20.4.1.2 | バックテストの頻度。日中又は継続的又は1日1回 | 四半期毎 | 該当なし | 20.1.1に同じ | - |
| 20.4 | 同上 | 20.4.1.3 | 20.4.1.2の回答が1日1回である場合は、その計測時間 | 四半期毎 | 該当なし | 20.1.1に同じ | - |
| 20.4 | 同上 | 20.4.2 | 観察対象数(すなわち、口座数×バックテスト対象日数)、日中又は継続的又は1日1回 | 四半期毎 | 該当なし | 20.1.1に同じ | - |
| 20.4 | 同上 | 20.4.3 | 達成したカバーレベル、日中又は継続的又は1日1回 | 四半期毎 | 該当なし | 20.1.1に同じ | - |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|------|-----------------------------|----------|--|------|---------|-----------|------------|
| 20.5 | FMI間リンク。追加的に供給される事前拠出型の財務資源 | 20.5.1.1 | CCPIに対するエクスポージャーをカバーするためにリンク先CCPIに対して利用可能とされる、各リンク先CCPIに対して提供した当初証拠金及び同等の財源を超える追加の事前拠出型財源(もしあれば) | 四半期毎 | 該当なし | 20.1.1に同じ | - |
| 20.5 | 同上 | 20.5.1.2 | これが標準的な破綻基金の一部か、追加となるものか、又は独立したものかの別 | 四半期毎 | 該当なし | 20.1.1に同じ | - |
| 20.6 | FMI間リンク。追加的に徴収される事前拠出型の財務資源 | 20.6.1.1 | CCPIに対するエクスポージャーをカバーするためにリンク先CCPIに対して利用可能とされる、各リンク先CCPIに対して徴収した当初証拠金及び同等の財源を超える追加の事前拠出型財源(もしあれば) | 四半期毎 | 該当なし | 20.1.1に同じ | - |
| 20.6 | 同上 | 20.6.1.2 | これが標準的な破綻基金の一部か、追加となるものか、又は独立したものかの別 | 四半期毎 | 該当なし | 20.1.1に同じ | - |
| 20.7 | FMI間リンク。クロスマージン | 20.7.1 | 清算業務ごとに、クロスマージンの対象となる取引の価値。取引価値合計/清算済合計元本価額をパーセント表示 | 四半期毎 | 該当なし | 20.1.1に同じ | - |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|------|----------------------------|--------|--|------|----------------------------------|--------------------------------------|------------|
| 20.7 | FMI間リンク。クロスマージン | 20.7.2 | クロスマージンの結果実現したCCPが保有する当初証拠金合計額の減額。クロスマージンがなければ保有されていたであろう当初証拠金合計額に対するパーセント表示 | 四半期毎 | 該当なし | 20.1.1に同じ | - |
| 23.1 | 規則・主要手続・市場データの開示；日々の取引量の平均 | 23.1.1 | 一日平均取引高 資産、商品、通貨、取引所取引又は店頭取引の別 | 四半期毎 | 156,096件 | 当社の取引通貨は全て円であり、対象取引はOTC取引のみである。 | - |
| 23.1 | 同上 | 23.1.2 | 清算済み取引の一日平均想定元本額 資産、商品、通貨、取引所取引又は店頭取引の別 | 四半期毎 | 3,522,250,516,057円 (35,223億円) | 23.1.1に同じ | - |
| 23.2 | 規則・主要手続・市場データの開示；未決済取引 | 23.2.1 | 想定元本額／債務引受済かつ未決済の取引金額 資産、商品、通貨、取引所取引又は店頭取引の別 | 四半期毎 | 0円 | 当社は決済日当日のみの債務引受となっているため、未決済残高は発生しない。 | - |
| 23.2 | 同上 | 23.2.2 | 23.1.1、23.1.2及び23.2.1で報告された取引高のアセットクラス | 四半期毎 | 株式等に係る現物取引 | | - |

| 項番 | 開示項目 | 参照番号 | 開示内容 | 開示頻度 | 開示に係る回答 | 備考 | 定性的開示の参照箇所 |
|------|---------------------------|--------|--------------------------------------|------|---|--|------------|
| 23.2 | 同上 | 23.2.3 | 23.1.1、23.1.2及び23.2.1で報告された取引高の商品種類 | 四半期毎 | a 株式 b 新株予約権 c 新株予約権付社債 d 投資口 e 新投資口予約権 f 優先出資 g 投資信託受益権 h 受益証券発行信託の受益権 i 外国株券等 j 国債 | | - |
| 23.2 | 同上 | 23.2.4 | 23.1.1、23.1.2及び23.2.1で報告された取引高の商品コード | 四半期毎 | | | - |
| 23.3 | 規則・主要手続・市場データの開示;取引執行システム | 23.3.1 | 各取引執行システム又は照合/確認システムから提供される日別平均取引高 | 四半期毎 | 156,096件 | 当社の対象取引は全て証券保管振替機構の決済照合システムで照合一致となった取引である。 | - |
| 23.3 | 同上 | 23.3.2 | 各取引執行システム又は照合/確認システムから提供される想定元本額 | 四半期毎 | 3,522,250,516,057円 (35,223億円) | 23.3.1に同じ | - |