金利スワップ清算基金所要額に関する規則

（目的等）

第１条　この金利スワップ清算基金所要額に関する規則（以下「本規則」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。）が制定した金利スワップ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１７条の規定に基づき、金利スワップ清算基金所要額を定めることを目的とする。

２　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。

（金利スワップ清算基金所要額）

第２条　各清算参加者に係る金利スワップ清算基金所要額は、毎営業日、別表「金利スワップ清算基金所要額の算出に関する表」により算出する額とする。ただし、当社は、当該清算参加者が合併する場合その他必要と認める場合に限り、金利スワップ清算基金所要額を臨時に変更することができる。

２　前項の規定にかかわらず、新たに金利スワップ清算資格を取得する者に係る金利スワップ清算基金所要額は、当該者が金利スワップ清算資格を取得した後の金利スワップ取引の状況が前項の規定により算出される金利スワップ清算基金所要額に適正に反映される状況に至るまでの間、当該者の会社規模、取引実績及びその見込み、金利スワップ清算資格の取得の申請を行った日において各清算参加者の金利スワップ清算基金所要額を合計した額を清算参加者の総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する。

付　　則

本規則は、平成２４年１０月９日から施行する。

付　　則

この改正規定は、平成２６年２月２４日から施行する。

付　　則

この改正規定は、平成２６年５月２９日から施行する。

付　　則

この改正規定は、平成２７年９月２４日から施行する。

付　　則

１　この改正規定は、平成２８年４月１１日から施行する。

２　前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社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、平成２８年４月１１日以後の当社が定める日から施行する。

付　　則

この改正規定は、平成２８年１０月１１日から施行する。

付　　則

この改正規定は、平成２９年１月３０日から施行する。

付　　則

１　この改正規定は、平成３０年９月２５日から施行する。

２　前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社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、平成３０年９月２５日以後の当社が定める日から施行する。

付　　則

１　この改正規定は、令和３年５月１７日から施行する。

２　前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社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、令和３年５月１７日以後の当社が定める日から施行する。

付　　則

１　この改正規定は、令和５年５月２２日から施行する。

２　前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社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、令和５年５月２２日以後の当社が定める日から施行する。

付　　則

１　この改正規定は、令和６年３月４日から施行する。

２　前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社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、令和６年３月４日以後の当社が定める日から施行する。

別表　金利スワップ清算基金所要額の算出に関する表

１　各清算参加者に係る金利スワップ清算基金所要額は、金利スワップ清算基金算出日（金利スワップ清算基金所要額の算出を行う日をいう。以下同じ。）におけるストレス時想定損失負担額と１億円のうちいずれか大きい額とする。

２　前項に規定するストレス時想定損失負担額は、次の各号に掲げる清算参加者の区分に従い、当該各号に定める額とする。

（１）　次号に該当しない清算参加者

ストレス時想定損失基準額

（２）　ストレス時想定損失負担額の減額の対象となる受託清算参加者（以下「減額対象清算参加者」という。）

ストレス時想定損失基準額から割当減少額を差し引いた額。ただし、当社は、当社が必要と認める場合には、本号の規定により算出される各清算参加者のストレス時想定損失負担額を、当該清算参加者のストレス時想定損失基準額を超えない範囲で臨時に変更することができる。

３　前項に規定するストレス時想定損失基準額は、対応する金利スワップ清算基金算出日における清算参加者の担保超過リスク額（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）（業務方法書第６５条の２に規定する当初証拠金所要額の引上げ（以下「クライアントアディショナルマージン」という。）が適用されていないと仮定して算出したもの）が上位である清算参加者２社の当該担保超過リスク額の合計額を、当該金利スワップ清算基金算出日における第１項の各清算参加者の自己取引口座及び委託取引口座に係る当初証拠金所要額（クライアントアディショナルマージンが適用されていないと仮定して算出したもの）に応じて按分した額とする。なお、「担保超過リスク額」とは、当該各清算参加者の金利スワップ清算基金算出日における午後７時時点における自己取引口座及び各委託取引口座に係る清算約定に係るストレス時リスク相当額（金利スワップ取引に係る清算イールド・カーブ、クロスマージン対象国債先物清算約定に係るイールド・カーブ及びクロスマージン対象金利先物清算約定に係るイールド・カーブの極端な変動により、当該清算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当社営業日の当該自己取引口座及び委託取引口座に係る当初証拠金所要額を差し引いた額（当該委託取引口座に係る当該額が負数となる場合は、０とする。）を、当該各清算参加者について合算した額（当該合算した額が負数となる場合は、０とする。）をいう。

４　第２項第２号に掲げるストレス時想定損失負担額の減額の対象となる受託清算参加者

は、次の各号のいずれにも該当する受託清算参加者とする。

（１）　クライアントアディショナルマージンにより、対応する金利スワップ清算基金算出日における委託取引口座に係る当初証拠金所要額の引き上げが行われていること

（２）　対応する金利スワップ清算基金算出日における清算参加者の担保超過リスク額（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）（クライアントアディショナルマージンが適用されていないと仮定して算出したもの）が上位である清算参加者２社に該当すること

５　第２項第２号に規定する割当減少額は、次の各号のいずれか小さい額とする。

（１）　対応する金利スワップ清算基金算出日における清算参加者の担保超過リスク額（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）（クライアントアディショナルマージンが適用されていないと仮定して算出したもの）が上位である清算参加者２社の当該担保超過リスク額の合計額から当該金利スワップ清算基金算出日における清算参加者の担保超過リスク額（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社の当該担保超過リスク額の合計額を差し引いた額を、当該金利スワップ清算基金算出日における各減額対象清算参加者の担保超過リスク額（クライアントアディショナルマージンが適用されていないと仮定して算出したもの）から当該減額対象清算参加者の担保超過リスク額（ストレス時想定損失基準額を算定する際に使用されたイールド・カーブの変動を用いて算出したもの）を差し引いた額に応じて按分したもの

（２）　第３項に規定するストレス時想定損失基準額に、当該金利スワップ清算基金算出日の委託取引口座（クライアントアディショナルマージンの適用対象となっているものに限る。）に係る当初証拠金所要額（業務方法書第２９条の２第１項に規定する当初証拠金所要額の引上げ、業務方法書第３２条に規定する当初証拠金所要額の引上げ及びクライアントアディショナルマージンが適用されていないと仮定して算出したもの。以下この号において同じ。）を合計した額を当該金利スワップ清算基金算出日の自己取引口座及び委託取引口座に係る当初証拠金所要額を合計した額で除した値を乗じた額