清算約定の内容を定める件

２０１２年9月５日
２０１４年2月２４日改正
２０１５年１０月２６日改正
２０２１年１２月６日改正
株式会社日本証券クリアリング機構

当社は、金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の取扱い第２９条第３項の規定に基づき、清算約定の内容を別紙のとおり定める。

以　　上

別紙

1. 定義

本別紙において使用する用語は、本別紙に別段の定めがある場合を除き、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。）に規定する本業務方法書等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) 「固定金利支払人支払日」とは、固定金利支払人が固定金額を支払うべき日として金利スワップ取引の当事者間で合意される日をいう。
(2) 「変動金利支払人支払日」とは、変動金利支払人が変動金額を支払うべき日として金利スワップ取引の当事者間で合意される日をいう。

2. 清算約定の内容

適格金利スワップ取引（以下「清算対象金利スワップ取引」という。）の当事者である清算参加者（以下「清算参加者Ｘ」という。）及び他の清算参加者（以下「清算参加者Ｙ」という。）による債務負担の申込みによって成立する当社及び清算参加者Ｘの間の清算約定並びに当社及び清算参加者Ｙの間の清算約定の内容は、業務方法書第４９条第１項及び第５１条第１項に定めるほか、次の表に定めるとおりとする。なお、業務方法書に定める条件（次の表に定める内容を含む）を同じくする清算約定は、当社において経済的に同等であり、業務方法書の定めるところに従い当社においてコンプレッションその他の処理の対象となる。

想定元本	清算対象金利スワップ取引と同一の内容
通貨	
取引日	
開始日	
終了日	
固定金利支払人支払日	清算対象金利スワップ取引と同一の内容（清算約定の当事者のいずれかが固定金利支払人である場合に限る。）
固定金利	
固定金利日数計算	
変動金利支払人支払日	清算対象金利スワップ取引と同一の内容（清算約定の当事者がいずれも変動金利支払人である場合には、変動金利支払人ごとの内容）
変動金額	
変動金利の決定方法	
変動金利の計算期間	

スプレッド	
変動金利日数計算	
金利更改日	
ストレート複利計算又はフラット複利計算の適用の有無	
複利計算日	
営業日	清算対象金利スワップ取引と同一の内容
営業日調整	
アップフロントフィーの支払義務者	清算対象金利スワップ取引におけるアップフロントフィーの支払義務者（当該支払義務者が清算約定の当事者でない場合には、当社）
アップフロントフィーの金額	清算対象金利スワップ取引と同一の内容
アップフロントフィーの支払日	
計算代理人	当社

※清算対象金利スワップ取引に取引開始の一定期間後の時点で取引を中途解約できる権利（いわゆるＭｕｔｕａｌ　Ｐｕｔ条項）が含まれている場合でも、当該権利は当該清算対象金利スワップ取引に係る清算約定には引き継がれない（現に成立している清算約定についても、当該権利は引き継がれていない。）。

3.　ＩＳＤＡ定義集の読替え

本別紙において使用する用語のうち次の表の「用語」欄に掲げる用語は、それぞれ同表の「条項」欄に掲げるＩＳＤＡ定義集の規定に係る「ＩＳＤＡ定義集」欄に掲げる用語をいうものとする。

用語	条項	ＩＳＤＡ定義集
通貨	２．４．１	Ｃｕｒｒｅｎｃｉｅｓ
開始日	３．１．２	Ｅｆｆｅｃｔｉｖｅ　Ｄａｔｅ
複利計算日	４．９．２	Ｃｏｍｐｏｕｎｄｉｎｇ　Ｄａｔｅ
固定金利	５．３	Ｆｉｘｅｄ　Ｒａｔｅ
固定金利日数計算	５．４	Ｆｉｘｅｄ　Ｒａｔｅ　Ｄａｙ　Ｃｏｕｎｔ　Ｆｒａｃｔｉｏｎ
ストレート複利計算	６．２．２	Ｓｔｒａｉｇｈｔ　Ｃｏｍｐｏｕｎｄｉｎｇ
フラット複利計算	６．２．３	Ｆｌａｔ　Ｃｏｍｐｏｕｎｄｉｎｇ

用語	条項	ＩＳＤＡ定義集
変動金利日数計算	６．５．３	Ｆｌｏａｔｉｎｇ　Ｒａｔｅ　Ｄａｙ　Ｃｏｕｎｔ　Ｆｒａｃｔｉｏｎ
スプレッド	６．５．４	Ｓｐｒｅａｄ

以　　上