

新定義集移行前清算約定及び2003年版清算約定の取扱いについて

2014年9月22日

2014年10月6日改正

株式会社日本証券クリアリング機構

1. 新定義集移行前清算約定に関する事項（CDS清算業務に関する業務方法書第2条第1項第20号の2関係）

次に掲げる銘柄の適格CDS取引を平成26年9月22日以降に債務負担することにより成立する清算約定を、新定義集移行前清算約定とする。

Index	Series	Tenor
i Traxx Japan 50	Series 12	5 Y
i Traxx Japan 50	Series 13	5 Y
i Traxx Japan 50	Series 14	5 Y
i Traxx Japan 50	Series 15	5 Y
i Traxx Japan 50	Series 16	5 Y
i Traxx Japan 50	Series 17	5 Y
i Traxx Japan 50	Series 18	5 Y
i Traxx Japan 50	Series 19	5 Y
i Traxx Japan 50	Series 20	5 Y
i Traxx Japan 50	Series 21	5 Y

2. ISDAクレジットデリバティブ定義集の適用を受ける日に関する事項（CDS清算業務に関する業務方法書第51条の2第1項関係）

平成26年10月6日以降の日において存在する新定義集移行前清算約定のうち以下のものについては、当該日以降、ISDAクレジットデリバティブ定義集（2003年版）に代えて、ISDAクレジットデリバティブ定義集の適用を受けるものとする。

Index	Series	Tenor
i Traxx Japan 50	Series 12	5 Y
i Traxx Japan 50	Series 13	5 Y
i Traxx Japan 50	Series 14	5 Y
i Traxx Japan 50	Series 15	5 Y
i Traxx Japan 50	Series 16	5 Y
i Traxx Japan 50	Series 17	5 Y
i Traxx Japan 50	Series 18	5 Y
i Traxx Japan 50	Series 19	5 Y
i Traxx Japan 50	Series 20	5 Y
i Traxx Japan 50	Series 21	5 Y

3. 新定義集移行前清算約定の内容の変更に関する事項（CDS清算業務に関する業務方法書の取扱い第37条の2第1項及び第3項関係）

ISDAクレジットデリバティブ定義集の適用を受けることとなった新定義集移行前清算約定のうち、引き続きISDAクレジットデリバティブ定義集（2003年版）の適用を受けるインデックス取引以外のCDS取引及びインデックスCDS取引の部分は、次の各号に掲げる参照組織又はその承継者を対象とするものとする。

- (1) MIZUHO BANK, LTD.
- (2) NOMURA SECURITIES CO., LTD.
- (3) RESONA BANK, LIMITED
- (4) SUMITOMO MITSUI BANKING CORPORATION
- (5) THE BANK OF TOKYO-MITSUBISHI UFJ, LTD.

4. ショートチャージの取扱いに関する事項（CDS清算業務に関する業務方法書の取扱い別表2第1項b）

(1) 取引口座ごとのショートチャージの算出において、2003年版清算約定以外の清算約定に係る額によって計算した売超額を用いる基準として、「当社が公示により定める場合」とは、各取引口座の清算約定のうち一の参照組織について、2003年版清算約定が買超、2003年版清算約定以外の清算約定が売超となる場合であって、当該参照組織が前項各号に掲げる参照組織又はその承継者である場合をいう。

(2) 「参照組織の信用力について相当悪化したと当社が公示により定める場合」の判断は、参照組織の有する格付のいずれかがBBB格相当未満であることを判断要素の一つとする。

以 上