

クライアント・クリアリング導入等に伴う金利スワップ取引清算業務に関する 業務方法書等の一部改正について

I. 改正趣旨

現在、金利スワップ取引に係る清算業務における清算委託者の範囲について、受託清算参加者を含む同一の企業集団に含まれる会社（以下「アフィリエイト」という。）に限定しているところ、アフィリエイト以外も清算委託者として当社の金利スワップ取引清算業務に参加することを可能とするとともに、約定から債務負担までの期間を短縮すべく債務負担処理の見直し及び担保管理の方法の見直し等を行うことを予定していることを踏まえ、金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書等について、別紙1のとおり所要の制度改正を行う。

また、CDS清算業務における当初証拠金及び変動証拠金等に係る授受の方法等についても、金利スワップ清算業務との平仄を踏まえつつ、効率化の観点から見直しを行うこととし、CDS清算業務に関する業務方法書等について、別紙2のとおり所要の制度改正を行う。

II. 改正概要

1. 金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書等に関する改正概要

(1) クライアント・クリアリングの取扱いの承認及び廃止

- ・清算参加者がアフィリエイト以外の清算委託者（以下「クライアント」という。）からの委託に基づく有価証券等清算取次ぎ（以下「クライアント・クリアリング」という。）の取扱いをする場合には、当社の承認を要することとする。
- ・クライアント・クリアリングの取扱いを廃止しようとする場合には、あらかじめ清算委託者のポジションの解消等を行わなければならないものとする。

(2) バックアップ受託者の指定

- ・清算委託者は、自身が現に有価証券等清算取次ぎを行っている受託清算参加者が破綻した場合における自身のポジションの承継先として、あらかじめ他の清算参加者をバックアップ受託者として指定することができるものとする。

(3) 債務負担処理の見直し等

①債務負担

（備考）

金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書（以下「IRS業務方法書」という。）第12条の2、第27条の2、第27条の3、第27条の4及び第27条の5、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（以下「IRS業務方法書の取扱い」という。）第15条の2及び第22条の2
IRS業務方法書第45条の2、IRS業務方法書の取扱い第26条の2

<ul style="list-style-type: none"> ・現行の債務負担処理を見直し、債務負担の申込みが行われる都度、当該債務負担の申込みが行われた取引と債務負担済のポジションを合算したポジションについて証拠金を算出し、債務負担の申込みを行った清算参加者が当該証拠金の額以上の当初証拠金を預託している場合に、債務負担処理を行うこととする。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ I R S 業務方法書第 4 8 条及び第 4 9 条、 I R S 業務方法書の取扱い第 2 7 条、第 2 8 条及び別表 2
<p>②任意解約制度の導入等</p> <ul style="list-style-type: none"> ・清算約定を期限前終了させる任意解約の制度を導入するものとする。 ・清算約定を削減することを目的として一括コンプレッション制度を導入する。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ I R S 業務方法書第 5 3 条等 ・ I R S 業務方法書第 5 3 条の 2 等
<p>③有価証券等清算取次ぎの取扱い</p> <ul style="list-style-type: none"> ・クライアントの金利スワップ取引の有価証券等清算取次ぎを行う場合は、当該取引に係るクライアントの受託清算参加者の承諾を要するものとする。 ・クライアントの計算により成立している清算約定（委託分）について、任意解約及び一括コンプレッションを行おうとする場合においても、当該クライアントの受託清算参加者の承諾を要するものとする。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ I R S 業務方法書第 5 4 条の 2 及び第 5 5 条の 2 ・ I R S 業務方法書第 5 7 条の 2、 I R S 業務方法書の取扱い第 3 5 条の 2
<p>④清算約定（委託分）の承継等</p> <ul style="list-style-type: none"> ・清算委託者は、自身が有価証券等清算取次ぎの委託先として受託清算参加者から他の清算参加者へ、自身のポジションを承継させることを可能とする。 ・アフィリエイトは、他のアフィリエイト又は受託清算参加者へ自身のポジションを承継させることを可能とする。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ I R S 業務方法書第 5 8 条の 2 及び第 5 8 条の 3、 I R S 業務方法書の取扱い第 3 5 条の 3 及び第 3 5 条の 4 ・ I R S 業務方法書第 5 8 条の 4 及び第 5 8 条の 5
<p>(4) 清算参加者口座等</p> <ul style="list-style-type: none"> ・清算約定及び証拠金等の管理は、自己取引口座及び委託取引口座ごとに行うものとする。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ I R S 業務方法書第 5 9 条及び第 6 0 条
<p>(5) 証拠金の取扱い</p> <p>①当初証拠金の預託時限</p> <ul style="list-style-type: none"> ・当初証拠金の預託時限は、不足が生じた日（算出日）の翌当社営業日の午前 1 1 時とする。 <p>②変動証拠金等の預託時限</p> <ul style="list-style-type: none"> ・変動証拠金、変動証拠金に係る利息及び決済金額（以下「変動証拠金等」という。）の預託時限は、変動証拠金等の算出日の翌当社営業日の午前 1 1 時とする。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ I R S 業務方法書第 6 6 条 ・ I R S 業務方法書第 8 1 条

③当初証拠金及び決済金額等の差引計算

- ・清算参加者は、自己取引口座及び委託取引口座ごとに算出された決済金額、変動証拠金及び変動証拠金に係る利息について差引計算した額（以下「決済金額等」という。）と当初証拠金所要額について、当該自己取引口座及び委託取引口座毎に差引計算を行い、差引計算の結果算出された金額が負の数になる場合は、当該額を当社に預託するものとする。ただし、決済金額等の支払い方である清算参加者は、当該決済金額等に相当する額を現金により預託するものとする。
- ・決済金額等の受領方である清算参加者が決済金額等を受領する場合には、自己取引口座及び委託取引口座ごとに、受領する金銭の額を当社に対し申請を行うものとする。申請が行われなかった場合には、当該決済金額等は当初証拠金として預託したものとみなす。
- ・受託清算参加者及び清算委託者の間の決済金額等及び当初証拠金の授受についても、同様に差引計算のうえ授受するものとする。

・ I R S 業務方法書第 8 5 条の 2 及び第 8 5 条の 3、清算受託契約第 2 6 条の 2、第 2 6 条の 3 及び第 2 6 条の 4

④当初証拠金等に係る金銭の授受の方法

- ・金利スワップ清算基金、当初証拠金及び破綻時証拠金に係る金銭の授受を行う場合は、日本銀行金融ネットワークシステムを利用して行うものとする。

・ I R S 業務方法書の取扱い第 1 8 条

(6) 清算参加者の決済不履行時の措置

- ・クライアントは、受託清算参加者破綻時において、自身のポジションを他の清算参加者に承継させることができる。

・ I R S 業務方法書第 9 4 条

(7) その他

- ・想定元本が一定である取引に加え、取引開始時に想定元本の逡減又は逡増方法を定め、当該方法が取引期間中に変わらない取引についても債務負担の対象取引とする。
- ・清算委託者が破綻した場合に、受託清算参加者は当該清算委託者のポジションから生じる損失を回避することを目的とする取引を行うことを可能とする。
- ・受託清算参加者破綻時において当該受託清算参加者及び各清算委託者がそれぞれ負担する金額は、期限前終了手数料を当該各受託清算参加者及び清算委託者の当初証拠金所要額に応じて按分した額とする。
- ・クライアント・クリアリングに係る清算手数料として、クライアント・クリアリングに係る清算約定の想定元本に応じた手数料及び口座開設手数料を設定する。

・ I R S 業務方法書の取扱い第 9 条

・ 清算受託契約第 3 0 条

・ I R S 清算受託契約第 3 5 条

・ 金利スワップ取引清算業務に関する手数料に関する規則第 5 条の 2 及び第

<ul style="list-style-type: none"> ・その他、所要の改正を行うものとする。 	5条の3
<p>2. CDS清算業務に関する業務方法書等に関する改正概要</p>	
<p>(1) 証拠金の取扱い</p>	
<p>①当初証拠金の預託時限</p>	
<ul style="list-style-type: none"> ・当初証拠金の預託時限を、不足が生じた日（算出日）の翌当社営業日の午前11時とする。 	<ul style="list-style-type: none"> ・CDS清算業務に関する業務方法書第66条
<p>②変動証拠金等の預託時限</p>	
<ul style="list-style-type: none"> ・変動証拠金、変動証拠金に係る利息、任意解約手数料、固定金額、クレジットイベント発生時の固定金額及びクレジットイベント決済額（以下「変動証拠金等」という。）の預託時限を、算出日の翌当社営業日の午前11時とする。 ・当社は、変動証拠金等の受領方となる清算参加者に対し、変動証拠金等の算出日の翌当社営業日の午後1時30分以降遅滞なく支払うこととする。 	<ul style="list-style-type: none"> ・CDS清算業務に関する業務方法書第53条、第77条、CDS清算業務に関する業務方法書の取扱い第37条及び第55条
<p>③当初証拠金及び決済金額等の差引計算</p>	
<ul style="list-style-type: none"> ・清算参加者は、決済金額及び変動証拠金（以下「決済金額等」という。）と当初証拠金所要額について、自己取引口座及び委託取引口座毎に差引計算を行い、差引計算の結果、支払い方になる場合は、当該額を当社に預託するものとする。ただし、決済金額等の支払い方である清算参加者は、当該決済金額等に相当する額を現金により預託するものとする。 ・決済金額等の受領方である清算参加者が当該決済金額等を受領する場合には、自己取引口座及び委託取引口座ごとに、受領する金銭の額を当社に対し申請を行うものとする。申請が行われなかった場合には、当該決済金額等は当初証拠金として預託したものとみなす。 ・受託清算参加者及び清算委託者の間の決済金額等及び当初証拠金の授受についても、同様に差引計算のうえ授受するものとする。 	<ul style="list-style-type: none"> ・CDS清算業務に関する業務方法書第80条、第80条の2及び第80条の3、CDS清算業務に関する業務方法書の取扱い第52条、様式第3号CDS清算受託契約書第23条の2、第23条の3及び第23条の4
<p>④当初証拠金等に係る金銭の授受の方法</p>	
<ul style="list-style-type: none"> ・CDS清算基金、当初証拠金及び破綻時証拠金に係る金銭の授受を行う場合は、日本銀行金融ネットワークシステムを利用して行うものとする。 	<ul style="list-style-type: none"> ・CDS清算業務に関する業務方法書の取扱い第22条
<p>(2) その他</p>	

- ・その他所要の改正を行うこととする。

Ⅲ. 施行日

平成26年2月24日から施行する。

以 上

金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書等の一部改正新旧対照表

目 次

1. 金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の一部改正新旧対照表
2. 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の一部改正新旧対照表
3. 金利スワップ取引清算業務に関する手数料に関する規則の一部改正新旧対照表
4. 金利スワップ清算基金所要額に関する規則の一部改正新旧対照表
5. 金利スワップ清算参加者の破綻処理に関する規則の一部改正新旧対照表

金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の一部改正新旧対照表

新	旧
<p>(定義)</p> <p>第2条 本業務方法書等において使用する用語は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）及びISDA定義集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。</p> <p>(1) 「委託当初証拠金」とは、受託清算参加者が、清算委託者の同意を得て、清算委託者から交付を受けた金銭又は<u>代用有価証券</u>を第61条第1項第2号に掲げる当該清算委託者の債務を担保する目的で自ら保管する場合における当該金銭又は<u>代用有価証券</u>をいう。</p> <p>(2) (略)</p> <p><u>(2)の2 「一括コンプレッション」とは、第53条の2の規定に基づき、清算参加者が清算約定を削減することを目的として、当社が定める方法により、清算約定を任意解約させるとともに新たな清算約定を成立させることをいう。</u></p> <p>(3)～(5) (略)</p> <p>(6) 「期限前終了」とは、<u>任意解約</u>以外の事由により清算約定がその終了日前に終了することをいう。</p> <p>(7)～(13) (略)</p> <p><u>(13)の2 「クライアント・クリアリング」とは、受託清算参加者と同一の企業集団に含まれる者以外の清算委託者からの委託に基づく有価証券等清算取次ぎをいう。</u></p> <p>(14) 「決済金額」とは、清算約定に関し、当社及び清算参加者の間で授受される金銭（金利スワップ清算基金、<u>当初証拠金、変動証拠金及び変動証拠金に係る利息</u>として授受</p>	<p>(定義)</p> <p>第2条 本業務方法書等において使用する用語は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）及びISDA定義集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。</p> <p>(1) 「委託当初証拠金」とは、受託清算参加者が、清算委託者の同意を得て、清算委託者から交付を受けた金銭又は<u>有価証券</u>を第61条第1項第2号に掲げる当該清算委託者の債務を担保する目的で自ら保管する場合における当該金銭又は<u>有価証券</u>をいう。</p> <p>(2) (略)</p> <p>(新設)</p> <p>(3)～(5) (略)</p> <p>(6) 「期限前終了」とは、<u>デクリアー</u>以外の事由により清算約定がその終了日前に終了することをいう。</p> <p>(7)～(13) (略)</p> <p>(新設)</p> <p>(14) 「決済金額」とは、清算約定に関し、当社及び清算参加者の間で授受される金銭（金利スワップ清算基金及び当初証拠金として授受される金銭を含まない。）の額（当該</p>

される金銭を含まない。)の額(当該金銭のうち第85条第2項の規定により差引計算されるものについては、その差引計算後の額)をいう。

(15)～(24) (略)

(24)の2 「承継」とは、本業務方法書等の規定により、当社、承継清算参加者及び清算委託者の間で清算約定(委託分)及び清算委託取引に係る権利義務を新たに発生させるとともに、それに伴う金銭の授受及び権利義務の処理を行うことをいう。

(24)の3 「承継清算参加者」とは、承継により発生する権利義務の当事者となる清算参加者をいう。

(25)～(47) (略)

(48) 削除

(49)～(54) (略)

(54)の2 「任意解約」とは、清算約定及びその反対清算約定を、当社並びに当該清算約定及びその反対清算約定の当事者である清算参加者の間の合意をもって、その終了日前に終了させることをいう。

(54)の3 「任意解約手数料」とは、清算

金銭のうち第85条第2項の規定により差引計算されるものについては、その差引計算後の額)をいう。

(15)～(24) (略)

(新設)

(新設)

(25)～(47) (略)

(48) 「デクリアー」とは、第53条の規定に基づき、清算約定及びその反対清算約定を、当社並びに当該清算約定及びその反対清算約定の当事者である清算参加者の間の合意をもって、その終了日前に終了させると同時に、金利スワップ取引を当該清算約定及びその反対清算約定の当事者である清算参加者間(当該清算約定又は当該反対清算約定のいずれか又はその両方が有価証券等清算取次ぎの委託に基づくものであるときは、当該有価証券等清算取次ぎの基となった清算取次原取引の当事者である清算委託者及び清算参加者又は他の清算委託者の間)で成立させることをいう。

(49)～(54) (略)

(新設)

(新設)

約定が任意解約された場合において、当該清算約定の当事者間で授受される、当該清算約定及びその反対清算約定の当事者である清算参加者の間であらかじめ合意された額の金銭をいう。

(54) の4 「ノンヘッジ口座」とは、第59条第7項の規定によりノンヘッジ口座として届出を受けた委託取引口座の種別をいう。

(55) ～ (60) (略)

(60) の2 「バックアップ受託者」とは、清算委託者に対し現に有価証券等清算取次ぎを行っている受託清算参加者について破綻等が認定された場合に、当該清算委託者の計算において成立している清算約定（委託分）及び清算委託取引に係る権利義務を承継する先として、第45条の2に定めるところによりあらかじめ当該清算委託者から指定を受けている受託清算参加者（第12条の2に規定する承認を受けた清算参加者に限る。）をいう。

(61) ・ (62) (略)

(62) の2 「ヘッジ口座」とは、第59条第7項の規定によりヘッジ口座として届出を受けた委託取引口座の種別をいう。

(63) (略)

(63) の2 「変動証拠金等」とは、変動証拠金、変動証拠金に係る利息、決済金額その他清算約定に基づいて授受する金銭をいう。

(64) ～ (72) (略)

2・3 (略)

(金利スワップ清算資格の要件)

第9条 承認審査は、取得申請者に関する次に掲げる事項その他当社による金利スワップ取引清算業務の適切な遂行を確保する観点から必要と認める事項について、当社が通知又は公示により審査上の観点及び確認事項として定めるとこ

(新設)

(55) ～ (60) (略)

(新設)

(61) ・ (62) (略)

(新設)

(63) (略)

(新設)

(64)) ～ (72) (略)

2・3 (略)

(金利スワップ清算資格の要件)

第9条 承認審査は、取得申請者に関する次に掲げる事項その他当社による金利スワップ取引清算業務の適切な遂行を確保する観点から必要と認める事項について行うものとする。

<p>ろにより行うものとする。</p> <p>(1)～(3) (略)</p> <p>2 (略)</p>	<p>(1)～(3) (略)</p> <p>2 (略)</p>
<p><u>第2節 クライアント・クリアリングの取扱いの承認</u></p>	<p>(新設)</p>
<p>(クライアント・クリアリングの取扱いの承認)</p>	
<p><u>第12条の2 清算参加者（取得申請者を含む。</u> <u>以下本条において同じ。）は、クライアント・</u> <u>クリアリングの取扱いを行おうとする場合に</u> <u>は、あらかじめ、当社が定めるところにより、</u> <u>当社にクライアント・クリアリングの取扱いに</u> <u>係る申請を行い、当社の承認を受けなければな</u> <u>らない。</u></p> <p>2 <u>当社は、前項の申請を受けた場合において、</u> <u>前項の申請を行った清算参加者のクライアン</u> <u>ト・クリアリングに係る清算約定の決済、損失</u> <u>の危険の管理及び利益相反の防止について当社</u> <u>が通知又は公示により確認上の観点及び確認事</u> <u>項として定めるところにより確認を行い、適切</u> <u>な業務執行体制を備えていると認めるときは、</u> <u>クライアント・クリアリングの取扱いの承認を</u> <u>行う。</u></p> <p>3 <u>当社は、前項の承認を行った場合には、速やかに</u> <u>その旨を他の清算参加者に通知し、かつ公表する。</u></p>	
<p><u>第3節 (略)</u></p>	<p><u>第2節 (略)</u></p>
<p><u>第4節 (略)</u></p> <p>(金利スワップ清算資格の喪失)</p> <p>第23条 清算参加者が前条第1項の規定により金利スワップ清算資格の喪失の申請をした場合、当該清算参加者は、その申請の日の翌日から起算して30日目の日の当社が定める時点又</p>	<p><u>第3節 (略)</u></p> <p>(金利スワップ清算資格の喪失)</p> <p>第23条 清算参加者が前条第1項の規定により金利スワップ清算資格の喪失の申請をした場合、当該清算参加者は、その申請の日の翌日から起算して30日目の日の当社が定める時点又</p>

は当該清算参加者を当事者とする清算約定で未決済のもののすべてが解消された時点のいずれか遅い時点（当該申請が破綻処理単位期間中に行われた場合又は当該申請の日から当該清算参加者について金利スワップ清算資格の喪失の効力が生じるまでの間に破綻処理単位期間が開始した場合には、破綻処理単位期間が終了する日の当社が定める時点又は当該清算参加者を当事者とする清算約定で未決済のもののすべてが解消された時点のいずれか遅い時点）において、金利スワップ清算資格を喪失する。

2 （略）

（金利スワップ清算資格の喪失申請者の合併等の場合の特例）

第24条 金利スワップ清算資格の喪失申請者が金利スワップ清算資格の喪失と同時に、金利スワップ清算資格を取得する者又は金利スワップ清算資格を有する者に合併され、分割により事業を承継させ又は事業を譲渡する等の場合において、当該清算参加者の清算約定で未決済のもののすべてを解消させる必要がないと当社が認めるとき（受託清算参加者にあつては、当該受託清算参加者が締結している清算受託契約のすべてを解約させる必要がないと当社が認めるときを含む。）は、前条第1項の規定にかかわらず、当該喪失申請者は、当社がその都度定める時点において、金利スワップ清算資格を喪失する。

第5節 クライアント・クリアリングの取扱いの廃止

（クライアント・クリアリングの取扱いの承認の取消申請）

第27条の2 清算参加者は、クライアント・ク

は当該清算参加者を当事者とするすべての清算約定が解消された時点のいずれか遅い時点（当該申請が破綻処理単位期間中に行われた場合又は当該申請の日から当該清算参加者について金利スワップ清算資格の喪失の効力が生じるまでの間に破綻処理単位期間が開始した場合には、破綻処理単位期間が終了する日の当社が定める時点又は当該清算参加者を当事者とするすべての清算約定が解消された時点のいずれか遅い時点）において、金利スワップ清算資格を喪失する。

2 （略）

（金利スワップ清算資格の喪失申請者の合併等の場合の特例）

第24条 金利スワップ清算資格の喪失申請者が金利スワップ清算資格の喪失と同時に、金利スワップ清算資格を取得する者又は金利スワップ清算資格を有する者に合併され、分割により事業を承継させ又は事業を譲渡する等の場合において、当該清算参加者の清算約定のすべてを解消させる必要がないと当社が認めるとき（受託清算参加者にあつては、当該受託清算参加者が締結している清算受託契約のすべてを解約させる必要がないと当社が認めるときを含む。）は、前条第1項の規定にかかわらず、当該喪失申請者は、当社がその都度定める時点において、金利スワップ清算資格を喪失する。

（新設）

リアリングの取扱いを廃止しようとするときは、当社が定めるところにより、クライアント・クリアリングの取扱いの承認の取消しの申請をしなければならない。

(クライアント・クリアリングの取扱いの承認の取消申請者の未決済約定の取扱い)

第27条の3 清算参加者は、クライアント・クリアリングの取扱いの承認の取消しの申請を行う場合には、あらかじめ、第4章第4節の規定による清算約定（委託分）の承継その他の方法により清算約定（委託分）で未決済のものをすべて解消するとともに、清算受託契約をすべて解約しなければならない。

(クライアント・クリアリングの取扱いの承認の取消申請者の合併等の場合の特例)

第27条の4 清算参加者は、前条の場合において、クライアント・クリアリングの取扱いの承認の取消しと同時に、クライアント・クリアリングの取扱いの承認を受ける者又はクライアント・クリアリングの取扱いの承認を受けている者に合併され、分割により事業を承継させ又は事業を譲渡する等の場合で、清算約定（委託分）で未決済のものすべてを解消させ、又は当該清算参加者が締結している清算受託契約のすべてを解約させる必要がないと当社が認めるときは、同条の規定にかかわらず、当社が認める範囲において、当該清算約定で未決済のものを解消し、又は当該清算受託契約を解約しないことができる。

(クライアント・クリアリングの取扱いの承認の取消し)

第27条の5 当社は、クライアント・クリアリングの取扱いの承認の取消しを承認した場合は、速やかにその旨を他の清算参加者に通知し、かつ公

表する。

第6節 (略)

(清算参加者に対する措置)

第28条 当社は、清算参加者（当該清算参加者がその親会社等から親会社等保証を受けている場合には、当該清算参加者又は当該親会社等）が次に掲げるいずれかの事由に該当することとなった場合において、当該事由の原因、再発生の可能性、当社の金利スワップ取引清算業務に及ぼし得る影響の程度その他の事情を勘案し、金利スワップ取引清算業務の適正かつ確実な遂行のため必要と認めるときは、当該清算参加者を審問のうえ、理由を示して、その必要な限度において、改善指示（当社の金利スワップ取引清算業務の運営上必要かつ適当と認められる限度において、当該清算参加者に対して行う業務執行体制等の改善に係る指示をいう。以下同じ。）、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引について新たな債務負担の全部若しくは一部の停止、当該清算参加者の金利スワップ清算資格の取消し又はクライアント・クリアリングの取扱いの承認の取消しの措置を行うことができる。この場合において、金利スワップ清算資格の取消しの措置を行うときは、取締役会による決議を要するものとする。

(1)～(3) (略)

2～7 (略)

(ポジション保有状況の改善指示)

第30条 (略)

2 前項に規定するポジション保有状況の改善指示を受けた清算参加者は、当社がその都度指定する日までに、当該指示を受けた事由を解消することを目的として、当該清算参加者の清算約

第4節 (略)

(清算参加者に対する措置)

第28条 当社は、清算参加者（当該清算参加者がその親会社等から親会社等保証を受けている場合には、当該清算参加者又は当該親会社等）が次に掲げるいずれかの事由に該当することとなった場合において、当該事由の原因、再発生の可能性、当社の金利スワップ取引清算業務に及ぼし得る影響の程度その他の事情を勘案し、金利スワップ取引清算業務の適正かつ確実な遂行のため必要と認めるときは、当該清算参加者を審問のうえ、理由を示して、その必要な限度において、改善指示（当社の金利スワップ取引清算業務の運営上必要かつ適当と認められる限度において、当該清算参加者に対して行う業務執行体制等の改善に係る指示をいう。以下同じ。）、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引について新たな債務負担の全部若しくは一部の停止又は当該清算参加者の金利スワップ清算資格の取消しの措置を行うことができる。この場合において、金利スワップ清算資格の取消しの措置を行うときは、取締役会による決議を要するものとする。

(1)～(3) (略)

2～7 (略)

(ポジション保有状況の改善指示)

第30条 (略)

2 前項に規定するポジション保有状況の改善指示を受けた清算参加者は、当社がその都度指定する日までに、当該指示を受けた事由を解消することを目的として、当該清算参加者の清算約

<p>定の<u>任意解約</u>その他具体的な措置を講じなければならぬ。</p>	<p>定の<u>デクリアー</u>その他具体的な措置を講じなければならぬ。</p>
<p>3 (略)</p>	<p>3 (略)</p>
<p>(信用状況に応じた清算参加者に対する当初証拠金の割増措置)</p>	<p>(信用状況に応じた清算参加者に対する当初証拠金の割増措置)</p>
<p>第32条 当社は、次の各号に掲げる場合に応じて、清算参加者が当該各号のいずれかの事由に該当することとなったと認める場合には、当該清算参加者に対し、当社の定めるところにより<u>清算約定(自己分)</u>に係る当初証拠金所要額の引上げの措置を行うことができる。</p>	<p>第32条 当社は、次の各号に掲げる場合に応じて、清算参加者が当該各号のいずれかの事由に該当することとなったと認める場合には、当該清算参加者に対し、当社の定めるところにより当初証拠金所要額の引上げの措置を行うことができる。</p>
<p>(1)・(2) (略)</p>	<p>(1)・(2) (略)</p>
<p>2 <u>前項の規定は清算約定(委託分)に係る当初証拠金所要額について準用する。この場合において、当初証拠金所要額の引上げの措置は、清算委託者がバックアップ受託者を指定しているときには、当該清算委託者の清算約定(委託分)に係る当初証拠金について、対象としないこととする。ただし、当該バックアップ受託者(清算委託者が複数のバックアップ受託者を指定しているときには、当該バックアップ受託者のすべて)が前項の規定による当初証拠金所要額の引上げの措置を受けている場合は、この限りでない。</u></p>	<p>(新設)</p>
<p>(金利スワップ清算資格を喪失した場合における清算約定の取扱い)</p>	<p>(金利スワップ清算資格を喪失した場合における清算約定の取扱い)</p>
<p>第38条 清算参加者は、金利スワップ清算資格を取り消された場合には、当社がその都度定める期間内に、当該清算参加者の<u>清算約定で未決済のものすべて</u>を解消しなければならない。</p>	<p>第38条 清算参加者は、金利スワップ清算資格を取り消された場合には、当社がその都度定める期間内に、当該清算参加者の<u>すべての清算約定</u>を解消しなければならない。</p>
<p>2 前項の場合において、同項の清算参加者が同項に規定する期間内に<u>清算約定で未決済のものすべて</u>を解消することができないときは、当該清算約定は、第9章第2節の規定(第96条</p>	<p>2 前項の場合において、同項の清算参加者が同項に規定する期間内に<u>すべての清算約定</u>を解消することができないときは、当該清算約定は、第9章第2節の規定(第96条から第98条ま</p>

<p>から第98条までの規定を除く。)に準じて処理されるものとする。この場合において、必要な事項は当社がその都度定める。</p>	<p>での規定を除く。)に準じて処理されるものとする。この場合において、必要な事項は当社がその都度定める。</p>
<p>第7節 (略)</p>	<p>第5節 (略)</p>
<p>(登録金融機関の登録を受けた支店を有する外国法人の取扱い)</p>	<p>(登録金融機関の登録を受けた支店を有する外国法人の取扱い)</p>
<p>第41条 金融商品取引法第33条の2の登録を受けた支店を有する外国法人は、これを<u>登録金融機関</u>とみなして本章の規定を適用する。</p>	<p>第41条 金融商品取引法第33条の2の登録を受けた支店を有する外国法人は、これを<u>登録金融機関</u>とみなして本章の規定を適用する。</p>
<p>(バックアップ受託者の指定等)</p>	
<p>第45条の2 <u>清算委託者は、当該清算委託者に対し現に有価証券等清算取次ぎを行っている受託清算参加者について破綻等が認定された場合において、当該清算委託者の計算により成立している清算約定(委託分)及び清算委託取引に係る権利義務を円滑に他の一又は二以上の受託清算参加者へ承継させる目的で、あらかじめ他の受託清算参加者(当該清算委託者に対し現に有価証券等清算取次ぎを行っている受託清算参加者(破綻等が認定された受託清算参加者を除く。))を含む。)をバックアップ受託者として指定することができる。</u></p>	<p>(新設)</p>
<p>2 <u>前項の指定(以下「バックアップ受託者の指定」という。)を行おうとする清算委託者及び当該バックアップ受託者の指定を受けようとする受託清算参加者は、当該清算委託者に対し現に有価証券等清算取次ぎを行っている受託清算参加者について破綻等が認定された場合に、第94条の規定に基づき当該清算委託者の計算により成立している清算約定(委託分)及び清算委託取引の全部又は一部に対応する権利義務を一括して当該他の受託清算参加者に承継させることについて、あらかじめ合意するものとする。</u></p>	

3 第1項に規定するバックアップ受託者の指定に係る届出は、当該指定を行おうとする清算委託者が当該指定を受ける受託清算参加者を通じて、当社所定の届出書に当社が必要と認める書類を添付して、当社に対して提出することで行うものとする。

4 バックアップ受託者は、清算委託者との承継に係る合意に関し、当社の定めるところにより当社に対して報告するものとする。

5 第1項の規定により指定を行った清算委託者及びバックアップ受託者は、清算委託者が現に有価証券等清算取次ぎの委託を行っている受託清算参加者について破綻等の認定が行われた場合に、清算委託者とバックアップ受託者が合意するところに従い、円滑に清算約定（委託分）及び清算委託取引を承継させることが可能となるよう、当社の定めるところにより事前の体制整備に努めるものとする。

6 バックアップ受託者の指定を取り消そうとするバックアップ受託者は、当該指定の取消しについて当該指定を行った清算委託者と合意のうえ、当社所定の申請書を当社に対して届け出るものとする。

(清算約定の区分管理)

第47条 (略)

2 受託清算参加者は、清算約定（委託分）を、清算取次口座ごとに区分して管理しなければならない。

(債務負担等の申込み)

第48条 清算参加者は、当社に対して、当社が定める方法で通知することにより、債務負担の申込みをすることができる。当社は、当該通知を、当社が定めるところにより受領する。

2・3 (略)

(清算約定の区分管理)

第47条 (略)

2 受託清算参加者は、清算約定（委託分）を、清算委託者ごとに区分して管理しなければならない。

(債務負担等の申込み)

第48条 清算参加者は、当社に対して、当社が定める方法で通知することにより、債務負担の申込みをすることができる。

2・3 (略)

4 清算参加者が清算取次原取引の相手方である場合において行う第1項の債務負担の申込みに係る通知は、第54条第4項各号（第54条の2第1項において準用する場合を含む。）に掲げる条件を満たすことを停止条件として、当該清算取次原取引を合意解約する旨の当該清算取次原取引の当事者である清算委託者に対する意思表示とみなす。

5 (略)

(債務負担による清算約定の成立)

第49条 当社は、適格金利スワップ取引の両当事者である清算参加者から前条第1項の申込みに係る通知を受領した場合には、その内容及び当該適格金利スワップ取引が当社の定める条件を満たすこと並びに当該清算参加者が当社の定める方法により算出する証拠金（以下「債務負担時所要証拠金」という。）を当社に預託又は交付していること（以下これらの事項を「債務負担要件」という。）を当社が定めるところにより確認するものとし、当社が債務負担要件の充足を確認することができた場合には、当社が定める時点をもって、債務負担の対象となった適格金利スワップ取引の一方の当事者であった清算参加者（以下本条において「清算参加者X」という。）と当社との間に、当社の取引ポジションを当該適格金利スワップ取引において清算参加者Xの相手方当事者であった清算参加者（以下本条において「清算参加者Y」という。）と同一とする金利スワップ取引が成立し、清算参加者Yと当社との間に、当社の取引ポジションを清算参加者Xと同一とする金利スワップ取引が成立する。

2 当社は、前項の規定により清算約定が成立した場合には、当該清算約定の相手方となる清算参加者にその旨を、当社の定めるところにより

4 清算参加者が清算取次原取引の相手方である場合において行う第1項の債務負担の申込みに係る通知は、第54条第4項各号に掲げる条件を満たすことを停止条件として、当該清算取次原取引を合意解約する旨の当該清算取次原取引の当事者である清算委託者に対する意思表示とみなす。

5 (略)

(債務負担による清算約定の成立)

第49条 当社は、適格金利スワップ取引の両当事者である清算参加者から前条第1項の申込みに係る通知を受領した場合には、その内容及び当該適格金利スワップ取引が当社の定める条件を満たすこと並びにすべての清算参加者が当社の定める証拠金等（以下「債務負担時所要証拠金等」という。）を当社に預託又は交付していること（以下これらの事項を「債務負担要件」という。）を当社が定めるところにより確認するものとし、当社が債務負担要件の充足を確認することができた場合には、当社が定める時点をもって、債務負担の対象となった適格金利スワップ取引の一方の当事者であった清算参加者（以下本条において「清算参加者X」という。）と当社との間に、当社の取引ポジションを当該適格金利スワップ取引において清算参加者Xの相手方当事者であった清算参加者（以下本条において「清算参加者Y」という。）と同一とする金利スワップ取引が成立し、清算参加者Yと当社との間に、当社の取引ポジションを清算参加者Xと同一とする金利スワップ取引が成立する。

2 当社は、前項の規定により清算約定が成立した場合には、当該清算約定の相手方となる清算参加者にその旨を速やかに通知するものとす

速やかに通知するものとする。

3 第1項の場合において、当社が債務負担の申込みに係る通知を受領した時点で債務負担の申込みを行っている両当事者の清算参加者から債務負担時所要証拠金の預託又は交付を受けていることを確認することができない場合には、当社は、当該申込みについて、債務負担を行わないものとし、その旨を当該清算参加者に対して当社の定めるところにより速やかに通知するものとする。

4 当社は、清算参加者の破綻等を認定した場合等において、金利スワップ取引清算業務の円滑な遂行のため特に必要があると認めるときは、第1項の規定にかかわらず、債務負担の申込みに係る通知を受領する時間を臨時に変更することができる。この場合において、当社は、次に掲げる事項をあらかじめ清算参加者に通知するものとする。

(1) 本項の規定により債務負担の申込みに係る通知を受領する時間を臨時に変更する旨

(2) 変更後の当社が債務負担の申込みに係る通知を受領する時間

(削る)

5 (略)

(清算約定の任意解約)

第53条 清算参加者は、清算約定について任意解約を行おうとする場合には、当社に対し、当社が定める方法によりその旨の申込みをするものとする。

2 当社は、前項の規定により清算参加者から清算約定の任意解約の申込みを受けた場合において、当該清算約定の反対清算約定の当事者であ

る。

3 第1項の場合において、当社が、当社が定める時点ですべての清算参加者から債務負担時所要証拠金等の預託又は交付を受けていることを確認することができない場合には、当社は、その時点におけるすべての前条第1項に規定する申込みについて、債務負担を行わないものとする。

4 当社は、清算参加者の破綻等を認定した場合等において、金利スワップ取引清算業務の円滑な遂行のため特に必要があると認めるときは、第1項の規定にかかわらず、債務負担要件の確認を臨時に行うことができる。この場合において、当社は、次に掲げる事項をあらかじめ清算参加者に通知するものとする。

(1) 本項の規定により債務負担要件の確認を臨時に行う旨

(2) 前号の確認までに各清算参加者が当社に預託又は交付すべき債務負担時所要証拠金等の内容及び額

(3) すべての清算参加者が前号の債務負担時所要証拠金等を当社に預託又は交付すべき時限

5 (略)

(清算約定のデクリアー)

第53条 清算参加者は、清算約定についてデクリアーを行おうとする場合には、当社に対し、当社が定める方法によりその旨の申込みをするものとする。

2 当社は、前項の規定により清算参加者から清算約定のデクリアーの申込みを受けた場合において、当該清算約定の反対清算約定の当事者で

る他の清算参加者から、当該反対清算約定の任意解約の申込みを受けたときは、当該清算約定及び当該反対清算約定が当社の定める条件を満たすこと及びすべての清算参加者が当初証拠金及び変動証拠金等について当社に預託又は交付していること（以下これらの事項を「任意解約要件」という。）を当社が定めるところにより確認するものとし、当社が任意解約要件の充足を確認することができた場合には、当該確認を行った時点をもって、当社、当該清算参加者及び当該他の清算参加者は、当該清算約定及び当該反対清算約定を終了させる。

3 前項の場合において、当社が、当社が定める時点で任意解約要件の充足を確認することができない場合には、その時点におけるすべての任意解約の申込みについて、任意解約を行わないものとする。

4 当社は、清算参加者の破綻等を認定した場合等において、金利スワップ取引清算業務の円滑な遂行のため特に必要があると認めるときは、任意解約要件の確認を臨時に行うことができる。この場合において、当社は、次に掲げる事項をあらかじめ清算参加者に通知するものとする。

(1) 本項の規定により任意解約要件の確認を臨時に行う旨

(2) 前号の確認までに各清算参加者が当社

ある他の清算参加者から、当該反対清算約定のデクリアーの申込みを受けたときは、当該清算約定及び当該反対清算約定が当社の定める条件を満たすこと及びすべての清算参加者が債務負担時所要証拠金等を当社に預託又は交付していること（以下これらの事項を「デクリアー要件」という。）を当社が定めるところにより確認するものとし、当社がデクリアー要件の充足を確認することができた場合には、当社が定める時点をもって、当社、当該清算参加者及び当該他の清算参加者は、当該清算約定及び当該反対清算約定を終了させる。この場合、当該清算約定及び当該反対清算約定の終了と同時に、当該清算約定及び当該反対清算約定の当事者である清算参加者間（当該清算約定又は当該反対清算約定のいずれか又はその両方が有価証券等清算取次ぎの委託に基づくものであるときは、当該有価証券等清算取次ぎの基となった清算取次原取引の当事者である清算委託者及び清算参加者又は他の清算委託者の間）において、当社が定める内容の金利スワップ取引が成立する。

3 前項の場合において、当社が、当社が定める時点でデクリアー要件の充足を確認することができない場合には、その時点におけるすべてのデクリアーの申込みについて、デクリアーを行わないものとする。

4 当社は、清算参加者の破綻等を認定した場合等において、金利スワップ取引清算業務の円滑な遂行のため特に必要があると認めるときは、デクリアー要件の確認を臨時に行うことができる。この場合において、当社は、次に掲げる事項をあらかじめ清算参加者に通知するものとする。

(1) 本項の規定によりデクリアー要件の確認を臨時に行う旨

(2) 前号の確認までに各清算参加者が当社

<p>に預託又は交付すべき<u>当初証拠金及び変動証拠金等</u>の内容及び額</p> <p>(3) すべての清算参加者が前号の<u>当初証拠金及び変動証拠金等</u>を当社に預託又は交付すべき時限</p>	<p>に預託又は交付すべき<u>債務負担時所要証拠金等</u>の内容及び額</p> <p>(3) すべての清算参加者が前号の<u>債務負担時所要証拠金等</u>を当社に預託又は交付すべき時限</p>
<p>5 <u>清算参加者は、当社が第2項に規定する任意解約要件の充足を確認した場合、同項に規定する清算参加者と他の清算参加者が別に合意する日において、任意解約に係る任意解約手数料の授受を行う。</u></p>	<p>(新設)</p>
<p>6 前各項に規定するほか、清算約定の<u>任意解約</u>に必要な事項は、当社が定める。</p> <p>(清算約定の一括コンプレッション)</p>	<p>5 前各項に規定するほか、清算約定の<u>デクリア</u>に必要な事項は、当社が定める。</p>
<p>第53条の2 <u>清算参加者は、清算約定について一括コンプレッションを行おうとする場合には、当社が定めるところによりその旨の申込みをするものとする。</u></p>	<p>(新設)</p>
<p>2 <u>当社は、前項の規定により清算参加者から清算約定の一括コンプレッションの申込みを受けた場合において、当該清算約定の反対清算約定の当事者である他の清算参加者から、当該反対清算約定の一括コンプレッションの申込みを受けたときは、当該清算約定及び当該反対清算約定並びに一括コンプレッションにより新たに成立する清算約定が当社の定める条件を満たすこと及びすべての清算参加者が一括コンプレッションが成立したと仮定して算出する日中証拠金所要額について当社に預託又は交付していること（以下これらの事項を「一括コンプレッション成立要件」という。）を当社が定めるところにより確認するものとし、当社が一括コンプレッション成立要件の充足を確認することができた場合には、当社が当該確認を行った時点をもって、当社、当該清算参加者及び当該他の清算参加者は、当該清算約定及び当該反対清算約定</u></p>	

を終了させ、当該一括コンプレッションの申込みの内容に従い新たな清算約定を成立させる。

3 前項の場合において、当社が、当社が定める時点で一括コンプレッション成立要件の充足を確認することができない場合には、その時点におけるすべての一括コンプレッションの申込みについて、一括コンプレッションを行わないものとする。

4 第48条第1項の規定にかかわらず、当社は、一括コンプレッションの申込みが行われる日の当社が定める時間において、債務負担の申込みに係る通知を受領しない。

5 第2項の規定により終了した清算約定及び当該清算約定の反対清算約定に係る当事者は、当社が定めるところにより任意解約手数料として金銭を授受するものとする。

6 前各項に規定するほか、清算約定の一括コンプレッションに必要な事項は、当社が定める。

(受託清算参加者と同一の企業集団に含まれる清算委託者が行う有価証券等清算取次ぎの委託)

第54条 清算委託者(受託清算参加者と同一の企業集団に含まれる者に限る。以下本条において同じ。)は、受託清算参加者に対して有価証券等清算取次ぎの委託をしようとする場合には、当社が定めるところにより、有価証券等清算取次ぎの委託によって受託清算参加者を一方の当事者として成立することとなる金利スワップ取引における相手方の清算参加者(以下「指定相手方」という。)その他当社が定める事項を当社に通知するものとする。

2～5 (略)

(受託清算参加者と同一の企業集団に含まれない清算委託者が行う有価証券等清算取次ぎの委託)

第54条の2 前条各項の規定は、受託清算参加

(有価証券等清算取次ぎの委託)

第54条 清算委託者は、受託清算参加者に対して有価証券等清算取次ぎの委託をしようとする場合には、当社が定めるところにより、有価証券等清算取次ぎの委託によって受託清算参加者を一方の当事者として成立することとなる金利スワップ取引における相手方の清算参加者(以下「指定相手方」という。)その他当社が定める事項を当社に通知するものとする。

2～5 (略)

(新設)

者と同一の企業集団に含まれない清算委託者が、受託清算参加者に有価証券等清算取次ぎの委託をしようとする場合に準用する。この場合において、前条第2項中「清算委託者が受託清算参加者に対し同項の金利スワップ取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託を申込み、受託清算参加者がこれを承諾したものとみなされること」とあるのは「清算委託者が受託清算参加者に対し同項の金利スワップ取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託の申込みを行ったものとみなされること」と、前条第4項柱書中「当該通知により成立したものとみなされる有価証券等清算取次ぎの委託」とあるのは「当該通知により申込みを行ったものとみなされる有価証券等清算取次ぎの委託」と、前条第4項第1号中「第2項の規定により成立したものとみなされる清算委託者の受託清算参加者に対する有価証券等清算取次ぎの委託」とあるのは「第2項の規定により申込みを行ったものとみなされる清算委託者の受託清算参加者に対する有価証券等清算取次ぎの委託」と読み替えるものとする。

2 当社は、前項の規定により準用する前条第1項に規定する通知を受領した場合は、当該通知のうち当社が定める内容について受託清算参加者に通知する。

3 前項に規定する通知を受領した受託清算参加者は、当該通知に係る金利スワップ取引の有価証券等清算取次ぎの委託の申込みに対する諾否について、当社に対して通知することとする。

(受託清算参加者と同一の企業集団に含まれる清算委託者が行う有価証券等清算取次ぎの委託に基づく清算約定の成立)

第55条 (略)

2～6 (略)

(有価証券等清算取次ぎの委託に基づく清算約定の成立)

第55条 (略)

2～6 (略)

(受託清算参加者と同一の企業集団に含まれない清算委託者が行う有価証券等清算取次ぎの委託に基づく清算約定の成立)

第55条の2 前条各項の規定は、第54条の2の規定において準用する第54条第1項に規定する通知が当社に到達した場合に準用する。この場合において、前条第1項中「第54条第1項の通知が当社に到達した場合において、同条第2項の規定により有価証券等清算取次ぎの申込み及び承諾があったものとみなされるとき」とあるのは「第54条の2第3項の規定により有価証券等清算取次ぎの委託の申込みに対して承諾する旨を、当社に対して通知したとき」と読み替えるものとする。

(新設)

(受託清算参加者と同一の企業集団に含まれる清算委託者が行う清算約定(委託分)に関する任意解約又は一括コンプレッションの申込み)

(清算約定(委託分)に関するデクリアーの申込み)

第57条 清算委託者(受託清算参加者と同一の企業集団に含まれる者に限る。以下、本条において同じ。)は、受託清算参加者に対して任意解約の申込みの指図をしようとする場合には、当社が定める方法により、その旨を当社に通知するものとする。

第57条 清算委託者は、本業務方法書等及び清算受託契約の定めるところにより、受託清算参加者を代理して、清算約定(委託分)に関するデクリアーの申込みを自ら行うものとする。

2 清算委託者は、受託清算参加者に対して一括コンプレッションの申込みの指図をしようとする場合には、当社が定める方法により、その旨を当社に通知するものとする。

(新設)

3 受託清算参加者及び清算委託者は、前2項の通知が当社に到達した場合には、その時点で、清算委託者が受託清算参加者に対し任意解約又は一括コンプレッションの申込みの指図を行い、受託清算参加者がこれを承諾し申込みを行ったものとみなされることについてあらかじめ同意する。

(新設)

(受託清算参加者と同一の企業集団に含まれない清算委託者が行う清算約定(委託分)に関する任意解約又は一括コンプレッションの申込み)

第57条の2 前条各項の規定は、受託清算参加

(新設)

者と同一の企業集団に含まれない清算委託者が、受託清算参加者に対して、任意解約又は一括コンプレッションの申込みの指図を行おうとする場合に準用する。この場合において、前条第3項中「清算委託者が受託清算参加者に対し任意解約又は一括コンプレッションの申込みの指図を行い、受託清算参加者がこれを承諾し申込みを行ったものとみなされること」とあるのは「清算委託者が受託清算参加者に対し任意解約又は一括コンプレッションの申込みの指図を行ったものとみなされること」と読み替えるものとする。

2 当社は、前項の規定により準用する前条第1項又は第2項に規定する通知を受領した場合は、当該通知のうち当社が定める内容について受託清算参加者に通知する。

3 前項に規定する通知を受領した受託清算参加者は、当該通知に係る任意解約又は一括コンプレッションの申込みの指図に対する諾否について、当社に対して通知することとする。

(清算取次原取引の合意解約)

第58条 第54条第4項(第54条の2第1項において準用する場合を含む。以下同じ。)の清算取次原取引及び当該清算取次原取引に基づく債権債務(次に掲げるものを除く。)は、第54条第4項の規定その他本業務方法書の定めるところにより当該清算取次原取引の当事者である清算委託者及び清算取次原取引相手方間で合意解約が成立したことによって、同項第3号の清算約定の成立と同時に将来に向かって消滅する。

(清算取次原取引の合意解約)

第58条 第54条第4項の清算取次原取引及び当該清算取次原取引に基づく債権債務(次に掲げるものを除く。)は、第54条第4項の規定その他本業務方法書の定めるところにより当該清算取次原取引の当事者である清算委託者及び清算取次原取引相手方間で合意解約が成立したことによって、同項第3号の清算約定の成立と同時に将来に向かって消滅する。

(1) (略)

(2) 前号に掲げるもののほか、当該清算約定の成立時に既に発生している債務であつて、当社が定めるもの

2・3 (略)

第4節 清算約定（委託分）の承継等

(清算約定（委託分）の承継の申込み)

第58条の2 清算委託者（清算受託契約に規定する期限の利益喪失事由が発生していない者に限る。以下本条において同じ。）は、自らの計算により成立している清算約定（委託分）の全部又は一部について、本条及び次条に規定するところにより、当該清算約定（委託分）及び清算委託取引の当事者となっている受託清算参加者から承継清算参加者へ承継させることができる。

2 承継清算参加者は、承継の当事者となる清算委託者と清算受託契約を締結していることを要する。

3 清算委託者は、第1項の規定により当社に対して承継の申込みをする場合には、あらかじめ、承継清算参加者に対して当該承継の申込みをし、当該承継清算参加者の承諾を得るとともに、当該清算委託者が承継清算参加者への承継を希望する清算約定（委託分）（以下本節において「対象清算約定」という。）の当事者となっている受託清算参加者（以下「承継元清算参加者」という。）に対して当該承継の申込みを行う旨を通知するものとする。

4 承継清算参加者は、前項に規定する承継の承諾をし、かつ当該承継に係る清算委託者から承継申込書の交付を受けた場合には、承継を希望する日の前当社営業日の午後1時まで、当社に対して、当該承継申込書（承継清算参加者が

(1) (略)

(2) 前2号に掲げるもののほか、当該清算約定の成立時に既に発生している債務であつて、当社が定めるもの

2・3 (略)

(新設)

当該承継の申込みを受けた旨及び当該承諾をした旨、当該清算委託者が承継元清算参加者に対して当該承継の申込みを行う旨を通知した旨及び当社に当該承継の申込みをする旨並びに承継清算参加者が当社に当該承継の申込みをする旨が記載されていることを要する。）を提出しなければならない。

(清算約定（委託分）の承継の成立)

第58条の3 当社は、前条の規定により行われた承継の申込みを受領した場合には、当該申込みを受領した日（以下「承継申込日」という。）において、対象清算約定の承継が行われたと仮定して第64条、第65条及び第78条の規定に基づき当初証拠金及び変動証拠金等を算出するとともに、当社の定めるところにより期限前終了手数料及び承継時支払金額を算出することとし、当該承継申込日の翌当社営業日の午前11時までに当該承継清算参加者及び承継元清算参加者が当社に対して当該当初証拠金（第4項第4号の規定により承継清算参加者を代理人として当社に預託されたものとみなされる当初証拠金を控除した額とする。）、変動証拠金等、期限前終了手数料及び承継時支払金額を預託又は交付されたことを確認したときは、当社は当該承継の申込みを承諾することとする。

2 前条第1項に規定する承継は、前項に規定する当社が承諾を行った時点において、対象清算約定に対応する次に掲げる権利義務を一括して承継清算参加者に承継させることとする。

(1) 承継元清算参加者及び当社との対象清算約定に係る権利義務（次項の規定により対象清算約定が終了する直前のもの）と当社が定める条件が同一となる権利義務

(2) 承継元清算参加者及び当該清算委託者との間の清算委託取引に係る権利義務（次項の

規定により対象清算約定に係る清算委託取引が終了する直前のもの）と当社が定める条件が同一となる権利義務

3 前2項の規定により対象清算約定の承継が行われた場合には、当該対象清算約定及び当該対象清算約定に係る清算委託取引は、前項に規定する権利義務の成立と同時に当然に終了する。

4 当社が前条の規定による承継の申込みを第1項の規定に基づき承諾した場合、次に定めるところにより前項の規定により終了した対象清算約定の決済及び承継が行われるものとする。

(1) 当該承諾の日（以下当社が承継の申込みを承諾する日を「承継日」という。）に、当社、承継清算参加者及び当該承諾に係る清算委託者の間において、第2項各号の権利義務が発生する。

(2) 前号の規定により発生する権利義務は、当該承諾に係る清算委託者の承継清算参加者に対する有価証券等清算取次ぎの委託に基づき、承継清算参加者が当該清算委託者の計算により対象清算約定の終了時に成立させた清算約定（委託分）及びその清算委託取引に係る権利義務とみなす。

(3) 当社、承継清算参加者、承継元清算参加者及び当該承諾に係る清算委託者は、第3項の対象清算約定及び当該対象清算約定に係る清算委託取引の終了並びに第1号の規定による権利義務の発生に伴い、当社が定めるところにより、承継時支払金額、期限前終了手数料及び変動証拠金の授受を行う。

(4) 第76条の規定により当該承諾に係る清算委託者が返還請求権を有する当初証拠金（第2項各号に掲げる権利義務の全部について承継された場合で、第72条の規定により預託されたものに限る。）は、承継清算参加者を代理人として当社に預託された当初証拠

金とみなす。

- 5 第2項の規定により成立した当社及び承継清算参加者間の権利義務については、これを清算約定（委託分）とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。

（清算委託者の清算委託取引の移管の申込み）

第58条の4 清算委託者（受託清算参加者と同（新設）

一の企業集団に含まれる者であり、清算受託契約に規定する期限の利益喪失事由が発生していない者に限る。以下本条及び次条において「移管元清算委託者」という。）は、受託清算参加者との間で成立している清算委託取引の全部又は一部について、本条及び次条に規定するところにより、受託清算参加者を同一とする他の清算委託者（受託清算参加者と同一の企業集団に含まれる者であり、移管元清算委託者以外の者に限る。以下「移管先清算委託者」という。）又は当該受託清算参加者に移管（移管元清算委託者及び当該受託清算参加者の間の清算委託取引を次条第4項の定めるところにより将来に向かって消滅させること又は移管元清算委託者及び当該受託清算参加者の間の清算委託取引を次条第4項の定めるところにより将来に向かって消滅させると同時に、移管先清算委託者及び当該受託清算参加者の間に当該清算委託取引と同一内容の新たな清算委託取引を成立させることをいう。以下本条及び次条において同じ。）させることができる。

- 2 清算委託者は、前項の規定により当社に対して清算委託取引の移管の申込みをする場合には、あらかじめ、受託清算参加者（他の清算委託者に対して移管する場合には当該他の清算委託者を含む。以下本項及び次項において同じ。）に対して当該移管の申込みをし、当該受託清算参加者の承諾を得るものとする。

3 受託清算参加者は、前項に規定する清算委託取引の移管の承諾をし、かつ清算委託者から当該移管に係る申込書の交付を受けた場合には、移管を希望する日の前当社営業日の午後1時までに、当社に対して、当該申込書（移管元清算委託者及び受託清算参加者が移管に合意することが記載されていることを要する。）を提出しなければならない。

（清算委託取引の移管の成立）

第58条の5 当社は、前条の規定により行われ (新設)

た移管の申込みを受領した場合には、当該申込みを受領した日（以下「移管申込日」という。）において、清算委託取引の移管が行われたと仮定して第64条、第65条及び第78条の規定に基づき当初証拠金及び変動証拠金等を算出することとし、当該移管申込日の翌当社営業日の午前11時までに当該受託清算参加者が当社に対して当該当初証拠金（第3項の規定により移管先清算委託者が受託清算参加者を代理人として当社に預託されたものとみなされる当初証拠金又は受託清算参加者が当社に預託したものとみなされる当初証拠金を控除した額とする。）及び変動証拠金等が預託又は交付されたことを確認したときは、当社は当該移管の申込みを承諾することとする。

2 清算委託取引の移管は、前項の規定により移管の申込みを当社が承諾した時点で成立するものとする。

3 前項の規定により清算委託取引の移管が成立した場合には、第76条の規定により移管元清算委託者が返還請求権を有する当初証拠金（清算委託取引の全部について移管された場合で、第72条の規定により預託されたものに限る。）は、移管先清算委託者が受託清算参加者を代理人として当社に預託した当初証拠金（清算委託

取引を受託清算参加者に移管した場合には、当該受託清算参加者が当社に預託した当初証拠金)とみなす。

4 移管の対象となった移管元清算委託者及び受託清算参加者間の清算委託取引は、第2項に規定する移管が行われた時点において将来に向かって消滅するものとする。この場合において、移管先清算委託者へ移管するときは、移管の対象となった移管元清算委託者及び受託清算参加者間の清算委託取引は、第2項に規定する移管が行われた時点において将来に向かって消滅すると同時に、移管先清算委託者及び受託清算参加者間において、当該清算委託取引と同一内容の法律関係が発生するものとする。

5 清算委託取引の移管に伴う移管元清算委託者、移管先清算委託者及び受託清算参加者の間の債権債務の清算は、これらの者において、その合意に従って行う。

6 第4項の規定により発生する移管先清算委託者及び受託清算参加者間の清算委託取引は、移管先清算委託者の受託清算参加者に対する有価証券等清算取次ぎの委託により成立した清算委託取引とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。

(清算参加者口座)

第59条 (略)

2 清算参加者口座は、清算参加者の自己の計算による清算約定を記録する口座（以下「自己取引口座」という。）と清算委託者の計算による清算約定を清算受託契約ごとに記録する口座（以下「委託取引口座」という。）に区分する。この場合、複数の清算委託者又は同一の清算委託者を当事者とする複数の清算受託契約について同一の委託取引口座を設定することはできない。

(清算参加者口座)

第59条 (略)

2 清算参加者口座は、清算参加者の自己の計算による清算約定を記録する口座（以下「自己取引口座」という。）と清算委託者の計算による清算約定を清算委託者ごとに記録する口座（以下「委託取引口座」という。）に区分する。

3～5 (略)	3～5 (略)
<p>6 各清算約定並びにこれに係る当初証拠金及び変動証拠金に係る当社と清算参加者の間の債権債務及び当社と清算委託者の間の債権債務は、自己取引口座及び各委託取引口座ごとに生じるものとする。</p>	<p>(新設)</p>
<p>7 清算参加者は、当社の定めるところにより、清算委託者から委託取引口座に係るヘッジ口座又はノンヘッジ口座の種別について申告を受け、当該申告の内容を当社に届け出るものとする。委託取引口座の種別を変更する場合も同様とする。</p>	<p>(新設)</p>
<p>(清算取次口座)</p>	<p>(清算取次口座)</p>
<p>第60条 受託清算参加者は、<u>清算委託者との間で締結された清算受託契約ごとに、各清算受託契約に基づく清算委託取引の内容</u>、当該清算委託取引に係る当初証拠金、委託当初証拠金、変動証拠金その他<u>当該各清算受託契約並びに本業務方法書等に基づいて清算委託者との間で授受される金銭等を管理するための口座</u>（以下「清算取次口座」という。）を開設する。</p>	<p>第60条 受託清算参加者は、<u>清算委託者ごとに、各清算委託者を当事者とする清算委託取引の内容</u>、当該清算委託取引に係る当初証拠金、委託当初証拠金、変動証拠金その他清算受託契約並びに本業務方法書等に基づいて清算委託者との間で授受される金銭等を管理するための口座（以下「清算取次口座」という。）を開設する。</p>
2 (略)	2 (略)
<p>3 各<u>清算委託取引並びにこれに係る当初証拠金及び変動証拠金に係る受託清算参加者と清算委託者の間の債権債務は、清算取次口座ごとに生じるものとする。</u></p>	<p>(新設)</p>
<p>(清算参加者の当初証拠金所要額)</p>	<p>(清算参加者の当初証拠金所要額)</p>
第64条 (略)	第64条 (略)
2 (略)	2 (略)
<p>3 清算約定（委託分）に係る<u>各委託取引口座の当初証拠金所要額は、当該各委託取引口座について算出した額</u>とする。</p>	<p>3 清算約定（委託分）に係る当初証拠金所要額は、各委託取引口座について算出した<u>額の合計額</u>とする。</p>
4 (略)	4 (略)

(当初証拠金の預託時限)
第66条 清算参加者及び清算委託者は、当初証拠金として当社に預託した金銭及び代用有価証券の代用価格の合計額（以下「当初証拠金預託額」という。）が、当社に預託すべき自己取引口座又は委託取引口座ごとの当初証拠金所要額に不足する場合には、その不足が生じた日の翌当社営業日午前11時までに、その不足額を当社に預託しなければならない。

2 前項に規定する時限までに清算委託者が不足額を預託するための業務執行手順を構築することが実務上困難であると清算参加者と清算委託者との間であらかじめ合意した場合には、当該清算委託者は、不足が生じた日の翌々当社営業日の午前11時までに当該不足額を当社に預託するものとする。

(清算参加者の日中証拠金所要額)
第68条 (略)
2 (略)
3 清算約定（委託分）に係る各委託取引口座の日中証拠金所要額は、当該各委託取引口座について算出した額とする。
4 (略)

(日中証拠金の預託時限)
第70条 (略)
2 前項に規定する時限までに清算委託者が不足額を預託するための業務執行手順を構築することが実務上困難であると清算参加者と清算委託者との間であらかじめ合意した場合には、当該清算委託者は、不足が生じた日の翌々当社営業日の午後3時30分までに当該不足額を当社に預託するものとする。

3 当初証拠金預託額が、債務負担により再計算

(当初証拠金の預託時限)
第66条 清算参加者及び清算委託者は、当初証拠金として当社に預託した金銭及び代用有価証券の代用価格の合計額（以下「当初証拠金預託額」という。）が、当社に預託すべき当初証拠金所要額に不足する場合には、その不足が生じた日の翌当社営業日（当該清算委託者が非居住者である場合には、当該不足が生じた日の翌々当社営業日）正午までに、その不足額を当社に預託しなければならない。

(新設)
(清算参加者の日中証拠金所要額)
第68条 (略)
2 (略)
3 清算約定（委託分）に係る日中証拠金所要額は、各委託取引口座について算出した額の合計額とする。
4 (略)

(日中証拠金の預託時限)
第70条 (略)
(新設)
(新設)

された債務負担時所要証拠金の額以上となった場合には、日中証拠金所要額の不足は解消されたものとする。

(清算委託者による当初証拠金の預託)

第72条 (略)

2 (略)

3 受託清算参加者は、清算委託者から当初証拠金として交付を受けた金銭及び代用有価証券について、清算取次口座ごとに帳簿を作成及び記帳するなどの区分管理を行わなければならない。

4 清算委託者が受託清算参加者に対し当初証拠金として交付した金銭及び代用有価証券の代用価格の合計額が、当該清算委託者が当社に預託すべき当初証拠金所要額及び日中証拠金所要額を下回っている場合、当該受託清算参加者は、その不足額以上の金銭又は代用有価証券を、第66条第1項又は第70条第1項に規定する日時までに、自己の負担で当社に預託しなければならない。

5 (略)

(差換預託)

第73条 (略)

2 (略)

3 前項の場合において、受託清算参加者は、清算委託者から委託当初証拠金として預託を受けた金銭及び代用有価証券について、清算取次口座ごとに帳簿を作成及び記帳するなどの区分管理しなければならない。

(当初証拠金の区分及び管理方法)

第75条 清算参加者は、当社に対して当初証拠金として金銭又は代用有価証券を交付する場合には、当該金銭又は代用有価証券を、次に掲げ

(清算委託者による当初証拠金の預託)

第72条 (略)

2 (略)

3 受託清算参加者は、清算委託者から当初証拠金として交付を受けた金銭及び代用有価証券について、清算委託者ごとに帳簿を作成及び記帳するなどの区分管理を行わなければならない。

4 清算委託者が受託清算参加者に対し当初証拠金として交付した金銭及び代用有価証券の代用価格の合計額が、当該清算委託者が当社に預託すべき当初証拠金所要額及び日中証拠金所要額を下回っている場合、当該受託清算参加者は、その不足額以上の金銭又は代用有価証券を、自己の負担で当社に預託しなければならない。

5 (略)

(差換預託)

第73条 (略)

2 (略)

3 前項の場合において、受託清算参加者は、清算委託者から委託当初証拠金として預託を受けた金銭及び代用有価証券について、清算委託者ごとに帳簿を作成及び記帳するなどの区分管理しなければならない。

(当初証拠金の区分及び管理方法)

第75条 清算参加者は、当社に対して当初証拠金として金銭又は代用有価証券を交付する場合には、当該金銭又は代用有価証券を、次に掲げ

る当初証拠金に区分して預託するものとする。

(1) (略)

(2) 各清算委託者の清算約定（委託分）に係る当初証拠金のうち清算委託者の代理人として預託するもの

(3) 各清算委託者の清算約定（委託分）に係る当初証拠金のうち差換当初証拠金として預託するもの

2 (略)

3 第1項第3号に掲げる差換当初証拠金について

ては、清算参加者は、委託当初証拠金の額（代用有価証券の場合にはその代用価格の合計額）を、毎当社営業日、当社に報告を行うものとし、当社は当該額と差換当初証拠金の差額を区分して管理するものとする。

(当初証拠金の返還請求権)

第76条 清算参加者及び清算委託者は、次の各号に掲げる当初証拠金の区分に応じ、当該各号に定めるところにより当社に対する当初証拠金の返還請求権を有する。

(1) 清算約定（委託分）に係る当初証拠金

a 清算委託者は、当該清算委託者が当社に預託した清算約定（委託分）（当該清算委託者が受託清算参加者との間で締結した清算受託契約に基づく有価証券等清算取次ぎの委託により成立するものに限る。以下本号において同じ。）に係る当初証拠金の額及び当該受託清算参加者が当該清算約定（委託分）に関して当社に預託した差換当初証拠金の額の合計額から当該清算参加者が当該清算約定（委託分）に関して当社に対して負担する未履行債務（当該清算参加者の破綻等その他の事由による当該清算約定（委託分）の処理に伴って生じる債務のうち未履行であるものを含む。以下本号に

る当初証拠金に区分して預託するものとする。

(1) (略)

(2) 清算約定（委託分）に係る当初証拠金のうち清算委託者の代理人として預託するもの

(3) 清算約定（委託分）に係る当初証拠金のうち差換当初証拠金として預託するもの

2 (略)

(新設)

(当初証拠金の返還請求権)

第76条 清算参加者及び清算委託者は、次の各号に掲げる当初証拠金の区分に応じ、当該各号に定めるところにより当社に対する当初証拠金の返還請求権を有する。

(1) 清算約定（委託分）に係る当初証拠金

a 清算委託者は、当該清算委託者が当社に預託した当初証拠金の額及び当該清算委託者が清算受託契約を締結している受託清算参加者が当社に預託した差換当初証拠金の額のうち清算委託者が当該受託清算参加者に預託した委託当初証拠金の額（当該受託清算参加者が当社に預託した差換当初証拠金の額が当該受託清算参加者と清算受託契約を締結しているすべての清算委託者が当該受託清算参加者に預託した委託当初証拠金の合計額に満たない場合には、各清算委託者が当該受託清算参加者に預託した委託当初証拠金の額に応じて按分した額）の合計額から、当該清算委託者が清算委託取引

において同じ。)を控除した額の範囲内で、
当該清算委託者が当社に預託した当該清算
約定(委託分)に係る当初証拠金の額及び
当該受託清算参加者が当該清算約定(委託
分)に関して当社に預託した差換当初証拠
金の額のうち当該清算委託者が当該受託清
算参加者に預託した清算委託取引(当該清
算受託契約に基づく有価証券等清算取次ぎ
の委託により成立するものに限る。)に係
る委託当初証拠金の額の合計額から、当該
清算委託者が当該清算委託取引に関して当
該受託清算参加者に対して負担する未履行
債務(当該清算委託取引の終了に伴って生
じる債務のうち未履行であるものを含む。)
の額を控除した額に相当する部分につい
て、当初証拠金の返還請求権を有する。

- b 清算参加者は、当該清算参加者と清算受
託契約を締結している前aに規定する清算
委託者が当社に預託した清算約定(委託分)
に係る当初証拠金及び当該清算参加者が当
該清算約定(委託分)に関して当社に預託
した差換当初証拠金の合計額から、当該清
算参加者が当該清算約定(委託分)に関し
て当社に対して負担する未履行債務の額及
び当該清算委託者が当初証拠金の返還請求
権を有する額の合計額を控除した額に相当
する部分について、当初証拠金の返還請求
権を有する。

(2) (略)

2～5 (略)

(変動証拠金所要額)

第78条 (略)

2 当社は、清算約定(委託分)の変動証拠金所

に関して当該受託清算参加者に対して負担
する未履行債務(当該清算委託取引の終了
に伴って生じる債務のうち未履行であるも
のを含む。)の額を控除した額に相当する
部分について、当初証拠金の返還請求権を
有する。

- b 清算参加者は、当該清算参加者と清算受
託契約を締結している清算委託者が当社に
預託した当初証拠金及び当該清算参加者が
清算約定(委託分)に関して当社に預託し
た差換当初証拠金の合計額から、当該清算
参加者が清算約定(委託分)に関して当社
に対して負担する未履行債務(当該清算参
加者の破綻等その他の事由による清算約定
(委託分)の処理に伴って生じる債務のう
ち未履行であるものを含む。)の額及び前
aに規定する清算委託者が当初証拠金の返
還請求権を有する額の合計額を控除した額
に相当する部分について、当初証拠金の返
還請求権を有する。

(2) (略)

2～5 (略)

(変動証拠金所要額)

第78条 (略)

2 当社は、清算約定(委託分)の変動証拠金所

要額を、当社が定める方法により委託取引口座ごとに算出し、その金額を当該清算委託者と清算受託契約を締結している受託清算参加者に通知する。

(変動証拠金の預託時限)

第81条 清算参加者は、変動証拠金の授受において支払方となる場合には、当該変動証拠金の算出日の翌当社営業日の午前11時までに、変動証拠金所要額に相当する金銭を当社に預託しなければならない。

2 (略)

(変動証拠金に係る利息の取扱い)

第83条 (略)

2 清算参加者は、変動証拠金に係る利息を、翌当社営業日の午前11時までに、当社に支払わなければならない。

3 (略)

(変動証拠金の返還請求権)

第84条 当社及び清算参加者は、本業務方法書等の定めるところにより授受を行う場合及び清算約定の任意解約又は期限前終了に伴い返還する場合を除くほか、相手方に対し、変動証拠金の返還を請求することができない。

第7章 資金決済等

(資金決済の方法)

第85条 (略)

2 当社は、清算参加者との間で授受する金銭を、当社が定めるところにより、自己取引口座及び委託取引口座ごとに、差引計算して授受することができる。

要額を、当社が定める方法により清算委託者ごとに算出し、その金額を当該清算委託者と清算受託契約を締結している受託清算参加者に通知する。

(変動証拠金の預託時限)

第81条 清算参加者は、変動証拠金の授受において支払方となる場合には、当該変動証拠金の算出日の翌当社営業日の正午までに、変動証拠金所要額に相当する金銭を当社に預託しなければならない。

2 (略)

(変動証拠金に係る利息の取扱い)

第83条 (略)

2 清算参加者は、変動証拠金に係る利息を、翌当社営業日の正午までに、当社に支払わなければならない。

3 (略)

(変動証拠金の返還請求権)

第84条 当社及び清算参加者は、本業務方法書等の定めるところにより授受を行う場合及び清算約定のデクリアー又は期限前終了に伴い返還する場合を除くほか、相手方に対し、変動証拠金の返還を請求することができない。

第7章 資金決済

(資金決済の方法)

第85条 (略)

2 当社は、清算参加者との間で授受する金銭を、当社が定めるところにより、差引計算して授受することができる。

(当初証拠金及び決済金額等の差引計算)

第85条の2 前条第2項の規定により差引計算 (新設)

した結果、清算参加者が当社に対して決済金額等(決済金額、変動証拠金及び変動証拠金に係る利息を差引計算した後の額をいう。以下本条及び次条において同じ。)を支払うこととなる場合には、当該決済金額等の支払い及び第66条に規定する当初証拠金の預託については、自己取引口座及び委託取引口座ごとに、次に掲げる計算式の順序に従って差引計算するものとし、それぞれ算出された額が負の数になる場合には、清算参加者は当社に対し当該額を預託するものとする。ただし、第1号に係る預託については、現金により預託しなければならない。

(1) (前当社営業日末時点における当初証拠金預託額のうち現金による預託額) - (同時点において清算参加者が支払うこととなる決済金額等)

(2) (前当社営業日末時点における当初証拠金預託額 - 充当現金預託額(前号による差引計算の結果、清算参加者が支払うこととなる決済金額等に充当された当初証拠金預託額のうち現金による預託額をいう。)) - (同時点における当初証拠金所要額)

2 前条第2項の規定により差引計算した結果、清算参加者が当社から決済金額等を受領することとなる場合には、当該決済金額等の支払い及び第66条に規定する当初証拠金の預託については、自己取引口座及び委託取引口座ごとに、次に掲げる計算式に従って差引計算するものとし、算出された額が負の数になる場合には、清算参加者は当社に対し当該額を預託するものとする。

(前当社営業日末時点における当初証拠金預託額 + 同時点において清算参加者が受領することとなる決済金額等) - (前当社営業日末時

<p>点における当初証拠金所要額)</p> <p>(<u>返戻の申請及び当初証拠金のみなし預託</u>)</p>	
<p><u>第85条の3 前条の差引計算の結果、決済金額</u> 等を受領することとなる清算参加者は、当社に 対し、自己取引口座及び委託取引口座ごとに受 領する金銭の額を明らかにしたうえで申請を行 うことにより、当該金銭を受領するものとする。</p>	<p>(新設)</p>
<p>2 前項の申請がなされなかった場合、自己取引 口座又は委託取引口座ごとに算出された決済金 額等は、当該口座に係る当初証拠金として預託 されたものとみなす。</p>	
<p>(清算預託金の管理及び運用)</p> <p>第87条 当社は、前条の清算預託金の全額を、 清算預託金を預託した清算参加者又は清算委託 者のために、当社が定める方法により分別して 管理するものとする。</p>	<p>(清算預託金の管理及び運用)</p> <p>第87条 当社は、前条の清算預託金を、清算預 託金を預託した清算参加者のために、当社が定 める方法により分別して管理するものとする。</p>
<p>2～4 (略)</p>	<p>2～4 (略)</p>
<p>(清算預託金等の目的外利用の禁止)</p> <p>第88条 当社は、本業務方法書等の定めるところ により清算預託金を管理又は運用（清算参加 者に前条第4項の利息を支払うことを含む。） する場合及び本業務方法書等の定めるところに より清算預託金を清算参加者又は清算委託者に 返還する場合を除き、清算預託金の利用、振替、 振込み若しくは払出しを行い、又は清算預託金 を第三者に譲渡し、若しくは第三者のために質 権その他の担保権を設定するなどの処分行為を してはならない。</p>	<p>(清算預託金等の目的外利用の禁止)</p> <p>第88条 当社は、本業務方法書等の定めるところ により清算預託金を管理又は運用（清算参加 者に前条第4項の利息を支払うことを含む。） する場合及び本業務方法書等の定めるところに より清算預託金を清算参加者又は清算委託者に 返還する場合を除き、清算預託金の利用、振替、 振込み若しくは払出しを行い、又は清算預託金 を第三者に譲渡し、若しくは第三者のために質 権その他の担保権を設定するなどの処分行為を してはならない。</p>
<p>(<u>受託清算参加者破綻時における清算約定（委託 分）等の承継</u>)</p>	<p>(清算約定（委託分）等の承継)</p>
<p>第94条 清算委託者（当社が規則で定める清算 委託者のうち、清算受託契約に規定する期限の</p>	<p>第94条 清算委託者は、第91条の規定により 当該清算委託者の計算により成立した清算約定</p>

利益喪失事由が発生していない者に限る。以下、本条において同じ。)は、第91条の規定により当該清算委託者の計算により成立した清算約定(委託分)が終了した場合には、当社が規則で定める期間内に限り、承継清算参加者を經由して当社に当社所定の承継申込書を交付することにより、当該清算約定(委託分)に対応する次に掲げる権利義務を一括して一又は二以上の承継清算参加者に承継させることができる。

(1)・(2) (略)

2 承継清算参加者は、承継の当事者となる清算委託者と清算受託契約を締結していることを要する。

3 (略)

4 (略)

5 当社は、前項の規定により行われた承継の申込みを受領した場合には、承継申込日において、第91条の規定により終了した清算約定(委託分)のうち、清算委託者が承継を希望するもの(以下本条において「対象清算約定」という。)の承継が行われたと仮定して第64条及び第65条の規定に基づき当初証拠金を算出するとともに、当社が規則で定めるところにより承継時支払金額、未払債務(破綻清算参加者の破綻等が認定された時点で当社及び破綻清算参加者の間の弁済期が到来している債務を除く。以下本条において同じ。)及び変動証拠金を算出することとし、当該承継申込日の翌当社営業日の午前11時までに当該承継清算参加者が当社に対して当該当初証拠金、承継時支払金額、未払債務及び変動証拠金を預託又は交付したことを確

(委託分)が終了した場合には、当社が規則で定める期間内に限り、承継清算参加者(本項に規定する承継清算参加者をいう。)を經由して当社に当社所定の承継申込書を交付することにより、当該清算約定(委託分)に対応する次に掲げる権利義務を一括して破綻清算参加者以外の清算参加者(当該清算委託者と清算受託契約を締結している清算参加者に限る。以下「承継清算参加者」という。)に承継(本条の定めるところにより、当社、承継清算参加者及び清算委託者の間で当該権利義務を新たに発生させるとともに、それに伴う金銭の授受及び権利義務の処理を行うことをいう。以下同じ。)させることができる。

(1)・(2) (略)

(新設)

2 (略)

3 (略)

(新設)

認したときは、当社は当該承継の申込みを承諾することとする。

6 当社が前項の規定による承諾を行った場合、次に定めるところにより対象清算約定の決済及び承継が行われるものとする。

(1) 承継日に、当社、承継清算参加者及び当該承諾に係る清算委託者の間において、第1項各号の権利義務が発生する。

(2) 前号の規定により発生する権利義務は、当該承諾に係る清算委託者の承継清算参加者に対する有価証券等清算取次ぎの委託に基づき、承継清算参加者が当該清算委託者の計算により対象清算約定の終了時に遡及して成立させた清算約定（委託分）及びその清算委託取引に係る権利義務とみなす。

(3) 当社、承継清算参加者及び当該承諾に係る清算委託者は、第1号の規定による権利義務の発生に伴い、当社が規則で定めるところにより、承継時支払金額、未払債務及び変動証拠金の授受を行う。

(4) ・ (5) (略)

(6) 第91条第2項の規定にかかわらず、当該対象清算約定の期限前終了手数料は、その終了の日における当該各清算約定の正味現在価値を基準として当社が規則で定めるところにより算出する。

7 (略)

8 (略)

4 当社が第1項及び前項の規定による承継の申込みを承諾した場合、次に定めるところにより第91条の規定により終了した清算約定（委託分）（以下本項において「対象清算約定（委託分）」という。）の決済及び承継が行われるものとする。

(1) 当該承諾の日（以下「承継日」という。）に、当社、承継清算参加者及び当該承諾に係る清算委託者の間において、第1項各号の権利義務が発生する。

(2) 前号の規定により発生する権利義務は、当該承諾に係る清算委託者の承継清算参加者に対する有価証券等清算取次ぎの委託に基づき、承継清算参加者が当該清算委託者の計算により対象清算約定（委託分）の終了時に遡及して成立させた清算約定（委託分）及びその清算委託取引に係る権利義務とみなす。

(3) 当社、承継清算参加者及び当該承諾に係る清算委託者は、第1号の規定による権利義務の発生に伴い、当社が規則で定めるところにより、承継時支払金額、未払債務（破綻清算参加者の破綻等が認定された時点で当社及び破綻清算参加者の間の弁済期が到来している債務を除く。）及び変動証拠金の授受を行う。

(4) ・ (5) (略)

(6) 第91条第2項の規定にかかわらず、当該対象清算約定（委託分）の期限前終了手数料は、その終了の日における当該各清算約定の正味現在価値を基準として当社が規則で定めるところにより算出する。

5 (略)

6 (略)

(第四階層特別清算料による損失の補填)

第106条 破綻処理損失について、前条に定めるところによってもなお補填することができない損失がある場合には、破綻認定日における破綻清算参加者以外の清算参加者のうち、破綻認定日から当初損失確定日までのすべての清算約定（破綻認定日後に成立した清算約定及び当初損失確定日までに任意解約その他の事由により終了した清算約定を含む。以下同じ。）に係る変動証拠金等の受け取るべき額の総額が支払うべき額の総額を上回る者（以下本条において「第四階層特別清算料負担参加者」という。）は、当社が規則で定めるところにより、第四階層特別清算料を当社に支払う義務を負う。この場合において、当社は、第四階層特別清算料負担参加者から支払いを受けた第四階層特別清算料をもって、当該損失を補填する。

2 (略)

(破綻時証拠金の預託)

第108条 (略)

2～4 (略)

5 清算参加者は、破綻時証拠金として当社に預託した金銭及び代用有価証券の代用価格の合計額が、当社に預託すべき破綻時証拠金所要額に不足する場合には、その不足が生じた日の翌当社営業日の午前11時までに、その不足額を当社に預託しなければならない。

6・7 (略)

(金利スワップ運営委員会)

第122条 当社は、前条に規定する本業務方法書等の変更を行おうとする場合において、当該

(第四階層特別清算料による損失の補填)

第106条 破綻処理損失について、前条に定めるところによってもなお補填することができない損失がある場合には、破綻認定日における破綻清算参加者以外の清算参加者のうち、破綻認定日から当初損失確定日までのすべての清算約定（破綻認定日後に成立した清算約定及び当初損失確定日までにデクリアーその他の事由により終了した清算約定を含む。以下同じ。）に係る変動証拠金等（変動証拠金、変動証拠金に係る利息、決済金額その他清算約定に基づいて授受した金銭をいう。以下同じ。）の受け取るべき額の総額が支払うべき額の総額を上回る者（以下本条において「第四階層特別清算料負担参加者」という。）は、当社が規則で定めるところにより、第四階層特別清算料を当社に支払う義務を負う。この場合において、当社は、第四階層特別清算料負担参加者から支払いを受けた第四階層特別清算料をもって、当該損失を補填する。

2 (略)

(破綻時証拠金の預託)

第108条 (略)

2～4 (略)

5 清算参加者は、破綻時証拠金として当社に預託した金銭及び代用有価証券の代用価格の合計額が、当社に預託すべき破綻時証拠金所要額に不足する場合には、その不足が生じた日の翌当社営業日の正午までに、その不足額を当社に預託しなければならない。

6・7 (略)

(金利スワップ運営委員会)

第122条 当社は、前条に規定する本業務方法書等の変更を行おうとする場合において、当該

変更が次の各号に掲げる事項に該当するときは、当該変更を行うことの適否につき、金利スワップ運営委員会に諮問し、その意見を尊重するものとする。ただし、当該変更の内容が軽微なものである場合は、この限りでない。

(1)～(3) (略)

(4) 第2章第4節に規定する清算参加者の申請による金利スワップ清算資格の喪失に関する事項

(5) 第2章第6節に規定する清算参加者に対する措置等に関する事項

(6)～(11) (略)

2 (略)

付 則

1 この改正規定は、平成26年2月24日から施行する。

2 この業務方法書の施行時における債務負担の取扱いその他必要な事項については、当社がその都度定める。

変更が次の各号に掲げる事項に該当するときは、当該変更を行うことの適否につき、金利スワップ運営委員会に諮問し、その意見を尊重するものとする。ただし、当該変更の内容が軽微なものである場合は、この限りでない。

(1)～(3) (略)

(4) 第2章第3節に規定する清算参加者の申請による金利スワップ清算資格の喪失に関する事項

(5) 第2章第4節に規定する清算参加者に対する措置等に関する事項

(6)～(11) (略)

2 (略)

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の一部改正新旧対照表

新	旧
<p>(定義)</p> <p>第2条 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。</p> <p>(1)・(2) (略)</p> <p><u>(2)の2 「CFTC Regulation」</u></p> <p><u>とは、Code of Federal Regulations TITLE 17 Commodity and Securities Exchanges CHAPTER I COMMODITY FUTURES TRADING COMMISSIONをいう。</u></p> <p>(3) (略)</p> <p>(削る)</p> <p><u>(4) (略)</u></p>	<p>(定義)</p> <p>第2条 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。</p> <p>(1)・(2) (略)</p> <p>(新設)</p> <p>(3) (略)</p> <p><u>(4) 「バックロード取引」とは、当社が清算参加者から債務負担の申込みを受けた適格金利スワップ取引であって、当該申込みの日において取引日から10営業日が経過しているものをいう。</u></p> <p><u>(5) (略)</u></p>
<p>(清算委託者)</p> <p>第5条 業務方法書第2条第1項第27号に規定する当社が定める要件は、<u>第9条第2号に規定する当社が通知又は公示により定める照合方法又は電子取引基盤の利用者であることとする。</u></p> <p>(削る)</p>	<p>(清算委託者)</p> <p>第5条 業務方法書第2条第1項第27号に規定する当社が定める要件は、<u>次に掲げる事項とする。</u></p> <p><u>(1) 受託清算参加者の属する企業集団に含まれる者であること。</u></p> <p><u>(2) MarketSERV, LLCの提供するMarketWireの利用者であること。</u></p> <p><u>2 前項第1号の要件は、当社が受託清算参加者</u></p>

の破綻等を認定した場合において、当該受託清算参加者と清算受託契約を締結している清算委託者が業務方法書第94条第1項各号に掲げる権利義務を承継清算参加者に承継（同項に規定する承継をいう。）させる場合には、これを適用しない。

(適格金利スワップ取引の要件)

第9条 業務方法書第2条第1項第47号に規定する当社が定める要件は、次に掲げるすべての要件（有価証券等清算取次ぎの委託に基づいて成立する清算参加者間の金利スワップ取引及び損失回避取引については、第1号及び第2号を除くすべての要件）とする。

(1) (略)

(2) MarketSERV, LLCの提供するMarketWireにより照合された金利スワップ取引であること。

(3)～(9) (略)

(10) 想定元本が1円以上4兆円未満であり、かつ、小数点以下の桁がすべて0であること。

(11)～(15) (略)

(ISDA関連取扱文書の指定)

第10条 業務方法書第2条第1項第70号に規定する当社が定める文書は、次の各号に掲げる本規則の規定に基づき、当該各号に掲げる事項に関し、当社が清算参加者への通知又は公示に

(適格金利スワップ取引の要件)

第9条 業務方法書第2条第1項第47号に規定する当社が定める要件は、次に掲げるすべての要件（有価証券等清算取次ぎの委託に基づいて成立する清算参加者間の金利スワップ取引及び損失回避取引については、第1号及び第2号を除くすべての要件）とする。

(1) (略)

(2) 当社が通知又は公示により定める照合方法又は電子取引基盤において成立した金利スワップ取引であること。

(3)～(9) (略)

(10) 想定元本が以下に掲げる事項のすべてを満たすこと。

a 1円以上4兆円未満であり、かつ、小数点以下の桁がすべて0であること。

b 金額が一定であること又は金利スワップ取引の開始時に想定元本の逓減若しくは逓増方法を定め、当該方法による想定元本の逓減若しくは逓増の金額が当該金利スワップ取引の期間中には変わらないものであること。

(11)～(15) (略)

(ISDA関連取扱文書の指定)

第10条 業務方法書第2条第1項第70号に規定する当社が定める文書は、次の各号に掲げる本規則の規定に基づき、当該各号に掲げる事項に関し、当社が清算参加者への通知又は公示に

より定めた文書とする。

- (1) 第29条第2項第1号 スケジュール (ISDA基本契約に規定するScheduleをいう。以下同じ。)に規定された事項とみなされる事項
- (2) 第29条第2項第2号 清算約定に対してISDA基本契約及びISDA定義集を適用するにあたり必要な読替えに関する事項

(代用有価証券)

第13条 (略)

2 業務方法書第7条第2項に規定する代用有価証券の預託の方法その他代用有価証券に関する事項は、次に定めるとおりとする。

- (1) 国債証券の預託方法その他の取扱い
 - a (略)(削る)

b (略)

(2) アメリカ合衆国財務省証券の預託方法その他の取扱い

- a～c (略)
- (削る)

より定めた文書とする。

- (1) 第29条第2項第1号 スケジュール (ISDA基本契約に規定するScheduleをいう。以下同じ。)に規定された事項とみなされる事項
- (2) 第29条第2項第2号 清算約定に対してISDA基本契約及びISDA定義集を適用するにあたり必要な読替えに関する事項

(代用有価証券)

第13条 (略)

2 業務方法書第7条第2項に規定する代用有価証券の預託の方法その他代用有価証券に関する事項は、次に定めるとおりとする。

- (1) 国債証券の預託方法その他の取扱い
 - a (略)
 - b 清算委託者は、代用有価証券として国債証券を受託清算参加者に交付し、又は預託する場合には、社債、株式等の振替に関する法律に基づき日本銀行又はその下位機関(同法第2条第9項に規定する下位機関をいう。以下同じ。)に設けられた受託清算参加者名義の口座への振替により当該交付又は預託を行うものとする。

c (略)

(2) アメリカ合衆国財務省証券の預託方法その他の取扱い

- a～c (略)
- d 清算委託者が代用有価証券として財務省証券を受託清算参加者に交付し、又は預託する場合には、受託清算参加者から当社への預託時限(差入日の前日のアメリカ合衆国東部時間の午後2時)までの受託清算参加者が指定する時刻までに、受託清算参加者が指定する口座への振替により当該交付又は預託を行うものとする。

d (略)

(3)・(4) (略)

(クライアント・クリアリングの取扱いの承認申請)

第15条の2 業務方法書第12条の2第1項の

クライアント・クリアリングの取扱いの承認の申請は、次に掲げる事項を記載した当社所定の申請書を当社に提出して行うものとする。

(1) 商号又は名称(英文の商号又は名称を含む。)

(2) 本店又は主たる事務所の所在地

(3) 代表者の氏名

(4) その他当社がクライアント・クリアリングの取扱いの承認を行うにあたり必要と認める事項

2 前項のクライアント・クリアリングの取扱い

の承認申請書には、クライアント・クリアリングに係る次に掲げる事項を記載した書類を添付しなければならない。

(1) 清算約定及び清算委託取引の決済に係る体制

(2) 清算委託者に対するリスク管理に係る体制

(3) 利益相反を防止するための体制

(金銭等の授受の方法)

第18条 業務方法書第17条第1項、第71条又は第107条第1項第1号の規定により金銭の授受を行う場合は、日本銀行金融ネットワークシステムを利用して、当社名義の日本銀行当座勘定と当該清算参加者名義の日本銀行当座勘定の間の振替により行うものとする。

e (略)

(3)・(4) (略)

(新設)

(金銭等の授受の方法)

第18条 業務方法書第17条第1項、第71条又は第107条第1項第1号の規定により金銭の授受を行う場合は、次に定めるところにより行うものとする。

(1) 金銭を支払う清算参加者は、当社が通知により指定する銀行(以下本条において「指定銀行」という。)のうちから清算参加者が選定した銀行に設けられた当社名義の口座に振り込むものとする。

2 清算参加者は、当社が定める事項を記載した書面を当社に提出し、あらかじめ当社の承認を得た場合には、前項に規定する金銭の授受を、代理人を通じて行うことができる。この場合において、当該授受は、当該代理人名義の日本銀行当座勘定を通じて行うこととする。

(金利スワップ清算資格の喪失時期)

第22条 業務方法書第23条第1項に規定する当社が定める時点は、第27条第2項に定めるところにより当社が受領した債務負担の申込みに係る通知のすべてについて、第28条第2項に定めるところにより債務負担要件の確認を行った時点とする。

(クライアント・クリアリングの取扱いの承認の取消申請)

第22条の2 業務方法書第27条の2のクライアント・クリアリングの取扱いの承認の取消申請は、クライアント・クリアリングの取扱いを廃止しようとする清算参加者が、次に掲げる事項を記載した当社所定のクライアント・クリアリングの取扱いの承認の取消申請書を当社に提出して行うものとする。

(1) 商号又は名称（英文の商号又は名称を含む。）

(2) 本店又は主たる事務所の所在地

(3) 代表者の氏名

2 前項のクライアント・クリアリングの取扱いの承認の取消申請書には、当社が必要と認める書類を添付しなければならない。

(バックアップ受託者の指定等)

(2) 金銭を受領する清算参加者は、清算参加者が選定した銀行に口座を設け、当該口座において受領するものとする。

2 清算参加者は、当社が定める事項を記載した書面を当社に提出し、あらかじめ当社の承認を得た場合には、前項に規定する金銭の授受を、代理人を通じて行うことができる。この場合において、当該授受は、指定銀行に設けられた当該代理人名義の口座を通じて行うこととする。

(金利スワップ清算資格の喪失時期)

第22条 業務方法書第23条第1項に規定する当社が定める時点は、第28条第2項第1号に掲げる債務負担の申込みに関し、当社が債務負担要件の確認を行った時点とする。

(新設)

第26条の2 業務方法書第45条の2第4項に (新設)

規定する当社に対する報告は、次に定めるとおりとする。

(1) 次のa又はbに掲げる事項についてバックアップ受託者の指定の当事者となる清算委託者及び受託清算参加者が合意をしている場合は、当該a又はbに定める内容について速やかに当社に対して報告することとする。

a バックアップ受託者の指定の当事者となる清算委託者及び受託清算参加者の間において、当該清算委託者の計算により成立している清算約定（委託分）及び清算委託取引の全部又は一部を当該受託清算参加者へ承継させるための条件

当該承継させるための条件

b 当該清算委託者の計算により成立している清算約定（委託分）及び清算委託取引の全部又は一部を当該受託清算参加者へ円滑に承継させるための体制整備を行うこと

当該体制整備の内容

(2) 前号a又はbに掲げる事項について合意していたバックアップ受託者が、当該合意の内容を変更又は当該合意を解消した場合は、その旨（前号bに掲げる事項を変更した場合は、変更後の内容を含む。）を速やかに当社に対して報告することとする。

2 業務方法書第45条の2第5項に規定する当社の定める体制整備の内容は、次の各号に定めるすべての内容とする。

(1) 前項1号aに定める条件についてあらかじめ合意すること

(2) 前号に規定する合意に従ってバックアップ受託者へ清算約定（委託分）及び清算委託取引を承継させることが可能かについて、清算委託者及びバックアップ受託者の双方が定期的に確認を行うこと

(3) 清算約定（委託分）及び清算委託取引を承継させた後に日々行うこととなる証拠金等の授受に係るオペレーションを確立すること（清算約定（委託分）及び清算委託取引に係る情報の授受方法、証拠金等の授受に利用する口座情報の確認を含む。）

(4) 第1号に規定する合意に基づき、清算約定（委託分）及び清算委託取引の承継を実際に行ったと仮定した場合における定期的な訓練を実施すること

(債務負担等の申込方法等)

第27条 業務方法書第48条第1項に規定する当社が定める方法は、次の各号に掲げる区分に応じて、当該各号に定めるとおりとする。

(1) 清算委託者（受託清算参加者と同一の企業集団に含まれる者を除く。）の計算により成立した適格金利スワップ取引について債務負担の申込みを行う場合

受託清算参加者が当該清算委託者の適格金利スワップ取引について業務方法書第54条の2第3項に規定する承諾を行う方法

(2) 前号に掲げる適格金利スワップ取引以外について債務負担の申込みを行う場合

第9条第2号に規定する当社が通知又は公示により定める照合方法又は電子取引基盤を用いる方法

2 当社は、業務方法書第48条第1項に規定する通知の受領を、当社営業日の午前11時から正午まで及び午後1時から午後4時までの間、順次行うものとする。

(債務負担に係る条件等)

第28条 (略)

2 当社は、業務方法書第49条第1項の規定による債務負担要件の確認を、当社が債務負担の

(債務負担等の申込方法等)

第27条 業務方法書第48条第1項に規定する当社が定める方法は、MarketWireを用いる方法とする。

(新設)

(債務負担に係る条件等)

第28条 (略)

2 当社は、業務方法書第49条第1項の規定による債務負担要件の確認を、次の各号に掲げる

<p>申込みに係る通知を受領した後速やかに行うものとする。</p>	<p>債務負担の申込みの区分に応じて、当該各号に定める時点までに行うものとする。</p> <p>(1) 前当社営業日の午後4時の後、当社営業日の正午までに行われた債務負担の申込み（バックロード取引に係る債務負担の申込みを除く。）</p> <p>当該当社営業日の午後3時30分</p> <p>(2) 当社営業日の正午の後、同日の午後4時までに行われた債務負担の申込み及びバックロード取引に係る債務負担の申込み</p> <p>当該当社営業日の翌当社営業日の正午</p>
<p>3 (略)</p>	<p>3 (略)</p>
<p>4 業務方法書第49条第1項に規定する当社が定める算出方法は、別表2に規定する方法とする。</p>	<p>4 業務方法書第49条第1項に規定する当社が定める証拠金等は、次の各号に掲げる債務負担の申込みの区分に応じて、当該各号に掲げるものとする。</p> <p>(1) 第2項第1号に掲げる債務負担の申込み 同号に規定する時点までに清算参加者が当社に預託すべき日中証拠金</p> <p>(2) 第2項第2号に掲げる債務負担の申込み 同号に規定する時点までに清算参加者が当社に預託すべき当初証拠金及び交付すべき決済金額</p>
<p>5 業務方法書第49条第2項及び第3項に規定する当社が定める通知は、CFTC Regulation 39.12(b)(7)(ii)の規定に即して、可能な限り速やかに行うものとする。</p>	<p>5 業務方法書第49条第3項に規定する当社が定める時点は、第2項各号に掲げる債務負担の申込みの区分に応じて、当該各号に定める時点とする。</p>
<p>6 当社は、金利スワップ取引清算業務システムその他の金利スワップ取引清算業務を行うために必要な当社又は当社以外の機関が設置するシステムの稼働に支障が生じた場合その他のやむを得ない事由により必要があると認める場合には、債務負担の申込みに係る通知を受領する時間を変更することができる。この場合において、当社は、当該変更を行ったときは、遅滞なく、変更後の時間を清算参加者に通知するものとする。</p>	<p>6 当社は、金利スワップ取引清算業務システムその他の金利スワップ取引清算業務を行うために必要な当社又は当社以外の機関が設置するシステムの稼働に支障が生じた場合その他のやむを得ない事由により必要があると認める場合には、第2項又は前項の時点を変更することができる。この場合において、当社は、当該時点の変更を行ったときは、遅滞なく、変更後の時点を変更後の時間を清算参加者に通知するものとする。</p>

る。

(清算約定の任意解約の申込みの方法等)

第30条 業務方法書第53条第1項に規定する当社が定める方法は、次の各号に掲げる区分に応じて、当該各号に定めるとおりとする。

(1) 清算委託者（受託清算参加者と同一の企業集団に含まれる者を除く。）の計算により成立した清算約定（委託分）について任意解約の申込みをする場合

受託清算参加者が当該清算委託者の清算約定（委託分）について業務方法書第57条の2第3項に規定する承諾を行う方法

(2) 前号に掲げる清算約定（委託分）以外について任意解約の申込みをする場合

第9条第2号に規定する当社が通知又は公示により定める照合方法又は電子取引基盤を用いる方法

2 業務方法書第53条第2項に規定する当社が定める条件は、任意解約要件の確認を行う日又はその翌営業日が利払日又はアップフロントフィーの決済日にあたらないこと及び任意解約手数料の決済日が任意解約要件の確認を行う日以降であることとする。

3 当社は、業務方法書第53条第1項に規定する任意解約の申込みが当社営業日の午後4時までに行われたものについて、同条第2項の規定による任意解約要件の確認を翌当社営業日の午前11時までに行うものとする。

(清算約定のデクリアーの申込みの方法等)

第30条 業務方法書第53条第1項に規定する当社が定める方法は、MarketWireを用いる方法とする。

2 業務方法書第53条第1項に規定する当社が定める条件は、デクリアー要件の確認を行う日又はその翌営業日が利払日又はアップフロントフィーの決済日にあたらないこととする。

3 当社は、業務方法書第53条第2項の規定によるデクリアー要件の確認を、次の各号に掲げる場合に応じて、当該各号に定める時点までに行うものとする。

(1) 清算約定及びその反対清算約定のデクリアーの申込みが、前当社営業日の午後4時の後、当社営業日の午前11時30分までに行われた場合

当該当社営業日の午後3時30分

(2) 清算約定及びその反対清算約定のデクリアーの申込みが、当社営業日の午前11時30分の後、同日の午後4時までに行われた

	<p>場合</p> <p>当該当社営業日の翌当社営業日の正午</p>
<p>(削る)</p>	<p>4 <u>業務方法書第53条第2項に規定する当社が定める時点は、当社が同項の規定によりデクリアー要件の確認（同条第4項の規定による臨時の確認を含む。）を行った時点とする。</u></p>
<p>(削る)</p>	<p>5 <u>業務方法書第53条第2項に規定する当社が定める内容は、当社が公示により定める。</u></p>
<p>4 <u>業務方法書第53条第3項に規定する当社が定める時点は、当社が同条第2項に規定する任意解約要件の確認（同条第4項の規定による臨時の確認を含む。）を行う日の午前11時とする。</u></p>	<p>6 <u>業務方法書第53条第3項に規定する当社が定める時点は、第3項各号に掲げるデクリアーの申込みの区分に応じて、当該各号に定める時点とする。</u></p>
<p><u>(清算約定の一括コンプレッションの申込み)</u></p>	
<p>第30条の2 <u>業務方法書第53条の2第1項に規定する当社が定める一括コンプレッションの申込みは、清算約定の解約についてはT r i O p t i m a A Bの提供するt r i R e d u c eを用いて申込みをするものとし、新たな清算約定の成立については第9条第2号に規定する当社が通知又は公示により定める照合方法又は電子取引基盤を用いて申込みをするものとする。</u></p>	<p>(新設)</p>
<p>2 <u>業務方法書第53条の2第2項に規定する当社が定める条件は、次に定めるとおりとする。</u></p> <p><u>(1) 一括コンプレッション成立要件の確認を行う日又はその翌営業日が、一括コンプレッションの申込みに係る清算約定及び反対清算約定並びに一括コンプレッションにより新たに成立する清算約定の利払日又はアップフロントフィーの決済日にあたらぬこと。</u></p> <p><u>(2) 一括コンプレッションにより新たに成立する清算約定が第9条に規定する適格金利スワップ取引の要件を満たすこと。</u></p>	
<p>3 <u>当社は、業務方法書第53条の2第2項の規</u></p>	

定による一括コンプレッション成立要件の確認を当該申込みが行われた日の午後3時30分までに行うものとする。

4 業務方法書第53条の2第3項に規定する当社が定める時点は、一括コンプレッション成立要件の確認を行う日の午後3時30分とする。

5 業務方法書第53条の2第4項に規定する当社が定める債務負担の申込みに係る通知を受領しない時間は、一括コンプレッションが行われる日の午後1時から午後3時30分までとする。ただし、当該時間帯の途中において当社が一括コンプレッションの成立を確認した場合は、すみやかに当該債務負担の申込みに係る通知の受領を再開するものとする。

6 業務方法書第53条の2第5項に規定する任意解約手数料は、一括コンプレッションを行う清算参加者が合意した額を、一括コンプレッションが成立した翌々当社営業日に授受するものとする。

7 第3項から第5項の規定にかかわらず、当社が必要と認める場合には、同各項に規定する時限を臨時に変更することができる。この場合において、当社は臨時に時限を変更する旨及び変更後の時限を、全清算参加者に対して通知する。

(有価証券等清算取次ぎの委託に係る通知)

第31条 業務方法書第54条第1項(業務方法書第54条の2第1項において準用する場合を含む。)の規定による有価証券等清算取次ぎの委託に係る通知は、第9条第2号に規定する当社が通知又は公示により定める照合方法又は電子取引基盤を用いる方法により行うものとする。

2 業務方法書第54条第1項(業務方法書第54条の2第1項において準用する場合を含む。)に規定する当社が定める事項は、当社が通知又

(有価証券等清算取次ぎの委託に係る通知)

第31条 業務方法書第54条第1項の規定による有価証券等清算取次ぎの委託に係る通知は、MarketWireを用いる方法により行うものとする。

2 業務方法書第54条第1項に規定する当社が定める事項は、当社が通知又は公示により指定する事項とする。

は公示により指定する事項とする。

(清算取次原取引の要件)

第32条 業務方法書第54条第3項第1号c
(業務方法書第54条の2第1項において準用する場合を含む。)に規定する当社が定める清算取次原取引の要件は、次のすべての要件とする。

(1)・(2) (略)

(有価証券等清算取次ぎの委託に基づく金利スワップ取引の成立)

第33条 業務方法書第55条第1項(業務方法書第55条の2において準用する場合を含む。)に規定する清算委託者から有価証券等清算取次ぎの委託を受けた受託清算参加者と当該委託に係る指定相手方との間の金利スワップ取引は、当該清算委託者及び当該指定相手方(当該指定相手方が有価証券等清算取次ぎの委託を受けた受託清算参加者であるときは、当該委託をした清算委託者)が第9条第2号に規定する当社が通知又は公示により定める照合方法又は電子取引基盤を用いる方法により当社が通知又は公示により指定する事項を当社に通知し、当社において債務負担要件が充足されたことを確認したことを停止条件として、当該確認の時点において同項の規定に従って成立するものとする。

(清算取次原取引と同一である条件)

第34条 業務方法書第54条第3項第2号(業務方法書第54条の2第1項において準用する場合を含む。)に規定する当社が定める制限は、当社が通知で定める委託取引口座毎のリスクに係る制限とする。

2 業務方法書第54条第4項第1号(業務方法書第54条の2第1項において準用する場合を

(清算取次原取引の要件)

第32条 業務方法書第54条第3項第1号cに規定する当社が定める清算取次原取引の要件は、次のすべての要件とする。

(1)・(2) (略)

(有価証券等清算取次ぎの委託に基づく金利スワップ取引の成立)

第33条 業務方法書第55条第1項に規定する清算委託者から有価証券等清算取次ぎの委託を受けた受託清算参加者と当該委託に係る指定相手方との間の金利スワップ取引は、当該清算委託者及び当該指定相手方(当該指定相手方が有価証券等清算取次ぎの委託を受けた受託清算参加者であるときは、当該委託をした清算委託者)がMarketWireを用いる方法により当社が通知又は公示により指定する事項を当社に通知し、当社において債務負担要件が充足されたことを確認したことを停止条件として、当該確認の時点において同項の規定に従って成立するものとする。

(清算取次原取引と同一である条件)

第34条 業務方法書第54条第3項第2号に規定する当社が定める制限は、当社が通知で定める委託取引口座毎のリスクに係る制限とする。

2 業務方法書第54条第4項第1号及び第55条第1項に規定する当社が定める条件は、当社

<p>含む。)及び第55条第1項(業務方法書第55条の2において準用する場合を含む。)に規定する当社が定める条件は、当社が公示により定める。</p>	<p>が公示により定める。</p>
<p>(清算委託取引終了時の清算約定(委託分)の取扱い)</p> <p>第35条 業務方法書第55条第4項(業務方法書第55条の2において準用する場合を含む。)に規定する当社が定める場合は、清算受託契約の定めるところによりすべての清算委託取引が終了した場合とする。</p> <p>2 業務方法書第55条第4項(業務方法書第55条の2において準用する場合を含む。)に規定する当社が定める時点は、清算委託取引の終了について受託清算参加者から当社に届出があった日の翌当社営業日とする。</p>	<p>(清算委託取引終了時の清算約定(委託分)の取扱い)</p> <p>第35条 業務方法書第55条第4項に規定する当社が定める場合は、清算受託契約の定めるところによりすべての清算委託取引が終了した場合とする。</p> <p>2 業務方法書第55条第4項に規定する当社が定める時点は、清算委託取引の終了について受託清算参加者から当社に届出があった日の翌当社営業日とする。</p>
<p>(清算約定(委託分)に関する任意解約又は一括コンプレッションの申込み)</p> <p>第35条の2 業務方法書第57条第1項に規定する当社が定める方法は、第9条第2号に規定する当社が通知又は公示により定める照合方法又は電子取引基盤を用いる方法とする。</p> <p>2 業務方法書第57条第2項に規定する当社が定める方法は、当社が通知又は公示により定める。</p> <p>3 業務方法書第57条の2第2項に規定する当社が定める内容は、当社が通知又は公示により定める。</p>	<p>(新設)</p>
<p>(清算約定(委託分)の承継時に授受する金銭等に関する事項)</p> <p>第35条の3 業務方法書第58条の3第1項に規定する期限前終了手数料及び承継時支払金額は、次に定めるところにより算出するものとす</p>	<p>(新設)</p>

る。

(1) 期限前終了手数料の額は、当該各清算約定について当該終了の日の前当社営業日までに当社から清算参加者に預託すべき変動証拠金の差引累計額（変動証拠金の総支払額から総受取額を控除した額をいう。以下本条において同じ。）と同額とし、差引累計額が正数の場合には当社から清算参加者に期限前終了手数料を支払い、差引累計額が負数の場合には清算参加者から当社に期限前終了手数料を支払うものとする。

(2) 当社、承継清算参加者及び清算委託者は、対象清算約定（業務方法書第58条の2第3項に規定する対象清算約定をいう。）の終了日の前当社営業日までに清算委託者が承継元清算参加者に預託した変動証拠金の差引累計額と同額の承継時支払金額を授受するものとする。この場合において、当該差引累計額が正数の場合には当社から承継清算参加者及び承継清算参加者から清算委託者に承継時支払金額を支払い、差引累計額が負数の場合には清算委託者から承継清算参加者及び承継清算参加者から当社に承継時支払金額を支払う。

2 当社、承継清算参加者、承継元清算参加者及び清算委託者は、前項の規定による承継時支払金額、期限前終了手数料及び変動証拠金の授受を行う（業務方法書第58条の3第1項の規定により当社に預託又は交付されたものを除く。）。

（承継により新たに発生する権利義務に関する事項）

第35条の4 業務方法書第58条の3第2項第1号及び第2号に規定する当社が定める条件は、当社が通知又は公示により定める。（新設）

(ヘッジ口座及びノンヘッジ口座の区分)

第35条の5 清算参加者は、業務方法書第59 (新設)

条第7項の申告及び届出は、清算委託者が主としてヘッジ取引(CFTC Regulation 1.3(k)(k)及び(z)に規定するHedgingに係る取引をいう。以下同じ。)を行っている場合は、当該口座をヘッジ口座として、主としてヘッジ取引以外の目的で取引を行っている場合は、当該口座をノンヘッジ口座として行うものとする。

(変動証拠金所要額)

第38条 業務方法書第78条第1項に規定する当社が定める変動証拠金所要額の算出方法及び同条第2項に規定する当社が定める清算約定(委託分)の変動証拠金所要額の算出方法は、算出日の前当社営業日の午後3時2分における清算イールド・カーブに基づいて当該当社営業日の午後4時の時点における清算約定(当該時点までに業務方法書第53条に規定する任意解約の申込みがなされた適格金利スワップ取引を除く。)について算出した正味現在価値と、算出日の午後3時2分における清算イールド・カーブに基づいて当該算出日の午後4時の時点における各清算約定(当該時点までに業務方法書第53条に規定する任意解約の申込みがなされた適格金利スワップ取引を除く。)について算出した正味現在価値の差額に相当する額を求める方法とする。

2 (略)

(資金決済の方法)

第43条 業務方法書第85条第1項に規定する当社が定める金銭の授受は、次に掲げる金銭の授受とする。

(変動証拠金所要額)

第38条 業務方法書第78条第1項に規定する当社が定める変動証拠金所要額の算出方法及び同条第2項に規定する当社が定める清算約定(委託分)の変動証拠金所要額の算出方法は、算出日の前当社営業日の午後3時2分における清算イールド・カーブに基づいて当該当社営業日の午後4時の時点における清算約定(当該時点までに債務負担の申込みがなされた適格金利スワップ取引を含む。)について算出した正味現在価値と、算出日の午後3時2分における清算イールド・カーブに基づいて当該算出日の午後4時の時点における各清算約定(当該時点までに債務負担の申込みがなされた適格金利スワップ取引を含む。)について算出した正味現在価値の差額に相当する額を求める方法とする。

2 (略)

(資金決済の方法)

第43条 業務方法書第85条第1項に規定する当社が定める金銭の授受は、次に掲げる金銭の授受とする。

(1) ~ (9) (略)

(10) 任意解約手数料

2 ~ 4 (略)

(清算預託金の管理)

第44条 業務方法書第87条第1項に規定する当社が定める方法は、次の各号に掲げる清算預託金(清算委託者が預託した当初証拠金を除く。)の資産区分に応じて、当該各号に定める方法とする。

(1) 金銭

次に掲げる方法により当社の固有資産、他の清算業務に係る預かり資産及び清算委託者の当初証拠金とは分別して保管し、清算参加者ごとに、清算預託金の種類(金利スワップ清算基金、当初証拠金、第三階層特別清算料担保金及び破綻時証拠金の種類をいう。以下本条において同じ。)に区分して帳簿により管理する。

a・b (略)

(2) (略)

(3) 財務省証券

次に掲げる方法により当社の固有財産、他の清算業務に係る預かり資産及び清算委託者の当初証拠金とは分別して保管し、清算参加者ごとに、清算預託金の種類に区分して帳簿により管理する。

a・b (略)

2 清算委託者(次項に規定する清算委託者を除く。以下本項において同じ。)の当初証拠金に係る業務方法書第87条第1項に規定する当社が定める方法は、次の各号に掲げる清算委託者の当初証拠金の資産区分に応じて、当該各号に定める方法とする。

(1) 金銭

次に掲げる方法により当社の固有資産、他

(1) ~ (9) (略)

(新設)

2 ~ 4 (略)

(清算預託金の管理)

第44条 業務方法書第87条第1項に規定する当社が定める方法は、次の各号に掲げる清算預託金の資産区分に応じて、当該各号に定める方法とする。

(1) 金銭

次に掲げる方法により当社の固有資産及び他の清算業務に係る預かり資産とは分別して保管し、清算参加者ごとに、清算預託金の種類(金利スワップ清算基金、当初証拠金、第三階層特別清算料担保金及び破綻時証拠金の種類をいう。以下本条において同じ。)に区分して帳簿により管理する。

a・b (略)

(2) (略)

(3) 財務省証券

次に掲げる方法により当社の固有財産とは分別して保管し、清算参加者ごとに、清算預託金の種類に区分して帳簿により管理する。

a・b (略)

(新設)

の清算業務に係る預かり資産及び清算参加者が預託した清算預託金とは分別して保管し、清算委託者ごとに区分して帳簿により管理する。

- a 当社名義の決済性預金口座への預金
- b 信託業務を営む銀行への金銭信託

(2) 国債証券

次に掲げる方法により当社の固有財産とは分別して保管し、清算委託者ごとに区分して帳簿により管理する。

- a 日本銀行の国債振替決済制度において日本銀行に開設された当社名義の分別管理口座への記録
- b 信託業務を営む銀行への信託

(3) 財務省証券

次に掲げる方法により当社の固有財産、他の清算業務に係る預かり資産及び清算参加者が預託した清算預託金とは分別して保管し、清算委託者ごとに区分して帳簿により管理する。

- a アメリカ合衆国ニューヨーク州ニューヨーク市に所在する銀行に開設された当社名義の口座への記録
- b 信託業務を営む銀行への信託

3 FCM清算参加者 (U. S. C o m m o d i (新設)

t y E x c h a n g e A c t に規定された F u t u r e s C o m m i s s i o n M e r c h a n t (以下「FCM」という。以下同じ。)である清算参加者をいう。)と清算受託契約を締結した清算委託者の当初証拠金に係る業務方法書第87条第1項に規定する当社が定める方法は、C F T C R e g u l a t i o n 1. 4 9に基づき信託業務を営む銀行への信託日本銀行に預託により当社の固有資産、他の清算業務に係る預かり資産、清算参加者が預託した清算預託金及び前項の清算委託者が預託した当初証

<p><u>拠金とは分別して保管し、清算委託者ごとに区分して帳簿により管理する方法とする。</u></p>	
<p><u>(清算預託金の運用)</u></p>	
<p><u>第44条の2 業務方法書第87条第2項に規定する運用は、FCM清算参加者と清算受託契約を締結している清算委託者に係る当初証拠金以外の清算預託金を対象とする。</u></p>	<p>(新設)</p>
<p><u>(FCMの登録に関する届出)</u></p>	
<p><u>第47条の2 清算参加者は、FCMとして登録しようとする場合又はFCMとしての登録を抹消しようとする場合には、あらかじめその旨を当社に届け出るものとする。</u></p>	<p>(新設)</p>
<p><u>(FCM清算参加者の報告事項)</u></p>	
<p><u>第47条の3 FCM清算参加者は、CFTC Regulation 22.14 (c) (2) に基づき当社に報告するものとする。</u></p>	<p>(新設)</p>
<p><u>2 FCM清算参加者は、CFTC Regulation Part 17及びPart 20に基づきU. S. Commodity Futures Trading Commission に対して報告した場合は、当該報告に係る写しを提出することにより当社に報告するものとする。</u></p>	
<p style="text-align: center;">付 則</p> <p>この改正規定は、平成26年2月24日から施行する。</p>	
<p>別表2 当初証拠金所要額の算出方法</p>	<p>別表2 当初証拠金所要額の算出方法</p>

1 当初証拠金所要額

(1) 清算約定（自己分）に係る当初証拠金所要額

a 清算約定（自己分）に係る当初証拠金所要額は、自己取引口座の算出日の午後4時時点における清算約定（当該時点までに業務方法書第53条に規定する任意解約の申込みがなされた清算約定を除く。以下本号において同じ。）の同日午後3時2分時点の清算イールド・カーブに基づき算出した正味現在価値について、想定変動イールド・カーブにより算出した正味現在価値の変動額を算出し、当該変動額が負の数となるものについてその絶対値が最も大きい額をいう。ただし、当社が市場環境の急激な変化が生じた場合その他当社の金利スワップ取引清算業務の適切な遂行を確保する観点から必要と認める場合には、当該額を臨時に変更することができる。

b (略)

(2) 清算約定（委託分）（業務方法書第94条に定める清算委託者以外の清算委託者に係るものに限る。）に係る当初証拠金所要額

前号の規定は、清算約定（委託分）に係る当初証拠金所要額の算出について準用する。この場合において、同号中「自己取引口座の」とあるのは「各委託取引口座の」と読み替えるものとする。

(3) 清算約定（委託分）（業務方法書第94条に定める清算委託者に係るものに限る。）

1 当初証拠金所要額

(1) 清算約定（自己分）に係る当初証拠金所要額

a 清算約定（自己分）に係る当初証拠金所要額は、自己取引口座の算出日の午後4時時点における清算約定（当該時点までに債務負担の申込みがなされた適格金利スワップ取引を含む。以下本号において同じ。）の同日午後3時2分時点の清算イールド・カーブに基づき算出した正味現在価値について、想定変動イールド・カーブにより算出した正味現在価値の変動額を算出し、当該変動額が負の数となるものについてその絶対値が最も大きい額をいう。ただし、当社が市場環境の急激な変化が生じた場合その他当社の金利スワップ取引清算業務の適切な遂行を確保する観点から必要と認める場合には、当該額を臨時に変更することができる。

b (略)

(2) 清算約定（委託分）に係る当初証拠金所要額

前号の規定は、清算約定（委託分）に係る当初証拠金所要額の算出について準用する。この場合において、同号中「自己取引口座の」とあるのは「各委託取引口座の」と読み替えるものとする。ただし、当社が市場環境の急激な変化が生じた場合その他当社の金利スワップ取引清算業務の適切な遂行を確保する観点から必要と認める場合には、当該額を臨時に変更することができる。

(新設)

に係る当初証拠金所要額（ノンヘッジ口座に係るものを除く。）

第1号の規定は、本号に規定する当初証拠金所要額の算出について準用する。この場合において、同号中「自己取引口座の」とあるのは「各委託取引口座の」と、「5日間の変動率」とあるのは「7日間の変動率」と読み替えるものとする（以下、本号における想定変動イールド・カーブを「特別想定変動イールド・カーブ」という。）。

(4) ノンヘッジ口座に係る当初証拠金所要額

前号本文の規定により算出した当初証拠金所要額に1.1を乗じた額とする。

2 日中証拠金所要額

(1) 清算約定（自己分）に係る日中証拠金所要額

a 清算約定（自己分）に係る日中証拠金所要額は、自己取引口座の算出日の正午時点における清算約定について算出した当初証拠金相当額に変動証拠金相当額を加減した額とする。ただし、当社が市場環境の急激な変化が生じた場合その他当社の金利スワップ取引清算業務の適切な遂行を確保する観点から必要と認める場合には、当該額を臨時に変更することができる。

b (略)

c 上記 a に規定する「変動証拠金相当額」とは、算出日の前当社営業日の午後4時の時点における清算約定（当該時点までに業務方法書第53条に規定する任意解約の申込みがなされた適格金利スワップ取引を除く。）について、同日の午後3時2分時点

(新設)

2 日中証拠金所要額

(1) 清算約定（自己分）に係る日中証拠金所要額

a 清算約定（自己分）に係る日中証拠金所要額は、自己取引口座の算出日の正午時点における清算約定（当該時点までに債務負担の申込みがなされた適格金利スワップ取引を含む。以下本号において同じ。）について算出した当初証拠金相当額に変動証拠金相当額を加減した額とする。ただし、当社が市場環境の急激な変化が生じた場合その他当社の金利スワップ取引清算業務の適切な遂行を確保する観点から必要と認める場合には、当該額を臨時に変更することができる。

b (略)

c 上記 a に規定する「変動証拠金相当額」とは、算出日の前当社営業日の午後4時の時点における清算約定（当該時点までに債務負担の申込みがなされた適格金利スワップ取引を含む。）について、同日の午後3時2分時点の清算イールド・カーブに基づ

の清算イールド・カーブに基づいて算出した正味現在価値と、前 a に規定する清算約定について、算出日の午前 11 時 2 分時点の清算イールド・カーブに基づいて算出した正味現在価値の差額に相当する額とする。

(2) 清算約定（委託分）（業務方法書第 9 4 条に定める清算委託者以外の清算委託者に係るものに限る。）に係る日中証拠金所要額

前号の規定は、清算約定（委託分）に係る日中証拠金所要額の算出について準用する。この場合において、同号中「自己取引口座の」とあるのは「各委託取引口座の」と読み替えるものとする。

(3) 清算約定（委託分）（業務方法書第 9 4 条に定める清算委託者に係るものに限る。）に係る日中証拠金所要額（ノンヘッジ口座に係るものを除く。）

第 1 号の規定は、本号に規定する日中証拠金所要額の算出について準用する。この場合において、同号中「自己取引口座の」とあるのは「各委託取引口座の」と、「前項第 1 号 b に定める「想定変動イールド・カーブ」とあるのは、「前項第 3 号に定める特別想定変動イールド・カーブ」と読み替えるものとする。

(4) ノンヘッジ口座に係る日中証拠金所要額

前号の規定により算出した日中証拠金所要額に 1.1 を乗じた額とする。

3 債務負担時所要証拠金

いて算出した正味現在価値と、前 a に規定する清算約定について、算出日の午前 11 時 2 分時点の清算イールド・カーブに基づいて算出した正味現在価値の差額に相当する額とする。

(2) 清算約定（委託分）に係る日中証拠金所要額

前号の規定は、清算約定（委託分）に係る日中証拠金所要額の算出について準用する。この場合において、同号中「自己取引口座の」とあるのは「各委託取引口座の」と読み替えるものとする。ただし、当社が市場環境の急激な変化が生じた場合その他当社の金利スワップ取引清算業務の適切な遂行を確保する観点から必要と認める場合には、当該額を臨時に変更することができる。

(新設)

(新設)

(新設)

(1) 清算約定（自己分）に係る債務負担時
所要証拠金

a 清算約定（自己分）に係る債務負担時所要証拠金は、当社が業務方法書第48条第1項に規定する債務負担の申込みに係る通知を受領した時点における自己取引口座の清算約定に当該申込みに係る適格金利スワップ取引を加えた清算約定について算出した当初証拠金相当額に変動証拠金相当額を加減した額とする。ただし、当社が市場環境の急激な変化が生じた場合その他当社の金利スワップ取引清算業務の適切な遂行を確保する観点から必要と認める場合には、当該額を臨時に変更することができる。

b 前aに規定する「当初証拠金相当額」とは、前aの債務負担の申込みを受領した日（以下本項において「申込受領日」という。）の午前11時2分時点（午前11時から正午までの間に債務負担の申込みを受領した場合は、当該申込受領日の前当社営業日の午後3時2分時点）における気配値を基に作成した清算イールド・カーブに基づいて算出した正味現在価値について、第1項第1号bに定める想定変動イールド・カーブにより算出した正味現在価値の変動額を算出し、当該変動額が負の数となるものについてその絶対値が最も大きい額とする。

c 上記aに規定する「変動証拠金相当額」とは、申込受領日の午前11時の時点における清算約定について、申込受領日の前当社営業日の午後3時2分時点の清算イールド・カーブに基づいて算出した正味現在価値と、前aに規定する清算約定について、申込受領日の午前11時2分時点の清算イールド・カーブ（午前11時から正午までの間に債務負担の申込みを受領した場合

は、当該申込受領日の前当社営業日の午後3時2分時点における気配値を基に作成した清算イールド・カーブ)に基づいて算出した正味現在価値の差額に相当する額とする。

(2) 清算約定(委託分)(業務方法書第94条に定める清算委託者以外の清算委託者に係るものに限る。)に係る債務負担時所要証拠金

前号の規定は、清算約定(委託分)に係る債務負担時所要証拠金の算出について準用する。この場合において、同号中「自己取引口座の」とあるのは「各委託取引口座の」と読み替えるものとする。

(3) 清算約定(委託分)(業務方法書第94条に定める清算委託者に係るものに限る。)に係る債務負担時所要証拠金(ノンヘッジ口座に係るものを除く。)

第1号の規定は、本号に規定する債務負担時所要証拠金の算出について準用する。この場合において、同号中「自己取引口座の」とあるのは「各委託取引口座の」と、「第1項第1号bに定める想定変動イールド・カーブ」とあるのは、「第1項第3号に定める特別想定変動イールド・カーブ」と読み替えるものとする。

(4) ノンヘッジ口座に係る債務負担時所要証拠金

前号の規定により算出した債務負担時所要証拠金に1.1を乗じた額とする。

様式第3号 清算受託契約の様式

(定義)

第2条 本契約において使用する用語は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)及び業務

様式第3号 清算受託契約の様式

(定義)

第2条 本契約において使用する用語は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)及び業務

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) 「委託清算約定」とは、本契約に基づ
く乙の有価証券等清算取次ぎの委託に基づ
き、甲とクリアリング機構の間に成立する清
算約定をいう。

(2) (略)

(3) 「期限前終了金額」とは、第30条の
規定によりすべての本清算委託取引が終了し
た場合に甲乙間で授受すべき金銭をいう。

(4)～(7) (略)

(8) 「承継」とは、業務方法書等の定める
ところにより、クリアリング機構、承継清算
参加者及び乙の間で乙を当事者とする清算委
託取引及び当該清算委託取引に係る清算約定
(委託分)に係る権利義務を新たに発生させ
るとともに、それに伴う金銭の授受及び権利
義務の処理を行うことをいう。

(9) 「承継清算参加者」とは、承継により
発生する権利義務の当事者となる甲以外の清
算参加者をいう。

(10) 「本清算委託取引」とは、本契約に
基づく個別の有価証券等清算取次ぎの委託に
より成立する甲乙間の法律関係であって、当
該委託により成立する委託清算約定と同一の
経済的効果を有するものをいう。

(有価証券等清算取次ぎの委託)

第4条 (略)

2 (略)

3 前項の規定にかかわらず、乙が甲と同一の企
業集団に含まれない者である場合、前項の規定
中「委託を申込み、甲がこれを承諾したもの」
とあるのは、「委託の申込みを行ったもの」と
読み替えられるものとする。

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) 「委託清算約定」とは、乙の有価証券
等清算取次ぎの委託に基づき、甲とクリアリ
ング機構の間に成立する清算約定をいう。

(2) (略)

(3) 「期限前終了金額」とは、第30条の
規定によりすべての委託清算約定が終了した
場合に甲乙間で授受すべき金銭をいう。

(4)～(7) (略)

(新設)

(新設)

(新設)

(有価証券等清算取次ぎの委託)

第4条 (略)

2 (略)

(新設)

<p>4 前2項の規定は、次のいずれかに該当する場合には、適用しない。</p>	<p>3 前項の規定は、次のいずれかに該当する場合には、適用しない。</p>
<p>(1)・(2) (略)</p>	<p>(1)・(2) (略)</p>
<p>5 第3項の規定による読替え後の第2項の規定により甲に対して有価証券等清算取次ぎの委託の申込みが行われたものとみなされ、業務方法書等の規定に従いクリアリング機構が甲に対して当該申込みに係る通知を行った場合には、甲は、当該通知に係る金利スワップ取引の有価証券等清算取次ぎの委託の申込みに対する諾否について、クリアリング機構に対して通知するものとする。</p>	<p>(新設)</p>
<p>(委託清算約定の成立)</p>	<p>(委託清算約定の成立)</p>
<p>第5条 (略)</p>	<p>第5条 (略)</p>
<p>2 前項の規定にかかわらず、乙が甲と同一の企業集団に含まれない者である場合、前項の規定中「同条第2項の規定により有価証券等清算取次ぎの申込み及び承諾があったものとみなされる」とあるのは、「甲が同条第5項の規定により有価証券等清算取次ぎの委託の申込みについて承諾する旨をクリアリング機構に対して通知したとき」と読み替えられるものとする。</p>	<p>(新設)</p>
<p>3 前2項の規定により甲及び指定相手方との間で金利スワップ取引が成立した場合には、業務方法書等の定めるところにより、甲及び当該指定相手方が、クリアリング機構に対して当該金利スワップ取引に係る債務負担の申込みに係る通知をしたものとみなされる。</p>	<p>2 前項の規定により甲及び指定相手方との間で金利スワップ取引が成立した場合には、業務方法書等の定めるところにより、甲及び当該指定相手方が、クリアリング機構に対して当該金利スワップ取引に係る債務負担の申込みに係る通知をしたものとみなされる。</p>
<p>4 (略)</p>	<p>3 (略)</p>
<p>第7条 削除</p>	<p>(デクリアーの申込みに係る代理権の付与)</p>
	<p>第7条 甲は、乙に対して、本契約及び業務方法書等の定めるところにより、甲を代理し、クリアリング機構に対し委託清算約定に関するデクリアーの申込みをする権限を付与する。</p>

(決済金額の授受)
第8条 乙は、甲が委託清算約定について決済金額をクリアリング機構に交付すべき場合には、当該決済金額に相当する金銭を、クリアリング機構への交付時限 (乙による交付が実務上困難な場合には、翌々J S C C営業日における当該時限) までの甲乙間で合意する時限までに、甲乙が合意する方法により甲に交付する。

2 (略)

(清算取次口座)
第9条 甲は、本清算委託取引の内容、本清算委託取引に係る当初証拠金、委託当初証拠金、変動証拠金その他本契約並びに業務方法書等に基づいて乙との間で授受される金銭等を管理するための口座 (以下「本清算取次口座」という。) を開設する。

2 甲は、乙の請求があった場合には、乙のために開設した本清算取次口座を複数に区分する口座を開設することができる。

(ヘッジ口座・ノンヘッジ口座に関する申告)

第9条の2 乙は、業務方法書等の定めるところにより、甲に対し、本清算取次口座に対応する委託取引口座に係るヘッジ口座又はノンヘッジ口座の種別について申告を行うものとする。当該種別を変更する場合も同様とする。

(当初証拠金の預託義務)

第11条 (略)

2 委託清算約定に係る当初証拠金所要額は、業務方法書等の定めるところにより、クリアリング機構が算出するものとし、甲は当該所要額を乙に対して通知するものとする。

3 (略)

(決済金額の授受)
第8条 乙は、甲が委託清算約定について決済金額をクリアリング機構に交付すべき場合には、当該決済金額に相当する金銭を、クリアリング機構への交付時限までの甲が定める時限までに、甲が定める方法により甲に交付する。

2 (略)

(清算取次口座)
第9条 甲は、清算委託取引の内容、清算委託取引に係る当初証拠金、委託当初証拠金、変動証拠金その他本契約並びに業務方法書等に基づいて乙との間で授受される金銭等を管理するための口座 (以下「清算取次口座」という。) を開設する。

2 甲は、乙の請求があった場合には、乙のために開設した清算取次口座を複数に区分する口座を開設することができる。

(新設)

(当初証拠金の預託義務)

第11条 (略)

2 委託清算約定に係る当初証拠金所要額は、業務方法書等の定めるところにより、クリアリング機構が算出するものとする。

3 (略)

(当初証拠金の預託時限)

第13条 乙は、各JSCC営業日において、委託清算約定に係る当初証拠金(以下単に「当初証拠金」という。)としてクリアリング機構に預託した金銭及び代用有価証券の額並びに本清算委託取引に係る委託当初証拠金(以下単に「委託当初証拠金」という。)として甲に預託した金銭及び代用有価証券の額の合計額(以下「当初証拠金等預託額」という。)が当初証拠金預託必要額に不足する場合には、その不足が生じた日の翌JSCC営業日(乙が不足額を預託するための業務執行手順を構築することが実務上困難であると甲乙間であらかじめ合意した場合は、当該不足額が発生した日の翌々JSCC営業日)のクリアリング機構への預託時限までの甲乙間で合意する日時までに、その不足額を甲に交付するものとする。

(日中証拠金の預託義務)

第14条 (略)

2 委託清算約定に係る日中証拠金所要額は、業務方法書等の定めるところにより、クリアリング機構が算出するものとし、甲は当該所要額を乙に対して通知するものとする。

(日中証拠金の預託時限)

第15条 乙は、当初証拠金等預託額が、クリアリング機構に預託すべき日中証拠金預託必要額に不足する場合には、その不足が生じた日(乙が不足額を預託するための業務執行手順を構築することが実務上困難であると甲乙間であらかじめ合意した場合は、当該不足額が発生した日の翌々JSCC営業日まで)のクリアリング機構への預託時限までの甲乙間で合意する日時までに、その不足額を甲に交付するものとする。

(当初証拠金の預託時限)

第13条 乙は、各JSCC営業日において、当初証拠金としてクリアリング機構に預託した金銭及び代用有価証券の額並びに委託当初証拠金として甲に預託した金銭及び代用有価証券の額の合計額(以下「当初証拠金預託額」という。)が当初証拠金預託必要額に不足する場合には、その不足が生じた日の翌JSCC営業日(乙が非居住者である場合は、当該不足額が発生した日から起算して3JSCC営業日)までの甲が指定する日時までに、その不足額を甲に交付するものとする。

(日中証拠金の預託義務)

第14条 (略)

2 委託清算約定に係る日中証拠金所要額は、業務方法書等の定めるところにより、クリアリング機構が算出するものとする。

(日中証拠金の預託時限)

第15条 乙は、当初証拠金預託額が、当社に預託すべき日中証拠金預託必要額に不足する場合には、その不足が生じた日(乙が非居住者である場合は、当該不足額が発生した日の翌JSCC営業日まで)の甲が指定する日時までに、その不足額を甲に交付するものとする。

2 当初証拠金等預託額が、クリアリング機構の債務負担により再計算された債務負担時所要証拠金の額以上となった場合には、日中証拠金預託必要額（日中証拠金について甲乙間に別段の合意がない場合に限る。）の不足は解消されたものとする。

（差換預託）

第16条 第12条の規定にかかわらず、甲は、あらかじめ乙の書面による同意を得て、乙から交付を受けた金銭又は代用有価証券を委託当初証拠金として保管することができる。

2・3 （略）

（当初証拠金の返還請求権）

第17条 クリアリング機構に対する当初証拠金の返還請求権は、次の各号に掲げる者が、当該各号に定める金額に相当する部分について有するものとする。

（1） 乙

乙がクリアリング機構に預託した当初証拠金の額及び甲が委託清算約定に関してクリアリング機構に預託した差換当初証拠金の合計額（以下「当初証拠金預託総計額」という。）から甲が委託清算約定に関してクリアリング機構に対して負担する未履行債務（甲の破綻等その他の事由による当該委託清算約定の処理に伴って生じる債務のうち未履行であるものを含む。以下本項において同じ。）の額を控除した額の範囲内で、乙がクリアリング機構に預託した当初証拠金の額及び甲が委託清算約定に関してクリアリング機構に預託した差換当初証拠金の額のうち乙が甲に預託した委託当初証拠金の額の合計額から、乙が本清算委託取引に関して甲に対して負担する未履

（新設）

（差換預託）

第16条 第11条、第12条及び第12の3の規定にかかわらず、甲は、あらかじめ乙の書面による同意を得て、乙から交付を受けた金銭又は有価証券を委託当初証拠金として保管することができる。

2・3 （略）

（当初証拠金の返還請求権）

第17条 クリアリング機構に対する当初証拠金に関する返還請求権は、次の各号に掲げる者が、当該各号に定める金額に相当する部分について有するものとする。

（1） 乙

乙がクリアリング機構に預託した当初証拠金の額及び甲がクリアリング機構に預託した差換当初証拠金の額のうち乙が甲に預託した委託当初証拠金の額を限度として業務方法書等で定める額の合計額から、乙が清算委託取引に関して甲に対して負担する未履行債務（当該清算委託取引の終了に伴って生じる債務のうち未履行であるものを含む。）の額又は未払いの期限前終了金額を控除した額

行債務（当該本清算委託取引の終了に伴って生じる債務のうち未履行であるものを含む。）の額又は未払いの期限前終了金額を控除した額

(2) 甲

当初証拠金預託総計額から、甲が委託清算約定に関してクリアリング機構に対して負担する未履行債務の額及び第1号の額の合計額を控除した額

2～6 (略)

(変動証拠金)

第20条 (略)

2 委託清算約定に係る変動証拠金所要額は、業務方法書等の定めるところにより、クリアリング機構が算出するものとし、甲は当該所要額を乙に対して通知するものとする。

(変動証拠金の授受)

第21条 乙は、甲が委託清算約定に係る変動証拠金をクリアリング機構に交付すべき場合には、当該変動証拠金に相当する金銭を、当該変動証拠金の算出日の翌JSCC営業日（乙が交付するための業務執行手順を構築することについて実務上困難であると甲乙間であらかじめ合意した場合は、変動証拠金算出日から起算して翌々JSCC営業日）のクリアリング機構への交付時限までの甲乙間で合意する時限までに、甲乙間で合意する方法により甲に交付する。

2 (略)

(変動証拠金に係る利息の授受)

(2) 甲

乙がクリアリング機構に預託した当初証拠金の額及び甲がクリアリング機構に預託した差換当初証拠金の額の合計額から、甲が委託清算約定に関してクリアリング機構に対して負担する未履行債務（甲の破綻等その他の事由による委託清算約定の処理に伴って生じる債務のうち未履行であるものを含む。）の額及び第1号の額の合計額を控除した額

2～6 (略)

(変動証拠金)

第20条 (略)

(新設)

(変動証拠金の授受)

第21条 乙は、甲が委託清算約定に係る変動証拠金をクリアリング機構に交付すべき場合には、当該変動証拠金に相当する金銭を、当該変動証拠金の算出日の翌JSCC営業日（乙が非居住者である場合は、変動証拠金算出日から起算して3JSCC営業日目）のクリアリング機構への交付時限までの甲が定める時限までに、甲が定める方法により甲に交付する。

2 (略)

(変動証拠金に係る利息の授受)

第22条 (略)

2 乙は、甲が変動証拠金に係る利息をクリアリング機構に交付すべき場合には、当該利息に相当する金銭を、クリアリング機構への交付時限までの甲乙間で合意する時限（乙による交付が実務上困難な場合には、翌々JSCC営業日における当該時限）までに、甲乙間で合意する方法により甲に交付する。

3 (略)

(変動証拠金の返還請求権)

第23条 甲及び乙は、本契約及び業務方法書等の定めるところにより授受及び返還を行う場合を除くほか、相手方に対し、本清算委託取引に係る変動証拠金の返還を請求することができない。

(期限の利益喪失事由が発生している場合等の証拠金の返還請求権の取扱い)

第26条 乙は、次に掲げる場合には、すべての本清算委託取引の決済が完了するまでの間、クリアリング機構及び甲に対し、本契約に基づいて預託又は交付した証拠金（以下単に「証拠金」という。）の返還請求権を行使することができない。

(1)・(2) (略)

2・3 (略)

(変動証拠金等に相当する金銭の決済の方法)

第26条の2 甲及び乙は、変動証拠金等に相当する金銭の総受取額と総支払額を差引計算して授受することができる。

(当初証拠金及び変動証拠金等の差引計算)

第26条の3 前条の規定により差引計算した結果、乙が甲に対し変動証拠金等に相当する金銭

第22条 (略)

2 乙は、甲が変動証拠金に係る利息をクリアリング機構に交付すべき場合には、当該利息に相当する金銭を、クリアリング機構への交付時限までの甲が定める時限までに、甲が定める方法により甲に交付する。

3 (略)

(変動証拠金の返還請求権)

第23条 甲及び乙は、本契約及び業務方法書等の定めるところにより授受及び返還を行う場合を除くほか、相手方に対し、変動証拠金の返還を請求することができない。

(期限の利益喪失事由が発生している場合等の証拠金の返還請求権の取扱い)

第26条 乙は、次に掲げる場合には、すべての清算委託取引の決済が完了するまでの間、クリアリング機構及び甲に対し、証拠金の返還請求権を行使することができない。

(1)・(2) (略)

2・3 (略)

(新設)

(新設)

を支払うこととなる場合には、当該金銭の支払い及び第11条に規定する当初証拠金の預託については、次に掲げる計算式の順序に従って差引計算するものとし、それぞれ算出された額が負の数になる場合には、乙は甲に対し当該額を預託するものとする。ただし、第1号に係る預託については、金銭により預託しなければならない。

(1) (前JSCC営業日末時点における当初証拠金等預託額のうち金銭による預託額)

－ (同時点において乙が甲に支払うこととなる変動証拠金等に相当する金銭の額)

(2) (前JSCC営業日末時点における当初証拠金等預託額－充当金銭預託額(前号による差引計算の結果、乙が甲に支払うこととなる変動証拠金等に相当する金銭に充当された当初証拠金等預託額のうち金銭による預託額をいう。))－(同時点における当初証拠金預託必要額)

2 前条の規定により差引計算した結果、乙が甲から変動証拠金等に相当する金銭を受領することとなる場合には、当該金銭の支払い及び第11条に規定する当初証拠金の預託については、次に掲げる計算式に従って差引計算するものとし、算出された額が負の数になる場合には、乙は甲に対し当該額を預託するものとする。

(前JSCC営業日末時点における当初証拠金等預託額＋同時点において乙が甲から受領することとなる変動証拠金等に相当する金銭の額)－(前JSCC営業日末時点における当初証拠金預託必要額)

(返戻の申請及び当初証拠金のみなし預託)

第26条の4 前条の差引計算の結果、乙が変動証拠金等に相当する金銭を受領することとなる場合には、甲に対し、受領する金銭の額を明ら

(新設)

<p>かにしたうえで申請を行うことにより、当該金銭を受領するものとする。</p>	
<p>2 前項の申請がなされなかった場合、乙が受領することとなる変動証拠金等に相当する金銭は、当初証拠金として預託されたものとみなす。</p>	
<p>第4章 委託清算約定の<u>任意解約及び一括コンプレッション</u></p>	<p>第4章 委託清算約定の<u>デクリアー</u></p>
<p>(委託清算約定に関する<u>任意解約又は一括コンプレッション</u>の申込み)</p>	<p>(委託清算約定に関する<u>デクリアー</u>の申込み)</p>
<p>第27条 乙は、甲に対して任意解約又は一括コンプレッションの申込みの指図をしようとする場合には、業務方法書等の定めるところにより、その旨をクリアリング機構に通知するものとする。</p>	<p>第27条 乙は、甲を代理して、クリアリング機構に対して委託清算約定のデクリアーの申込みをすることができる。</p>
<p>2 甲及び乙は、前項の通知がクリアリング機構に到達した場合には、業務方法書等の定めるところにより、乙が甲に対し任意解約又は一括コンプレッションの申込みの指図を行い、甲がこれを承諾し申込みを行ったものとみなされることについて本契約をもってあらかじめ同意する。</p>	<p>(新設)</p>
<p>3 前項の規定にかかわらず、乙が甲と同一の企業集団に含まれない者である場合、前項の規定中「申込みの指図を行い、甲がこれを承諾し申込みを行ったもの」とあるのは、「申込みの指図を行ったもの」と読み替えられるものとする。</p>	<p>(新設)</p>
<p>4 前項の規定による読替え後の第2項の規定により甲に対して任意解約又は一括コンプレッションの申込みの指図が行われたものとみなされ、業務方法書等の規定に従いクリアリング機構が甲に対して当該申込みの指図に係る通知を行った場合には、甲は、当該通知に係る任意解約及び一括コンプレッションの申込みの指図に対する諾否について、クリアリング機構に対し</p>	<p>(新設)</p>

て通知するものとする。

(任意解約又は一括コンプレッションによる本清算委託取引の終了)

第28条 任意解約又は一括コンプレッションにより委託清算約定が終了した場合には、当該委託清算約定に係る本清算委託取引も当然に終了するものとする。この場合において、当該本清算委託取引に関し、甲乙間に未決済の金銭がある場合には、甲及び乙は、速やかに当該金銭の授受を行うものとする。

(削る)

(一括コンプレッションによる本清算委託取引の成立)

第28条の2 一括コンプレッションにより甲とクリアリング機構の間に新たな委託清算約定が成立した場合には、甲乙間において当該委託清算約定に係る本清算委託取引が同時に成立するものとする。

第4章の2 清算委託取引等の承継等

(他の清算参加者への本清算委託取引等の承継)

第28条の3 乙は、業務方法書等の定めに従い、承継清算参加者を經由してクリアリング機構にクリアリング機構所定の承継申込書を交付し、

(デクリアーによる清算委託取引の終了)

第28条 デクリアーにより委託清算約定が終了した場合には、当該委託清算約定に係る清算委託取引も当然に終了するものとする。この場合において、当該清算委託取引に関し、甲乙間に未決済の金銭がある場合には、甲及び乙は、速やかに当該金銭の授受を行うものとする。

2. 前項の場合、デクリアーによる委託清算約定及びその反対清算約定の終了と同時に、乙及び当該反対清算約定の当事者である清算参加者（当該反対清算約定が有価証券等清算取次ぎの委託に基づくものであるときは、当該有価証券等清算取次ぎの基となった清算取次原取引の当事者である清算委託者）の間において、業務方法書等の定めるところにより、クリアリング機構が定める内容の金利スワップ取引が成立する。

(新設)

(新設)

当該承継の申込みをクリアリング機構が承諾した場合には、乙が承継清算参加者への承継を希望する委託清算約定（以下「対象委託清算約定」という。）に係る次に掲げる権利義務を一括して承継清算参加者に承継させることができる。

（１） 甲及びクリアリング機構の間を対象委託清算約定に係る権利義務（第５項の規定により対象委託清算約定が終了する直前のもの）と業務方法書等の定める条件が同一となる権利義務

（２） 甲及び乙の間の本清算委託取引に係る権利義務（第５項の規定により対象委託清算約定に係る本清算委託取引が終了する直前のもの）と業務方法書等の定める条件が同一となる権利義務

2 甲及び乙は、前項の規定により承継清算参加者が前項に掲げる権利義務を承継した場合（乙のすべての委託清算約定に係る権利義務を承継した場合に限る。）には、当該承継の時点で、第１７条の規定により乙が返還請求権を有する当初証拠金が承継清算参加者を代理人としてクリアリング機構に預託された当初証拠金とみなされることについて、本契約をもってあらかじめ同意する。

3 乙は、第１項の規定によりクリアリング機構に対して承継の申込みをする場合には、あらかじめ、承継清算参加者に対して当該承継の申込みをし、その承諾を得るとともに、甲に対して当該承継の申込みを行う旨を通知するものとする。この場合において、業務方法書等の定めるところにより当該承継が行われたと仮定してクリアリング機構が算出する委託清算約定に係る当初証拠金及び変動証拠金所要額その他委託清算約定に関して甲乙間で授受すべき金額（前項の規定により承継先清算参加者を代理人としてクリアリング機構に預託されたものとみなされ

る当初証拠金を除く。)について、クリアリング機構への交付時限までの甲乙間で合意する日時までに、甲乙間で合意する方法により、甲に対して交付するものとする。

4 第1項の規定により行われた承継の申込みについて、クリアリング機構が承諾した場合には、当該承諾の時点をもって第1項に掲げる権利義務がクリアリング機構、承継清算参加者及び乙の間でそれぞれ発生するものとする。

5 業務方法書等の定めるところによりクリアリング機構、承継清算参加者及び乙の間で承継が成立した場合には、当該成立と同時にクリアリング機構と甲の間の対象委託清算約定及び甲乙間の対象委託清算約定に係る本清算委託取引は、当然に終了する。

(他の清算参加者からの清算委託取引等の承継)

第28条の4 乙の有価証券等清算取次ぎの委託に基づき乙の計算において成立している他の清算参加者(乙との間で清算受託契約を締結している清算参加者に限る。以下本条において「承継元清算参加者」という。)の清算約定(委託分)その他業務方法書等に定める権利義務(以下「承継対象清算約定等」という。)について、業務方法書等の定めるところにより、乙が甲に対して当該承継対象清算約定等の承継の申込みをし、甲がこれを承諾しクリアリング機構に対して承継申込書を提出した場合には、甲は、業務方法書等の定めるところにより、当該承継対象清算約定等を承継する。

2 甲は、前項の規定により承継元清算参加者の承継対象清算約定等を承継する旨を承諾し、かつ乙から業務方法書等の定めるところにより承継申込書の交付を受けた場合には、承継を希望する日の前JSCC営業日の午後1時までに、クリアリング機構に対して、当該承継申込書(甲

が当該承継の申込みを受けた旨、当該承諾をした旨及びクリアリング機構に承継の申込みをする旨並びに乙が承継元清算参加者に対して当該承継について通知をした旨及びクリアリング機構に承継の申込みをする旨が記載されていることを要する。)を提出しなければならない。

3 第1項の規定により甲が承継元清算参加者の承継対象清算約定等を承継した場合、承継した承継元清算参加者の承継対象清算約定等を本契約における委託清算約定及び本清算委託取引とみなして、本契約の規定を適用する。

4 甲及び乙は、第1項の規定により甲が承継元清算参加者の承継対象清算約定等を承継した場合(甲を当事者とする乙のすべての清算約定(委託分)に係る権利義務を承継した場合に限る。)には、当該承継の時点で、乙と承継元清算参加者の間の清算受託契約の規定により乙が返還請求権を有する当初証拠金が甲を代理人としてクリアリング機構に預託された当初証拠金とみなされることについて、本契約をもってあらかじめ同意する。

(甲又は他の清算委託者への本清算委託取引の移管)

第28条の5 乙は、業務方法書等の定めに従い、本清算委託取引を甲又は他の清算委託者(以下「移管先清算委託者」という。)に移管(本清算委託取引を業務方法書等の定めるところにより将来に向かって消滅させること又は本清算委託取引を業務方法書等の定めるところにより将来に向かって消滅させると同時に、甲に対して有価証券等清算取次ぎの委託を行っている他の清算委託者及び甲の間に当該本清算委託取引と同一内容の新たな清算委託取引を成立させることをいう。以下本条及び次条において同じ。)することができる。

2 乙は、本清算委託取引を移管しようとする場合には、あらかじめ甲（移管先清算委託者に本清算委託取引を移管する場合には、当該移管先清算委託者を含む。以下本項において同じ。）との間で、当該移管に伴う甲及び乙の間の債権債務の清算その他必要事項に関し、合意しておかなければならない。

（他の清算委託者からの清算委託取引の移管）

第28条の6 乙は、業務方法書等の定めに従い、甲に対して有価証券等清算取次ぎを行っている他の清算委託者（以下「移管元清算委託者」という。）から移管元清算委託者と甲との間の法律関係（清算委託取引と同様の法律関係に限る。以下「移管対象清算委託取引」という。）の移管を受けることができる。

2 乙は、移管元清算委託者から移管対象清算委託取引の移管を受けようとする場合には、あらかじめ甲及び移管元清算委託者との間で、当該移管に伴う乙、甲及び移管元清算委託者の間の債権債務の清算その他必要事項に関し、合意しておかなければならない。

（期限の利益喪失事由が発生した場合における本清算委託取引の終了）

第30条 甲は、乙について期限の利益喪失事由が発生し、継続している場合には、本清算委託取引の期限前終了日（本条の定めるところによりすべての本清算委託取引が委託清算約定の終了日の到来によらずに終了する日をいう。以下同じ。）を指定することができる。期限前終了日の指定は、該当する期限の利益喪失事由を記載した20日以内の事前通知を乙に送付することにより、その効力を生じるものとする。ただし、甲乙間において、期限の利益喪失事由の全部又は一部について、あらかじめ一定の日を期

（期限の利益喪失事由が発生した場合における清算委託取引の終了）

第30条 甲は、乙について期限の利益喪失事由が発生し、継続している場合には、清算委託取引の期限前終了日（本条の定めるところによりすべての清算委託取引が委託清算約定の終了日の到来によらずに終了する日をいう。以下同じ。）を指定することができる。期限前終了日の指定は、該当する期限の利益喪失事由を記載した20日以内の事前通知を乙に送付することにより、その効力を生じるものとする。ただし、甲乙間において、期限の利益喪失事由の全部又は一部について、あらかじめ一定の日を期限前

<p>限前終了日として指定する旨の別段の合意がある場合には、当該合意に従う。</p>	<p>終了日として指定する旨の別段の合意がある場合には、当該合意に従う。</p>
<p>2 期限前終了日時点におけるすべての<u>本清算委託取引</u>は、甲又は乙から別段の意思表示を要することなく、期限前終了日において当然に終了する。</p>	<p>2 期限前終了日時点におけるすべての清算委託取引は、甲又は乙から別段の意思表示を要することなく、期限前終了日において当然に終了する。</p>
<p>3 前2項の規定にかかわらず、乙について前条第1項第3号dに掲げる期限の利益喪失事由が発生した場合、すべての<u>本清算委託取引</u>は、甲又は乙から別段の意思表示を要することなく、当該期限の利益喪失事由が発生する直前において当然に終了するものとし、その終了の日を期限前終了日とする。</p>	<p>3 前2項の規定にかかわらず、乙について前条第1項第3号dに掲げる期限の利益喪失事由が発生した場合、すべての清算委託取引は、甲又は乙から別段の意思表示を要することなく、当該期限の利益喪失事由が発生する直前において当然に終了するものとし、その終了の日を期限前終了日とする。</p>
<p>4 甲又は乙は、前2項の規定により<u>本清算委託取引</u>が終了する場合には、あらかじめ、又はその終了後遅滞なく、クリアリング機構に対し届出を行うものとする。</p>	<p>4 甲又は乙は、前2項の規定により清算委託取引が終了する場合には、あらかじめ、又はその終了後遅滞なく、クリアリング機構に対し届出を行うものとする。</p>
<p>5 第2項又は第3項の規定によりすべての<u>本清算委託取引</u>が終了した場合、当該各<u>本清算委託取引</u>に係る委託清算約定は、甲の自己の計算による清算約定としてクリアリング機構との間で存続するものとする。</p>	<p>5 第2項又は第3項の規定によりすべての清算委託取引が終了した場合、当該各清算委託取引に係る委託清算約定は、甲の自己の計算による清算約定としてクリアリング機構との間で存続するものとする。</p>
<p>6 甲は、期限前終了日以降、前項の規定により<u>自己の計算として存続する清算約定から甲に生じ得る損失の全部又は一部を回避することを目的とする取引</u>（以下「<u>リスク軽減取引</u>」という。）<u>を行うことができる。この場合において、リスク軽減取引は、クリアリング機構の他の清算参加者又は当該他の清算参加者の清算委託者を相手方として、当該清算約定の全部又は一部から甲に生じ得る損失を対象に行われる金利スワップ取引（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9条各号の要件を満たすものに限る。）とする。</u></p>	<p>（新設）</p>
<p>7 第2項又は第3項の規定によりすべての<u>本清算委託取引</u>が終了した場合、甲及び乙は、<u>当該</u></p>	<p>6 第2項又は第3項の規定によりすべての清算委託取引が終了した場合、甲及び乙は、<u>当該各</u></p>

各本清算委託取引に関して期限前終了金額を授受するものとする。この場合において、当該期限前終了金額は、次の各号に掲げる額の第1号から第3号まで金額の合計額から第4号の金額を控除した金額とし、当該金額が正数の場合には甲から乙に期限前終了金額を支払い、当該金額が負数の場合には乙から甲に期限前終了金額を支払うものとする。

(1) 甲が行ったリスク軽減取引に関して甲が受領したアップフロントフィーの合計額から、当該リスク軽減取引に関して甲が支払ったアップフロントフィーの合計額を控除した額

(2) 次のa及びbに掲げる取引について、当該a及びbに定める日において算出した正味現在価値の合計額

a リスク軽減取引及び委託清算約定のうちリスク軽減取引の対象となった取引
当該リスク軽減取引が行われた日

b 委託清算約定のうち、前aに掲げる取引以外の取引
次項に規定する通知を行った日の前J S C C営業日

(3) 次のaからcに掲げる取引について、当該aからcに定める金額の合計額

a 甲乙間に成立していた本清算委託取引
当該本清算委託取引について、期限前終了日までに甲が乙に対して支払うべき固定金額、変動金額及びその他支払金額の合計額のうち未払いの額から、期限前終了日までに乙が甲に対して支払うべき固定金額、

清算委託取引に係る委託清算約定の期限前終了日における当該各清算約定の正味現在価値に基づく期限前終了金額を授受するものとする。この場合において、当該各清算委託取引に係る期限前終了金額は、当該各清算委託取引に係る委託清算約定について期限前終了日の翌J S C C営業日までに甲からクリアリング機構に預託すべき変動証拠金の差引累計額（変動証拠金の総支払額から総受取額を控除した額をいう。以下同じ。）に相当する額とし、差引累計額が正数の場合には乙から甲に期限前終了金額を支払い、差引累計額が負数の場合には甲から乙に期限前終了金額を支払う。

(新設)

(新設)

(新設)

変動金額及びその他支払金額の合計額のうち未払いの額を控除した額

b 委託清算約定のうち、リスク軽減取引の対象となった取引

当該委託清算約定について、期限前終了日から当該リスク軽減取引を行った日までに、甲が受領すべき固定金額、変動金額及びその他支払金額の合計額から甲が支払うべき固定金額、変動金額及びその他支払金額の合計額を控除した額

c 委託清算約定のうち、前bに掲げる取引以外の取引

当該委託清算約定について、期限前終了日から次項に規定する通知を行った日までに、甲が受領すべき固定金額、変動金額及びその他支払金額の合計額から甲が支払うべき固定金額、変動金額及びその他支払金額の合計額を控除した額

(4) 前3号に掲げるもののほか、委託清算 (新設)
約定の処理に関し、甲が損失を被り、又は費用若しくは債務を負担した場合には、当該損失又は費用若しくは債務に相当する金額

8 甲は、期限前終了日以降可能な限り速やかに、 (新設)

第6項に規定するリスク軽減取引の執行及び前項に規定する期限前終了金額の算出を行うものとし、当該期限前終了金額を算出した場合には、当該期限前終了金額の明細（リスク軽減取引の詳細及び当該リスク軽減取引から生じた損益の内容、前項の規定に従い算出した期限前終了金額の算出に利用した情報の内容を含む。）について、乙に対して通知するものとする。

9 甲及び乙が前条第3項の規定により同条第1項第3号dに掲げる事由を変更する旨の合意をした場合、第3項の規定は次のとおり読み替えられるものとする。

「前2項の規定にかかわらず、甲は、乙について

7 甲及び乙が前条第3項の規定により同条第1項第3号dに掲げる事由を変更する旨の合意をした場合、第3項の規定は次のとおり読み替えられるものとする。

「前2項の規定にかかわらず、甲は、乙について

前条第1項第3号dに掲げる期限の利益喪失事由が発生し、継続している場合には、当該事由の発生日から20日間（以下本項において「期限前終了日指定期間」という。）に限り、本清算委託取引の期限前終了日を指定することができる。この場合の期限前終了日の指定方法及びその効力は前2項の規定に従う。甲が期限前終了日指定期間内に期限前終了日の指定を行わなかった場合、すべての本清算委託取引は、甲又は乙から別段の意思表示を要することなく、当該期限前終了日指定期間の満了時において当然に終了する。」

（本清算委託取引終了時における委託当初証拠金等の返還）

第31条 前条第2項又は第3項の規定によりすべての本清算委託取引が終了した場合、甲は、乙から預託を受けた委託当初証拠金を直ちに乙に返還するものとする。ただし、次条の規定により当該委託当初証拠金に係る債権債務が清算される場合を除き、乙は、第26条第1項の規定に基づき、すべての本清算委託取引の決済が完了するまでの間、甲に対し、当該委託当初証拠金の返還を請求することができない。

2 （略）

3 前条第2項又は第3項の規定によりすべての本清算委託取引が終了した場合、甲及び乙は、本契約に基づき相手方から預託を受けた変動証拠金を直ちに相手方に返還するものとする。ただし、次条の規定により当該変動証拠金に係る債権債務が清算される場合を除き、乙は、第26条第1項の規定に基づき、すべての本清算委託取引の決済が完了するまでの間、甲に対し、当該変動証拠金の返還を請求することができない。

前条第1項第3号dに掲げる期限の利益喪失事由が発生し、継続している場合には、当該事由の発生日から20日間（以下本項において「期限前終了日指定期間」という。）に限り、清算委託取引の期限前終了日を指定することができる。この場合の期限前終了日の指定方法及びその効力は前2項の規定に従う。甲が期限前終了日指定期間内に期限前終了日の指定を行わなかった場合、すべての清算委託取引は、甲又は乙から別段の意思表示を要することなく、当該期限前終了日指定期間の満了時において当然に終了する。」

（清算委託取引終了時における委託当初証拠金等の返還）

第31条 前条第2項又は第3項の規定によりすべての清算委託取引が終了した場合、甲は、乙から預託を受けた委託当初証拠金を直ちに乙に返還するものとする。ただし、次条の規定により当該委託当初証拠金に係る債権債務が清算される場合を除き、乙は、第26条第1項の規定に基づき、すべての清算委託取引の決済が完了するまでの間、甲に対し、当該委託当初証拠金の返還を請求することができない。

2 （略）

3 前条第2項又は第3項の規定によりすべての清算委託取引が終了した場合、甲及び乙は、相手方から預託を受けた変動証拠金を直ちに相手方に返還するものとする。ただし、次条の規定により当該変動証拠金に係る債権債務が清算される場合を除き、乙は、第26条第1項の規定に基づき、すべての清算委託取引の決済が完了するまでの間、甲に対し、当該変動証拠金の返還を請求することができない。

(本清算委託取引終了時における債権債務の一括清算)

第32条 第30条第2項又は第3項の規定によりすべての本清算委託取引が終了した場合、期限前終了日において甲乙間に存在するすべての本契約に基づく金銭債務(同条第7項の規定による本清算委託取引の終了に伴う期限前終了金額の支払債務、前条の規定による委託当初証拠金及び変動証拠金の返還債務、未払いの固定金額及び変動金額の支払債務その他甲乙間の一切の金銭債務を含む。)は、次に定めるところにより清算されるものとする。

(1) 第30条第2項又は第3項の規定により終了したすべての本清算委託取引について甲から乙に支払うべき期限前終了金額の総額及び甲から乙に返還すべき変動証拠金の総額その他期限前終了日において存在する甲の乙に対する金銭債務(前条の規定による委託当初証拠金の返還債務を除き、以下「期限前終了日甲負担債務」という。)と、当該本清算委託取引について乙から甲に支払うべき期限前終了金額の総額及び乙から甲に返還すべき変動証拠金の総額その他期限前終了日において存在する乙の甲に対する金銭債務(以下「期限前終了日乙負担債務」という。)とを差引計算する。

(2)・(3) (略)

(4) 前号の規定による差引計算の結果、なお期限前終了日乙負担債務がある場合には、その金額をもってすべての本清算委託取引の終了に伴う乙の甲に対する債務(以下本条において「乙最終債務」という。)とし、乙最終債務に係る債権を甲の乙に対する債権とする。

(5) 第1号の規定による差引計算の結果、期限前終了日甲負担債務がある場合には、そ

(清算委託取引終了時における債権債務の一括清算)

第32条 第30条第2項又は第3項の規定によりすべての清算委託取引が終了した場合、期限前終了日において甲乙間に存在するすべての本契約に基づく金銭債務(同条第6項の規定による清算委託取引の終了に伴う期限前終了金額の支払債務、前条の規定による委託当初証拠金及び変動証拠金の返還債務、未払いの固定金額及び変動金額の支払債務その他甲乙間の一切の金銭債務を含む。)は、次に定めるところにより清算されるものとする。

(1) 第30条第2項又は第3項の規定により終了したすべての清算委託取引について甲から乙に支払うべき期限前終了金額の総額、甲から乙に返還すべき変動証拠金の総額その他期限前終了日において存在する甲の乙に対する金銭債務(前条の規定による委託当初証拠金の返還債務を除き、以下「期限前終了日甲負担債務」という。)と、当該清算委託取引について乙から甲に支払うべき期限前終了金額の総額、乙から甲に返還すべき変動証拠金の総額その他期限前終了日において存在する乙の甲に対する金銭債務(以下「期限前終了日乙負担債務」という。)とを差引計算する。

(2)・(3) (略)

(4) 前号の規定による差引計算の結果、なお期限前終了日乙負担債務がある場合には、その金額をもってすべての清算委託取引の終了に伴う乙の甲に対する債務(以下本条において「乙最終債務」という。)とし、乙最終債務に係る債権を甲の乙に対する債権とする。

(5) 第1号の規定による差引計算の結果、期限前終了日甲負担債務がある場合には、そ

の絶対値の金額及び前条の規定による委託当初証拠金の返還債務の合計額をもってすべての本清算委託取引の終了に伴う甲の乙に対する債務（以下本条において「甲最終債務」という。）とし、甲最終債務に係る債権を乙の甲に対する債権とする。

（未決済約定の承継）

第34条 乙は、前条の規定により委託清算約定が終了した場合には、業務方法書等の定める期間内に限り、業務方法書等の定めに従い、承継清算参加者を經由してクリアリング機構にクリアリング機構所定の承継申込書を交付し、当該承継の申込みをクリアリング機構が承諾した場合には、次に掲げる権利義務（以下総称して「未決済約定」という。）を一括して承継清算参加者に承継させることができる。

（1） （略）

（2） 甲及び乙の間の本清算委託取引に係る権利義務（前条の規定により委託清算約定が終了する直前のもの）と業務方法書等の定める条件が同一となる権利義務

2・3 （略）

4 承継清算参加者が未決済約定を承継した場合、甲乙の間の本清算委託取引及び当該本清算委託取引について授受された変動証拠金に係る権利義務（甲の破綻等が認定された時点で弁済期が到来している甲の債務を除く。）及び委託当初証拠金に係る権利義務（第2項の規定により承継清算参加者を代理人としてクリアリング

の絶対値の金額及び前条の規定による委託当初証拠金の返還債務の合計額をもってすべての清算委託取引の終了に伴う甲の乙に対する債務（以下本条において「甲最終債務」という。）とし、甲最終債務に係る債権を乙の甲に対する債権とする。

（未決済約定の承継）

第34条 乙は、前条第1項の規定により委託清算約定が終了した場合には、業務方法書等の定める期間内に限り、業務方法書等の定めに従い、承継清算参加者（本項に規定する承継清算参加者をいう。）を經由してクリアリング機構にクリアリング機構所定の承継申込書を交付することにより、次に掲げる権利義務（以下総称して「未決済約定」という。）を一括して他の清算参加者（以下「承継清算参加者」という。）に承継（業務方法書等の定めるところにより、クリアリング機構、承継清算参加者及び乙の間で未決済約定を新たに発生させるとともに、それに伴う金銭の授受及び権利義務の処理を行うことをいう。以下本節において同じ。）させることができる。

（1） （略）

（2） 甲及び乙の間の清算委託取引に係る権利義務（前条の規定により委託清算約定が終了する直前のもの）と業務方法書等の定める条件が同一となる権利義務

2・3 （略）

4 承継清算参加者が未決済約定を承継した場合、甲乙の間の清算委託取引及び当該清算委託取引について授受された変動証拠金に係る権利義務（甲の破綻等が認定された時点で弁済期が到来している甲の債務を除く。）及び委託当初証拠金に係る権利義務（第2項の規定により承継清算参加者を代理人としてクリアリング機構

機構に預託されたものとみなされる部分に限る。)は、業務方法書等の定めるところにより、将来に向かって消滅する。

(未決済約定の承継が行われなかった場合の本清算委託取引の一括清算等)

第35条 第33条の規定により委託清算約定が終了した場合において、前条の規定による未決済約定の承継が行われなかったときは、甲及び乙は、次に定めるところにより、当該委託清算約定の終了に伴う期限前終了手数料に相当する額の金銭の授受を行うものとする。

(1) 業務方法書等の定めるところにより算出される甲を当事者とするすべての清算約定に係る期限前終了手数料の額を基準とし、次のaからfに掲げる額の合計額(乙が業務方法書第94条第1項に規定する清算委託者でない場合には、bからfまでに掲げる金額の合計額)を、当該委託清算約定に係る期限前終了手数料とする。

a クリアリング機構が甲の破綻等を認定した日(以下本号及び次号において「甲破綻認定日」という。)から乙が第34条に規定する未決済約定の承継を行うことができる期間の最終日として業務方法書等に規定する日(以下本号において乙を含む清算委託者に係る当該最終日を「承継可能期間最終日」という。)の翌JSCC営業日までの各JSCC営業日において授受すべき委託清算約定に係る変動証拠金等の額の合計額

b 乙の承継可能期間最終日の翌々JSCC営業日に授受すべき、甲を当事者とする清算約定のうち甲又は業務方法書第94条に規定する清算約定の承継を行うことができないことが乙の承継可能期間最終日の前J

に預託されたものとみなされる部分に限る。)は、業務方法書等の定めるところにより、将来に向かって消滅する。

(未決済約定の承継が行われなかった場合の清算委託取引の一括清算等)

第35条 第33条の規定により委託清算約定が終了した場合において、前条の規定による未決済約定の承継が行われなかったときは、甲及び乙は、次に定めるところにより、当該委託清算約定の終了に伴う期限前終了手数料に相当する額の金銭の授受を行うものとする。

(1) 業務方法書等の定めるところにより算出される甲を当事者とするすべての清算約定に係る期限前終了手数料の額を基準とし、委託清算約定の想定元本その他の事情を勘案してクリアリング機構がその都度合理的に算出する額を、当該委託清算約定に係る期限前終了手数料とする。

S C C 営業日までに確定した清算委託者の計算により成立していた清算約定（以下本号において「ヘッジ対象清算約定」という。）及び委託清算約定（乙以外に乙の承継可能期間最終日と同日に承継可能期間最終日が到来する甲を受託清算参加者とする清算委託者がいる場合は、委託清算約定及び当該各清算委託者の計算により成立していた清算約定。以下本号において同じ。）に係る変動証拠金等の額を、乙の承継可能期間最終日において当該ヘッジ対象清算約定及び委託清算約定についてそれぞれ算出されるリスク相当額（本項に規定するリスク相当額をいう。）に応じて按分した額

c 乙の承継可能期間最終日の翌 J S C C 営業日以降に、自らの計算により成立していた清算約定が新たにヘッジ対象清算約定に含まれることとなった甲を受託清算参加者とする他の清算委託者（以下本号において「新規ヘッジ対象清算委託者」という。）がない場合において、ヘッジ対象清算約定及び委託清算約定について、乙の承継可能期間最終日の 3 J S C C 営業日後の日から甲の破綻に係る破綻処理入札日（以下単に「破綻処理入札日」という。）までの各 J S C C 営業日において授受すべき変動証拠金等の額及び落札時支払金額から破綻処理入札日の前 J S C C 営業日の正味現在価値を控除した額の総額について、前 b の規定に準じて按分した額

d 乙の承継可能期間最終日の翌 J S C C 営業日以降に新規ヘッジ対象清算委託者が存在する場合において、当該新規ヘッジ対象清算委託者（新規ヘッジ対象清算委託者が複数いる場合は、当該各新規ヘッジ対象清算委託者。以下この d 及び e において同

じ。)の承継可能期間最終日において、委託清算約定はヘッジ対象清算約定に含まれるものとし、新規ヘッジ対象清算委託者の承継可能期間最終日の翌々J S C C営業日に授受すべき当該ヘッジ対象清算約定及び当該新規ヘッジ対象清算委託者の計算により成立していた清算約定に係る変動証拠金等の額を、当該ヘッジ対象清算約定及び当該新規ヘッジ対象清算委託者の計算により成立していた清算約定について、それぞれ算出されるリスク相当額に応じて按分し、当該按分後の額を前bの規定に準じて按分した額

e 前dが適用される場合において、新規ヘッジ対象清算委託者の承継可能期間最終日の翌J S C C営業日以降に新たな新規ヘッジ対象清算委託者がいないときは、ヘッジ対象清算約定及び当該新規ヘッジ対象清算委託者の計算により成立していた清算約定について、新規ヘッジ対象清算委託者の承継可能期間最終日の3 J S C C営業日後の日から破綻処理入札日までの各J S C C営業日において授受すべき変動証拠金等の額及び落札時支払金額から破綻処理入札日の前J S C C営業日の正味現在価値を控除した額の総額について、前dの規定に準じて按分した額

f 前dが適用される場合において、新規ヘッジ対象清算委託者の承継可能期間最終日の翌J S C C営業日以降に新たな新規ヘッジ対象清算委託者が存在するときは、前d及びeの規定に準じて算出した額の合計額。更に新たな新規ヘッジ対象清算委託者が存在する場合については、同様に算出した額の合計額を順次加える。

(1)の2 前号における「変動証拠金等の額」 (新設)

及び「正味現在価値」は、委託清算約定を含む甲を当事者とする清算約定が、甲破綻等認定日に終了していないと仮定した場合において、業務方法書等の定めるところによりクリアリング機構が算出する額とする。

(1) の 3 第 1 号における「リスク相当額」

は、対象とする清算約定について、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別表 2 第 1 項第 1 号 a に規定する方法に準じてクリアリング機構が算出する額をいう。

(2) ・ (3) (略)

2 第 3 3 条の規定により委託清算約定が終了した場合において、前条の規定による未決済約定の承継が行われなかったときは、甲及び乙は、本契約に基づき相手方から預託を受けた変動証拠金を直ちに相手方に返還するものとする。ただし、第 5 項の規定により当該変動証拠金に係る債権債務が清算される場合を除き、甲及び乙は、第 2 6 条第 2 項及び第 3 項の規定に基づき、すべての委託清算約定の決済が完了するまでの間、相手方に対し、当該変動証拠金の返還請求権を行使することができない。

3 ・ 4 (略)

5 第 3 3 条の規定により委託清算約定が終了した場合において、前条の規定による未決済約定の承継が行われなかったときは、当初損失確定日において甲乙間に存在するすべての本契約に基づく金銭債務（第 1 項の期限前終了手数料に相当する額（以下「期限前終了手数料相当額」という。）の支払債務、第 2 項の規定による変動証拠金の返還債務、前 2 項の規定による委託当初証拠金の返還債務、未払いの固定金額及び変動金額の支払債務その他甲乙間の一切の金銭債務を含む。以下「当初損失確定日現存債務」という。）は、次に定めるところにより清算されるものとする。

(新設)

(2) ・ (3) (略)

2 第 3 3 条の規定により委託清算約定が終了した場合において、前条の規定による未決済約定の承継が行われなかったときは、甲及び乙は、相手方から預託を受けた変動証拠金を直ちに相手方に返還するものとする。ただし、第 5 項の規定により当該変動証拠金に係る債権債務が清算される場合を除き、甲及び乙は、第 2 6 条第 2 項及び第 3 項の規定に基づき、すべての委託清算約定の決済が完了するまでの間、相手方に対し、当該変動証拠金の返還請求権を行使することができない。

3 ・ 4 (略)

5 第 3 3 条の規定により委託清算約定が終了した場合において、前条の規定による未決済約定の承継が行われなかったときは、当初損失確定日において甲乙間に存在するすべての本契約に基づく金銭債務（第 1 項の期限前終了手数料に相当する額（以下「期限前終了手数料相当額」という。）の支払債務、第 2 項の規定による変動証拠金の返還債務、前 2 項の規定による委託当初証拠金の返還債務、未払いの固定金額及び変動金額の支払債務その他甲乙間の一切の金銭債務を含む。以下「当初損失確定日現存債務」という。）は、次に定めるところにより清算されるものとする。

(1) ~ (3) (略)

(4) 前号の規定による差引計算の結果、当初損失確定日乙負担債務がある場合には、その金額をもってすべての本清算委託取引の終了に伴う乙の甲に対する債務（以下本条において「乙最終債務」という。）とし、乙最終債務に係る債権を甲の乙に対する債権とする。

(5) 第1号の規定による差引計算の結果、当初損失確定日甲負担債務がある場合には、その金額及び前2項の規定による委託当初証拠金の返還債務の合計額をもってすべての本清算委託取引の終了に伴う甲の乙に対する債務（以下本条において「甲最終債務」という。）とし、甲最終債務に係る債権を乙の甲に対する債権とする。

6・7 (略)

(他の清算参加者の破綻等による未決済約定の承継)

第36条 クリアリング機構が他の清算参加者（乙との間で清算受託契約を締結している清算参加者に限る。以下「破綻清算参加者」という。）の破綻等を認定し、破綻清算参加者が乙の計算において行っていた清算約定が終了した場合において、乙が甲に対して当該清算約定その他業務方法書等の定める権利義務（以下総称して「破綻清算参加者の未決済約定」という。）の承継の申込みをし、甲がこれを承諾した場合には、甲は、業務方法書等の定めるところにより、破綻清算参加者の未決済約定を承継する。

(1) ~ (3) (略)

(4) 前号の規定による差引計算の結果、当初損失確定日乙負担債務がある場合には、その金額をもってすべての清算委託取引の終了に伴う乙の甲に対する債務（以下本条において「乙最終債務」という。）とし、乙最終債務に係る債権を甲の乙に対する債権とする。

(5) 第1号の規定による差引計算の結果、当初損失確定日甲負担債務がある場合には、その金額及び前2項の規定による委託当初証拠金の返還債務の合計額をもってすべての清算委託取引の終了に伴う甲の乙に対する債務（以下本条において「甲最終債務」という。）とし、甲最終債務に係る債権を乙の甲に対する債権とする。

6・7 (略)

(他の清算参加者の破綻等による未決済約定の承継)

第36条 クリアリング機構が他の清算参加者（乙との間で清算受託契約を締結している清算参加者に限る。以下「破綻清算参加者」という。）の破綻等を認定し、破綻清算参加者が乙の計算において行っていた清算約定が終了した場合において、乙が甲に対して当該清算約定その他業務方法書等の定める権利義務（以下総称して「破綻清算参加者の未決済約定」という。）の承継（業務方法書等の定めるところにより、クリアリング機構、甲及び乙の間で破綻清算参加者の未決済約定を新たに発生させるとともに、それに伴う金銭の授受及び権利義務の処理を行うことをいう。以下本条において同じ。）の申込みをし、甲がこれを承諾した場合には、甲は、業務方法書等の定めるところにより、破綻清算参加者の未決済約定を承継する。

2 (略)

3 第1項の規定により甲が破綻清算参加者の未決済約定を承継した場合、承継した破綻清算参加者の未決済約定を本契約における委託清算約定及び本清算委託取引とみなして、本契約の規定を適用する。

4 (略)

(損失回避取引)

第37条 甲は、乙の取次ぎの委託に基づき、乙の計算で、クリアリング機構との間で業務方法書第93条第1項の損失回避取引を行うことができる。ただし、乙が甲と同一の企業集団に含まれない者である場合は、この限りでない。

2 前項の規定によりクリアリング機構及び甲の間で損失回避取引が成立した場合、当該損失回避取引は乙の甲に対する有価証券等清算取次ぎの委託により成立した委託清算約定と、当該損失回避取引に係る甲と乙の間の法律関係は本項の規定により委託清算約定とみなされる当該損失回避取引に係る本清算委託取引と、それぞれみなして本契約の規定を適用する。

(破綻処理入札)

第38条 甲は、乙の取次ぎの委託に基づき、乙の計算で、破綻処理入札に参加することができる。この場合において、甲が乙の計算で入札対象取引を落札した場合には、クリアリング機構及び甲の間において、乙の計算により当該落札に係る入札対象取引が成立するものとする。ただし、乙が甲と同一の企業集団に含まれない者である場合は、この限りでない。

2 前項の規定によりクリアリング機構及び甲の間で入札対象取引が成立した場合、当該入札対象取引は乙の甲に対する有価証券等清算取次ぎの委託により成立した委託清算約定と、当該入

2 (略)

3 第1項の規定により甲が破綻清算参加者の未決済約定を承継した場合、承継した破綻清算参加者の未決済約定を本契約における委託清算約定及び清算委託取引とみなして、本契約の規定を適用する。

4 (略)

(損失回避取引)

第37条 甲は、乙の取次ぎの委託に基づき、乙の計算で、クリアリング機構との間で業務方法書第93条第1項の損失回避取引を行うことができる。

2 前項の規定によりクリアリング機構及び甲の間で損失回避取引が成立した場合、当該損失回避取引は乙の甲に対する有価証券等清算取次ぎの委託により成立した委託清算約定と、当該損失回避取引に係る甲と乙の間の法律関係は本項の規定により委託清算約定とみなされる当該損失回避取引に係る清算委託取引と、それぞれみなして本契約の規定を適用する。

(破綻処理入札)

第38条 甲は、乙の取次ぎの委託に基づき、乙の計算で、破綻処理入札に参加することができる。この場合において、甲が乙の計算で入札対象取引を落札した場合には、クリアリング機構及び甲の間において、乙の計算により当該落札に係る入札対象取引が成立するものとする。

2 前項の規定によりクリアリング機構及び甲の間で入札対象取引が成立した場合、当該入札対象取引は乙の甲に対する有価証券等清算取次ぎの委託により成立した委託清算約定と、当該入

札対象取引に係る甲と乙の間の法律関係は本項の規定により委託清算約定とみなされる当該入札対象取引に係る本清算委託取引と、それぞれみなして本契約の規定を適用する。

(本契約の任意解約)

第39条 (略)

2・3 (略)

4 第1項及び第2項の規定による本契約の解約までに成立した本清算委託取引に関しては、引き続き本契約を適用する。

5 (略)

(本契約の強制解約等)

第40条 (略)

2 クリアリング機構が甲の破綻等を認定した場合、本契約は、当該認定の時点におけるすべての本清算委託取引の清算が完了した時点をもって、甲又は乙から別段の意思表示を要することなく、当然に終了する。

3・4 (略)

5 第1項の規定により本契約が終了した場合において、その終了時点で本清算委託取引の清算が完了していない場合には、当該本清算委託取引及びその清算に関しては、引き続き本契約を適用する。

(報告)

第41条 乙は、甲が請求したときは、本清算委託取引に関して必要な事項を甲に対して遅滞なく報告しなければならない。

2 (略)

(定めのない事項)

第50条 本清算委託取引に関し、本契約に定めのない事項については、前条の甲乙間の覚書その

札対象取引に係る甲と乙の間の法律関係は本項の規定により委託清算約定とみなされる当該入札対象取引に係る清算委託取引と、それぞれみなして本契約の規定を適用する。

(本契約の任意解約)

第39条 (略)

2・3 (略)

4 第1項及び第2項の規定による本契約の解約までに成立した清算委託取引に関しては、引き続き本契約を適用する。

5 (略)

(本契約の強制解約等)

第40条 (略)

2 クリアリング機構が甲の破綻等を認定した場合、本契約は、当該認定の時点におけるすべての清算委託取引の清算が完了した時点をもって、甲又は乙から別段の意思表示を要することなく、当然に終了する。

3・4 (略)

5 第1項の規定により本契約が終了した場合において、その終了時点で清算委託取引の清算が完了していない場合には、当該清算委託取引及びその清算に関しては、引き続き本契約を適用する。

(報告)

第41条 乙は、甲が請求したときは、清算委託取引に関して必要な事項を甲に対して遅滞なく報告しなければならない。

2 (略)

(定めのない事項)

第50条 清算委託取引に関し、本契約に定めのない事項については、前条の甲乙間の覚書その

他の合意書の定めによるほか、業務方法書等に従うものとする。

(裁判管轄)

第53条 本契約又は本清算委託取引に関する訴訟については、甲の本店又は〇〇支店の所在地を管轄する裁判所を合意管轄裁判所とする。

2 前項の規定にかかわらず、甲及び乙は、本契約又は本清算委託取引に関する紛争に関し、専属的合意管轄の合意又は仲裁合意をすることができる。

他の合意書の定めによるほか、業務方法書等に
従うものとする。

(裁判管轄)

第53条 本契約又は清算委託取引に関する訴訟については、甲の本店又は〇〇支店の所在地を管轄する裁判所を合意管轄裁判所とする。

2 前項の規定にかかわらず、甲及び乙は、本契約又は清算委託取引に関する紛争に関し、専属的合意管轄の合意又は仲裁合意をすることができる。

金利スワップ取引清算業務に係る手数料に関する規則の一部改正新旧対照表

新	旧
<p>(手数料の種類)</p> <p>第2条 業務方法書第16条に規定する当社が定める手数料は、基本料、清算手数料、<u>任意解約手数料</u>、<u>クライアント・クリアリング手数料</u>、<u>口座開設手数料</u>及びコラテラル手数料とする。</p>	<p>(手数料の種類)</p> <p>第2条 業務方法書第16条に規定する当社が定める手数料は、基本料、清算手数料、<u>デクリアー</u><u>一手数料</u>及びコラテラル手数料とする。</p>
<p>(基本料)</p> <p>第3条 (略)</p> <p>2 (略)</p> <p>3 前2項の規定にかかわらず、株主清算参加者が一の計算年度(清算参加者が当該計算年度の途中で株主清算参加者となり、又は株主清算参加者でなくなった場合には、当該計算年度のうち当該清算参加者が株主清算参加者であった期間)において負担する基本料、清算手数料(清算約定(委託分)に係る清算手数料を除く。)及び<u>任意解約手数料</u>(清算約定(委託分)に係る<u>任意解約手数料</u>を除く。)の総額が自己取引上限額に達したときは、当該株主清算参加者に対し、当該計算年度における翌月以降の基本料は課さないものとする。</p>	<p>(基本料)</p> <p>第3条 (略)</p> <p>2 (略)</p> <p>3 前2項の規定にかかわらず、株主清算参加者が一の計算年度(清算参加者が当該計算年度の途中で株主清算参加者となり、又は株主清算参加者でなくなった場合には、当該計算年度のうち当該清算参加者が株主清算参加者であった期間)において負担する基本料、清算手数料(清算約定(委託分)に係る清算手数料を除く。)及び<u>デクリアー</u><u>一手数料</u>(清算約定(委託分)に係る<u>デクリアー</u><u>一手数料</u>を除く。)の総額が自己取引上限額に達したときは、当該株主清算参加者に対し、当該計算年度における翌月以降の基本料は課さないものとする。</p>
<p>(清算手数料)</p> <p>第4条 (略)</p> <p>2 各月の新規債務負担手数料及び債務負担済残存取引手数料は、それぞれ、次の各号に掲げる清算参加者の区分に応じ当該各号に定める金額を自己取引口座及び委託取引口座(<u>クライアント・クリアリングに係る委託取引口座を除く。</u>)ごとに算出した金額の総額とする。</p> <p>(1)・(2) (略)</p> <p>3 前項の規定にかかわらず、株主清算参加者が</p>	<p>(清算手数料)</p> <p>第4条 (略)</p> <p>2 各月の新規債務負担手数料及び債務負担済残存取引手数料は、それぞれ、次の各号に掲げる清算参加者の区分に応じ当該各号に定める金額を自己取引口座及び委託取引口座ごとに算出した金額の総額とする。</p> <p>(1)・(2) (略)</p> <p>3 前項の規定にかかわらず、株主清算参加者が</p>

一の計算年度（清算参加者が当該計算年度の途中で株主清算参加者となり、又は株主清算参加者でなくなった場合には、当該計算年度のうち当該清算参加者が株主清算参加者であった期間）において負担する基本料、清算手数料（清算約定（委託分）に係る清算手数料を除く。）及び任意解約手数料（清算約定（委託分）に係る任意解約手数料を除く。）の総額が自己取引上限額に達したときは、当該株主清算参加者に対し、当該計算年度において、自己取引上限額を超えることとなる清算約定（自己分）に係る清算手数料は課さないものとする。

4 第2項の規定にかかわらず、株主清算参加者が一の計算年度（清算参加者が当該計算年度の途中で株主清算参加者となり、又は株主清算参加者でなくなった場合には、当該計算年度のうち当該清算参加者が株主清算参加者であった期間）において負担する清算委託者ごとの清算手数料（清算約定（委託分）（クライアント・クリアリングに係る清算約定を除く。以下本条において同じ。））に係る清算手数料に限る。）及び任意解約手数料（清算約定（委託分）に係る任意解約手数料に限る。）の総額が委託取引上限額に達したときは、当該株主清算参加者に対し、当該計算年度において、当該清算委託者につき、委託取引上限額を超えることとなる清算約定（委託分）に係る清算手数料は課さないものとする。

5 前各項の規定は、業務方法書第53条の2に規定する一括コンプレッションを行う場合について準用する。

（任意解約手数料）

第5条 任意解約手数料は、業務方法書第53条の規定により任意解約を行った清算約定ごとに、1件あたり1,000円とする。

一の計算年度（清算参加者が当該計算年度の途中で株主清算参加者となり、又は株主清算参加者でなくなった場合には、当該計算年度のうち当該清算参加者が株主清算参加者であった期間）において負担する基本料、清算手数料（清算約定（委託分）に係る清算手数料を除く。）及びデクリアー手数料（清算約定（委託分）に係るデクリアー手数料を除く。）の総額が自己取引上限額に達したときは、当該株主清算参加者に対し、当該計算年度において、自己取引上限額を超えることとなる清算約定（自己分）に係る清算手数料は課さないものとする。

4 第2項の規定にかかわらず、株主清算参加者が一の計算年度（清算参加者が当該計算年度の途中で株主清算参加者となり、又は株主清算参加者でなくなった場合には、当該計算年度のうち当該清算参加者が株主清算参加者であった期間）において負担する清算委託者ごとの清算手数料（清算約定（委託分）に係る清算手数料に限る。）及びデクリアー手数料（清算約定（委託分）に係るデクリアー手数料に限る。）の総額が委託取引上限額に達したときは、当該株主清算参加者に対し、当該計算年度において、当該清算委託者につき、委託取引上限額を超えることとなる清算約定（委託分）に係る清算手数料は課さないものとする。

（新設）

（デクリアー手数料）

第5条 デクリアー手数料は、業務方法書第53条の規定によりデクリアーを行った清算約定ごとに、1件あたり1,000円とする。

2 前項の規定にかかわらず、株主清算参加者が一の計算年度（清算参加者が当該計算年度の途中で株主清算参加者となり、又は株主清算参加者でなくなった場合には、当該計算年度のうち当該清算参加者が株主清算参加者であった期間）において負担する基本料、清算手数料（清算約定（委託分）に係る清算手数料を除く。）及び任意解約手数料（清算約定（委託分）に係る任意解約手数料を除く。）の総額が自己取引上限額に達したときは、当該株主清算参加者に対し、当該計算年度において自己取引上限額を超えることとなる清算約定（自己分）に係る任意解約手数料は課さないものとする。

3 第1項の規定にかかわらず、株主清算参加者が一の計算年度（清算参加者が当該計算年度の途中で株主清算参加者となり、又は株主清算参加者でなくなった場合には、当該計算年度のうち当該清算参加者が株主清算参加者であった期間）において負担する清算委託者ごとの清算手数料（清算約定（委託分）（クライアント・クリアリングに係る清算約定を除く。以下本項において同じ。）に係る清算手数料に限る。）及び任意解約手数料（清算約定（委託分）に係る任意解約手数料に限る。）の総額が委託取引上限額に達したときは、当該株主清算参加者に対し、当該計算年度において、当該清算委託者につき、委託取引上限額を超えることとなる清算約定（委託分）に係る任意解約手数料は課さないものとする。

4 前各項の規定は、業務方法書第53条の2に規定する一括コンプレッションが成立した場合について準用する。

（クライアント・クリアリング手数料）

第5条の2 クライアント・クリアリング手数料
は、クライアント・クリアリングに係る清算約

2 前項の規定にかかわらず、株主清算参加者が一の計算年度（清算参加者が当該計算年度の途中で株主清算参加者となり、又は株主清算参加者でなくなった場合には、当該計算年度のうち当該清算参加者が株主清算参加者であった期間）において負担する基本料、清算手数料（清算約定（委託分）に係る清算手数料を除く。）及びデクリアー手数料（清算約定（委託分）に係るデクリアー手数料を除く。）の総額が自己取引上限額に達したときは、当該株主清算参加者に対し、当該計算年度において自己取引上限額を超えることとなる清算約定（自己分）に係るデクリアー手数料は課さないものとする。

3 第1項の規定にかかわらず、株主清算参加者が一の計算年度（清算参加者が当該計算年度の途中で株主清算参加者となり、又は株主清算参加者でなくなった場合には、当該計算年度のうち当該清算参加者が株主清算参加者であった期間）において負担する清算委託者ごとの清算手数料（清算約定（委託分）に係る清算手数料に限る。）及びデクリアー手数料（清算約定（委託分）に係るデクリアー手数料に限る。）の総額が委託取引上限額に達したときは、当該株主清算参加者に対し、当該計算年度において、当該清算委託者につき、委託取引上限額を超えることとなる清算約定（委託分）に係るデクリアー手数料は課さないものとする。

（新設）

（新設）

定（委託分）に関する新規債務負担手数料及び債務負担済残存取引手数料の二種類とする。

2 各月のクライアント・クリアリングに係る清算約定（委託分）に関する新規債務負担手数料は、当該各月に成立したクライアント・クリアリングに係る清算約定の想定元本の合計額（以下「新規取引想定元本合計額」という。）について、1億円あたり720円を乗じた金額とする。

3 各月のクライアント・クリアリングに係る清算約定（委託分）に関する債務負担済残存取引手数料は、当該各月末日の経過時点で残存するクライアント・クリアリングに係る清算約定（委託分）の想定元本の合計額（以下「残存取引想定元本合計額」という。）について、1億円あたり25円を乗じた金額とする。

4 前2項の規定において、新規取引想定元本合計額又は残存取引想定元本合計額に1億円未満の部分がある場合については、当該部分は切り捨てた額を当該合計額とする。ただし、新規取引想定元本合計額又は残存取引想定元本合計額が1円以上1億円未満である場合は、当該合計額を1億円とみなすものとする。

5 前各項の規定は、業務方法書第53条の2に規定する一括コンプレッションを行う場合について準用する。

（口座開設手数料）

第5条の3 口座開設手数料は、当社がクライアント・クリアリングに係る委託取引口座を開設するごとに、1口座あたり10万円とする。

（株主清算参加者の手数料に関する特則）

第6条 株主清算参加者が一の計算年度（清算参加者が当該計算年度の途中で株主清算参加者となり又は株主清算参加者でなくなった場合に

（新設）

（株主清算参加者の手数料に関する特則）

第6条 株主清算参加者が一の計算年度（清算参加者が当該計算年度の途中で株主清算参加者となり又は株主清算参加者でなくなった場合に

<p>は、当該計算年度のうち当該清算参加者が株主清算参加者であった期間)において負担する基本料、清算手数料(清算約定(委託分)に係る清算手数料を除く。)及び任意解約手数料(清算約定(委託分)に係る任意解約手数料を除く。)の総額の上限(以下「自己取引上限額」という。)は、1億円とする。</p> <p>2 株主清算参加者が一の計算年度(清算参加者が当該計算年度の途中で株主清算参加者となり又は株主清算参加者でなくなった場合には、当該計算年度のうち当該清算参加者が株主清算参加者であった期間)において負担する清算約定(委託分) <u>(クライアント・クリアリングに係る清算約定を除く。)</u>に係る清算手数料及び任意解約手数料の上限(以下「委託取引上限額」という。)は、清算委託者ごとに、4,000万円(当該計算年度の下半期に清算委託者となった者については、2,000万円)を上限とする。</p> <p>3～6 (略)</p> <p>(手数料の支払時期等)</p> <p>第7条 清算参加者は、毎月分の基本料、清算手数料、任意解約手数料、クライアント・クリアリング手数料及び口座開設手数料の合計額を、翌月20日(同日が当社営業日でない場合には、翌当社営業日)までに、消費税及び地方消費税相当額を加算して当社に支払うものとする。</p> <p style="text-align: center;">付 則</p> <p>この改正規定は、平成26年2月24日から施行する。</p>	<p>は、当該計算年度のうち当該清算参加者が株主清算参加者であった期間)において負担する基本料、清算手数料(清算約定(委託分)に係る清算手数料を除く。)及びデクリアー手数料(清算約定(委託分)に係るデクリアー手数料を除く。)の総額の上限(以下「自己取引上限額」という。)は、1億円とする。</p> <p>2 株主清算参加者が一の計算年度(清算参加者が当該計算年度の途中で株主清算参加者となり又は株主清算参加者でなくなった場合には、当該計算年度のうち当該清算参加者が株主清算参加者であった期間)において負担する清算約定(委託分)に係る清算手数料及びデクリアー手数料の上限(以下「委託取引上限額」という。)は、清算委託者ごとに、4,000万円(当該計算年度の下半期に清算委託者となった者については、2,000万円)を上限とする。</p> <p>3～6 (略)</p> <p>(手数料の支払時期等)</p> <p>第7条 清算参加者は、毎月分の基本料、清算手数料及びデクリアー手数料の合計額を、翌月20日(同日が当社営業日でない場合には、翌当社営業日)までに、消費税及び地方消費税相当額を加算して当社に支払うものとする。</p>
--	---

金利スワップ清算基金所要額に関する規則の一部改正新旧対照表

新	旧
<p>(金利スワップ清算基金所要額)</p> <p>第2条 (略)</p> <p>2 (略)</p> <p style="text-align: center;">付 則</p> <p>この改正規定は、平成26年2月24日から施行する。</p> <p>別表 金利スワップ清算基金所要額の算出に関する表</p> <p>1 (略)</p> <p>2 前項に規定するストレス時想定損失負担額は、対応する金利スワップ清算基金算出日における担保超過リスク額が上位である清算参加者2社（当該清算参加者を含む企業集団に含まれる他の清算参加者を含む。）の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当該各清算参加者の<u>自己取引口座及び委託取引口座に係る</u>当初証拠金所要額（業務方法書第29条の規定により当初証拠金所要額の引上げ措置を受けている清算参加者については、当該引上げ措置を行う前の当初証拠金所要額）に応じて按分した額とする。なお、本項において「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4時の時点における<u>自己取引口座及び各委託取引口座に係る</u>清算約定（業務方法書第53条に規定する任意解約の申込みがなされた清算約定を除く。）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フォワード・カーブ及びディスカウント・カーブの極端な変動によ</p>	<p>(金利スワップ清算基金所要額)</p> <p>第2条 (略)</p> <p>2 (略)</p> <p>別表 金利スワップ清算基金所要額の算出に関する表</p> <p>1 (略)</p> <p>2 前項に規定するストレス時想定損失負担額は、対応する金利スワップ清算基金算出日における担保超過リスク額が上位である清算参加者2社（当該清算参加者を含む企業集団に含まれる他の清算参加者を含む。）の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当該各清算参加者の当初証拠金所要額（業務方法書第29条の規定により当初証拠金所要額の引上げ措置を受けている清算参加者については、当該引上げ措置を行う前の当初証拠金所要額）に応じて按分した額とする。なお、本項において「担保超過リスク額」とは、当該各清算参加者の<u>清算参加者口座ごとの</u>金利スワップ清算基金算出日における午後4時の時点における清算約定（当該時点までに債務負担の申込みがなされた適格金利スワップ取引を含む。）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フォワード・カーブ及びディスカウント・カーブの極端な変動により、当該清算約定から当該清算参加者に生じ得る損失に相当す</p>

り、当該清算約定から当該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(当該額が負数となる場合は、0とする。)を、すべての当該清算参加者について合算した額をいう。

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。) から当該清算参加者の当該当社営業日の当該清算参加者口座に係る当初証拠金所要額を差し引いた額(当該額が負数となる場合は、0とする。)を、すべての当該清算参加者口座について合算した額をいう。

金利スワップ取引清算業務に関する清算参加者の破綻処理に関する規則の一部改正新旧対照表

新	旧
<p>(定義)</p> <p>第2条 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。</p> <p>(1) (略)</p> <p>(2) <u>削除</u></p> <p>(3)・(4) (略)</p>	<p>(定義)</p> <p>第2条 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。</p> <p>(1) (略)</p> <p>(2) <u>「変動証拠金等」とは、業務方法書第106条第1項に規定する変動証拠金をいう。</u></p> <p>(3)・(4) (略)</p>
<p>(清算約定(委託分)の承継)</p> <p>第8条 業務方法書第94条第1項に規定する当社が規則で定める期間は、<u>破綻認定日から破綻認定日の翌々当社営業日の午後2時までとする。</u></p> <p>2 <u>前項の規定にかかわらず、当社は、前項に規定する期間について、承継を希望している清算委託者及び受託清算参加者が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26条の2第2項各号に定める内容の体制整備を行っている場合には、金利スワップ破綻管理委員会の助言に基づき、金利スワップ取引の状況、当社に生じ得る損失の可能性その他の事情を勘案したうえで、最大で破綻認定日の6当社営業日後まで延長することができるものとする。この場合において、当社は毎当社営業日、当該延長の可否について判断する。</u></p>	<p>(清算約定(委託分)の承継)</p> <p>第8条 業務方法書第94条第1項に規定する当社が規則で定める期間は、<u>金利スワップ取引の状況、当社に生じ得る損失の可能性その他の事情を勘案して実務上可能な限り破綻認定日に近い日までの期間とし、その具体的期間は、金利スワップ破綻管理委員会の助言に基づき、当社がその都度定める。</u></p> <p>2 <u>当社は、前項の規定により期間を定めた場合には、直ちにその旨を清算参加者に通知し、かつ公表する。</u></p>

3 業務方法書第94条第1項に規定する当社が (新設)

定める清算委託者は、受託清算参加者と同一の企業集団に含まれない清算委託者及び受託清算参加者と同一の企業集団に含まれる清算委託者のうち、受託清算参加者について破綻等が認定された場合に自身の清算約定（委託分）及び清算委託取引に係る権利義務の承継を希望する旨を当社に届け出た者をいう。

4 業務方法書第94条第5項に規定する承継時 (新設)

支払金額、未払債務及び変動証拠金は、次に定めるところにより算出し授受するものとする。

(1) 当社、承継清算参加者及び清算委託者は、対象清算約定（業務方法書第94条第5項に規定する対象清算約定をいう。以下同じ。）について破綻認定日までに清算委託者が破綻清算参加者に預託した変動証拠金の差引累計額（変動証拠金の総支払額から総受取額を控除した額をいう。以下本条及び第17条において同じ。）と同額の承継時支払金額を授受するものとする。この場合において、当該差引累計額が正数の場合には当社から承継清算参加者及び承継清算参加者から清算委託者に承継時支払金額を支払い、差引累計額が負数の場合には清算委託者から承継清算参加者及び承継清算参加者から当社に承継時支払金額を支払う。

(2) 未払債務は、対象清算約定が破綻認定日に終了していないと仮定した場合において、破綻認定日（破綻認定日が支払日であった、同日に固定金額、変動金額、及びアップフロントフィー及び任意解約手数料の授受が完了している場合には、その翌当社営業日）から承継日までに授受されるべき固定金額、変動金額及びアップフロントフィーの合計額とする。

(3) 変動証拠金の額は、業務方法書第94

条第6項第2号の規定により成立したものとみなされた清算約定（委託分）が新たな清算約定として対象清算約定の終了時に成立したと仮定した場合において、当該時点から承継日までに授受されるべき変動証拠金の額とする。

5 （略）

6 当社、承継清算参加者及び清算委託者は、業務方法書第94条第6項の規定により承継時支払金額、未払債務及び変動証拠金を差引計算した残額について、承継日に授受を行う（承継時支払金額、未払債務及び変動証拠金については、業務方法書第94条第5項の規定により当社に預託又は交付されたものを除く。）。

（削る）

3 （略）

4 当社、承継清算参加者及び清算委託者は、次に定めるところにより、業務方法書第94条第4項第3号の規定による承継時支払金額、未払債務（破綻清算参加者の破綻等が認定された時点で当社及び破綻清算参加者の間の弁済期が到来している債務を除く。以下本条において同じ。）及び変動証拠金の授受を行う。

（1） 承継時支払金額は、対象清算約定（委託分）（業務方法書第94条第4項柱書きに規定する対象清算約定（委託分）をいう。以下本条において同じ。）について破綻認定日までに清算委託者が破綻清算参加者に預託した変動証拠金の差引累計額（変動証拠金の総支払額から総受取額を控除した額をいう。以下本条及び第17条において同じ。）と同額とし、差引累計額が正数の場合には当社から承継清算参加者及び承継清算参加者から清算委託者に承継時支払金額を支払い、差引累計額が負数の場合には清算委託者から承継清算参加者及び承継清算参加者から当社に承継時支払金額を支払う。

（2） 未払債務は、対象清算約定（委託分）が破綻認定日に終了していないと仮定した場合において、破綻認定日（破綻認定日が支払日であって、同日に固定金額、変動金額、アップフロントフィー及び任意解約手数料の授受が完了している場合には、その翌当社営業日）から承継日までに授受されるべき固定金額、変動金額及びアップフロントフィーの合

	<p>計額とする。</p> <p>(3) <u>変動証拠金の額は、業務方法書第94条第4項第2号の規定により成立したものとみなされた清算約定（委託分）が新たな清算約定として対象清算約定（委託分）の終了時に成立したと仮定した場合において、当該時点から承継日の翌当社営業日までに授受されるべき変動証拠金の額とする。</u></p> <p>(4) <u>当社及び承継清算参加者並びに承継清算参加者及び清算委託者は、前3号の承継時支払金額、未払債務及び変動証拠金を差引計算した残額を、承継日の翌当社営業日に授受する。この場合において、清算委託者が非居住者である場合は、承継清算参加者及び清算委託者は、承継日の翌々当社営業日までに当該残額を授受する。</u></p>
<p>7 <u>業務方法書第94条第4項第6号に規定する対象清算約定の期限前終了手数料は、当該対象清算約定について破綻認定日までに当社が破綻清算参加者に預託した変動証拠金の差引累計額と同額とし、差引累計額が正数の場合には破綻清算参加者から当社に期限前終了手数料を支払い、差引累計額が負数の場合には当社から破綻清算参加者に期限前終了手数料を支払う。この場合において、当社及び破綻清算参加者の間で当該対象清算約定について授受された変動証拠金は、その期限前終了手数料に係る債務の弁済に当然に充当されるものとし、現実に変動証拠金の返還及び期限前終了手数料の授受は行わないものとする。</u></p> <p>(すべての清算約定の強制終了)</p> <p>第17条 (略)</p> <p>2 当社及び清算参加者は、前項の各清算約定について、次の各号に掲げる場合に応じ、当該各号に定めるところにより、当該各清算約定に係</p>	<p>5 <u>業務方法書第94条第4項第6号に規定する対象清算約定（委託分）の期限前終了手数料は、当該対象清算約定（委託分）について破綻認定日までに当社が破綻清算参加者に預託した変動証拠金の差引累計額と同額とし、差引累計額が正数の場合には破綻清算参加者から当社に期限前終了手数料を支払い、差引累計額が負数の場合には当社から破綻清算参加者に期限前終了手数料を支払う。この場合において、当社及び破綻清算参加者の間で当該対象清算約定（委託分）について授受された変動証拠金は、その期限前終了手数料に係る債務の弁済に当然に充当されるものとし、現実に変動証拠金の返還及び期限前終了手数料の授受は行わないものとする。</u></p> <p>(すべての清算約定の強制終了)</p> <p>第17条 (略)</p> <p>2 当社及び清算参加者は、前項の各清算約定について、次の各号に掲げる場合に応じ、当該各号に定めるところにより、当該各清算委託取引</p>

る期限前終了金額を支払い、又は当該各清算約定について預託を受けた変動証拠金を返還する。

(1)・(2) (略)

3 (略)

第5章 特別清算料担保金

(第三階層特別清算料担保金の預託義務)

第23条 各清算参加者は、他の清算参加者について破綻等が認定された場合には、次の各号に掲げる場合に応じて、当該各号に定める日時までに、当該各号に定める金額（ただし、各清算参加者が第三階層特別清算料担保金として当社に預託すべき金額の累計額は、同一の破綻処理単位期間につき、当該各清算参加者の当該破綻処理単位期間の開始日の前当社営業日における金利スワップ清算基金所要額を上限とする。）を、第三階層特別清算料担保金として当社に預託しなければならない。

(1) 破綻処理清算約定等に係る損失相当額（破綻処理清算約定の反対清算約定及び業務方法書第93条第2項の規定により清算約定とみなされた損失回避取引について、破綻認定日（破綻清算参加者が破綻処理清算約定について当該破綻認定日に履行すべき債務の履行を完了している場合は、当該破綻認定日の翌当社営業日）以降の各当社営業日において当社が清算参加者に支払うべき変動証拠金等の総額から当社が当該清算参加者から受け取るべき変動証拠金等の総額を控除した額が正数である場合の当該額をいう。以下同じ。）が、固定的損失補填財源の合計額を超過している場合において、その超過額のうち当該各清算参加者が第三階層特別清算料として負担することとなる額（同一の破綻処理単位期間

に係る期限前終了金額を支払い、又は当該各清算委託取引について預託を受けた変動証拠金を返還する。

(1)・(2) (略)

3 (略)

第5章 特別清算料担保金

(第三階層特別清算料担保金の預託義務)

第23条 各清算参加者は、他の清算参加者について破綻等が認定された場合には、次の各号に掲げる場合に応じて、当該各号に定める日時までに、当該各号に定める金額（ただし、各清算参加者が第三階層特別清算料担保金として当社に預託すべき金額の累計額は、同一の破綻処理単位期間につき、当該各清算参加者の当該破綻処理単位期間の開始日の前当社営業日における金利スワップ清算基金所要額を上限とする。）を、第三階層特別清算料担保金として当社に預託しなければならない。

(1) 破綻処理清算約定等に係る損失相当額（破綻処理清算約定の反対清算約定及び業務方法書第93条第2項の規定により清算約定とみなされた損失回避取引について、破綻認定日（破綻清算参加者が破綻処理清算約定について当該破綻認定日に履行すべき債務の履行を完了している場合は、当該破綻認定日の翌当社営業日）以降の各当社営業日において当社が清算参加者に支払うべき変動証拠金等の総額から当社が当該清算参加者から受け取るべき変動証拠金等の総額を控除した額が正数である場合の当該額をいう。以下同じ。）が、固定的損失補填財源の合計額を超過している場合において、その超過額のうち当該各清算参加者が第三階層特別清算料として負担することとなる額（同一の破綻処理単位期間

において認定された他の破綻等がある場合には、当該損失相当額をその時点で破綻処理入札が実施されたと仮定した場合に当社に生じ得る破綻処理損失とみなした場合に、第21条の規定により当該各清算参加者が第三階層特別清算料として負担することとなる額とする。)が、当該各清算参加者が当社に現に預託している清算約定(自己分)に係る当初証拠金及び破綻時証拠金の合計額を超過したとき

a 日時 当該超過した日の翌当社営業日の
午前11時

b (略)

(2) (略)

(3) 第12条第4項の場合において、各清算参加者が負担することとなる第三階層特別清算料として当社が同項第2号の規定により当該各清算参加者に通知した金額が、当該各清算参加者が当社に現に預託している第三階層特別清算料担保金の合計額を超過したとき

a 日時 当該通知の行われた破綻処理入札
実施日の翌当社営業日の午前11時

b (略)

(第四階層特別清算料担保金の預託義務)

第24条 各清算参加者は、他の清算参加者について破綻等が認定された場合には、次の各号に掲げる場合に応じて、当該各号に定める日時までに、当該各号に定める金額を、第四階層特別清算料担保金として当社に預託しなければならない。

(1) 破綻処理清算約定等に係る損失相当額が、固定的損失補填財源の合計額を超過している場合において、その超過額のうち当該各清算参加者が第三階層特別清算料及び第四階層特別清算料として負担することとなる額の

において認定された他の破綻等がある場合には、当該損失相当額をその時点で破綻処理入札が実施されたと仮定した場合に当社に生じ得る破綻処理損失とみなした場合に、第21条の規定により当該各清算参加者が第三階層特別清算料として負担することとなる額とする。)が、当該各清算参加者が当社に現に預託している清算約定(自己分)に係る当初証拠金及び破綻時証拠金の合計額を超過したとき

a 日時 当該超過した日の翌当社営業日の
正午

b (略)

(2) (略)

(3) 第12条第4項の場合において、各清算参加者が負担することとなる第三階層特別清算料として当社が同項第2号の規定により当該各清算参加者に通知した金額が、当該各清算参加者が当社に現に預託している第三階層特別清算料担保金の合計額を超過したとき

a 日時 当該通知の行われた破綻処理入札
実施日の翌当社営業日の正午

b (略)

(第四階層特別清算料担保金の預託義務)

第24条 各清算参加者は、他の清算参加者について破綻等が認定された場合には、次の各号に掲げる場合に応じて、当該各号に定める日時までに、当該各号に定める金額を、第四階層特別清算料担保金として当社に預託しなければならない。

(1) 破綻処理清算約定等に係る損失相当額が、固定的損失補填財源の合計額を超過している場合において、その超過額のうち当該各清算参加者が第三階層特別清算料及び第四階層特別清算料として負担することとなる額の

合計額（当該損失相当額をその時点で破綻処理入札が実施された場合に当社に生じ得る破綻処理損失とみなした場合において、第21条及び第22条の規定により当該各清算参加者が第三階層特別清算料及び第四階層特別清算料として負担することとなる額の合計額をいう。）が、当該各清算参加者が当社に現に預託している清算約定（自己分）に係る当初証拠金、破綻時証拠金及び第三階層特別清算料担保金及び第四階層特別清算料担保金の合計額を超過したとき

a 日時 当該超過した日の翌当社営業日の
午前11時

b (略)

(2) (略)

(3) 第12条第4項の場合において、各清算参加者が負担することとなる第三階層特別清算料及び第四階層特別清算料として当社が同項第2号の規定により当該各清算参加者に通知した金額の合計額が、当該各清算参加者が当社に現に預託している第三階層特別清算料担保金及び第四階層特別清算料担保金の合計額を超過したとき

a 日時 当該通知の行われた破綻処理入札
実施日の翌当社営業日の午前11時

b (略)

合計額（当該損失相当額をその時点で破綻処理入札が実施された場合に当社に生じ得る破綻処理損失とみなした場合において、第21条及び第22条の規定により当該各清算参加者が第三階層特別清算料及び第四階層特別清算料として負担することとなる額の合計額をいう。）が、当該各清算参加者が当社に現に預託している清算約定（自己分）に係る当初証拠金、破綻時証拠金及び第三階層特別清算料担保金及び第四階層特別清算料担保金の合計額を超過したとき

a 日時 当該超過した日の翌当社営業日の
正午

b (略)

(2) (略)

(3) 第12条第4項の場合において、各清算参加者が負担することとなる第三階層特別清算料及び第四階層特別清算料として当社が同項第2号の規定により当該各清算参加者に通知した金額の合計額が、当該各清算参加者が当社に現に預託している第三階層特別清算料担保金及び第四階層特別清算料担保金の合計額を超過したとき

a 日時 当該通知の行われた破綻処理入札
実施日の翌当社営業日の正午

b (略)

付 則

この改正規定は、平成26年2月24日から施行する。

CDS 清算業務に関する業務方法書等の一部改正新旧対照表

目 次

1. CDS 清算業務に関する業務方法書の一部改正新旧対照表
2. CDS 清算業務に関する業務方法書の取扱いの一部改正新旧対照表
3. CDS 清算基金所要額に関する規則の一部改正新旧対照表
4. CDS 清算参加者の破綻処理に関する規則の一部改正新旧対照表

CDS 清算業務に関する業務方法書の一部改正新旧対照表

新	旧
<p>(定義)</p> <p>第2条 本業務方法書等において使用する用語は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）及びISDAクレジットデリバティブ定義集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。</p> <p>(1) (略)</p> <p><u>(1)の2 「委託取引口座」とは、第59条第2項に規定する委託取引口座をいう。</u></p> <p>(2)～(10) (略)</p> <p><u>(10)の2 「決済金額」とは、清算約定に関し、当社及び清算参加者の間で授受される金銭（CDS清算基金、当初証拠金、変動証拠金及び変動証拠金に係る利息として授受される金銭を含まない。）の額（当該金銭のうち第80条第2項の規定により差引計算されるものについては、その差引計算後の額）をいう。</u></p> <p>(11)～(17) (略)</p> <p><u>(17)の2 「自己取引口座」とは、第59条第2項に規定する自己取引口座をいう。</u></p> <p>(18)～(26) (略)</p> <p><u>(26)の2 「清算取次口座」とは、第60条第1項に規定する清算取次口座をいう。</u></p> <p>(27)～(53) (略)</p> <p><u>(53)の2 「変動証拠金等」とは、変動証拠金、変動証拠金に係る利息、固定金額、変動支払及び任意解約手数料をいう。</u></p> <p>(54)～(66) (略)</p> <p>2・3 (略)</p>	<p>(定義)</p> <p>第2条 本業務方法書等において使用する用語は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）及びISDAクレジットデリバティブ定義集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。</p> <p>(1) (略)</p> <p>(新設)</p> <p>(2)～(10) (略)</p> <p>(新設)</p> <p>(11)～(17) (略)</p> <p>(新設)</p> <p>(18)～(26) (略)</p> <p>(新設)</p> <p>(27)～(53) (略)</p> <p>(新設)</p> <p>(54)～(66) (略)</p> <p>2・3 (略)</p>

(CDS 清算資格の要件)

第9条 承認審査は、取得申請者に関する次に掲げる事項その他当社によるCDS 清算業務の適切な遂行を確保する観点から必要と認める事項について、当社が通知又は公示により審査上の観点及び確認事項として定めるところにより行うものとする。

(1) ~ (3) (略)

2 (略)

(CDS 清算資格の喪失)

第23条 清算参加者が前条第1項の規定によりCDS 清算資格の喪失の申請をした場合、当該清算参加者は、その申請の日の翌日から起算して30日目の日の当社が定める時点又は当該清算参加者を当事者とする清算約定で未決済のもののすべて(当社が定めるものを除く。以下本項において同じ。)が解消された時点のいずれか遅い時点(当該申請が破綻処理単位期間中に行われた場合又は当該申請の日から当該清算参加者についてCDS 清算資格の喪失の効力が生じるまでの間に破綻処理単位期間が開始した場合には、破綻処理単位期間が終了する日の当社が定める時点又は当該清算参加者を当事者とする清算約定で未決済のもののすべてが解消された時点のいずれか遅い時点)において、CDS 清算資格を喪失する。

2 (略)

(CDS 清算資格の喪失申請者の合併等の特例)

第24条 当社は、CDS 清算資格の喪失申請者がCDS 清算資格の喪失と同時に、CDS 清算資格を取得する者又はCDS 清算資格を有する者に合併され、分割により事業を承継させ又は事業を譲渡する等の場合で、当該清算参加者の

(CDS 清算資格の要件)

第9条 承認審査は、取得申請者に関する次に掲げる事項その他当社によるCDS 清算業務の適切な遂行を確保する観点から必要と認める事項について行うものとする。

(1) ~ (3) (略)

2 (略)

(CDS 清算資格の喪失)

第23条 清算参加者が前条第1項の規定によりCDS 清算資格の喪失の申請をした場合、当該清算参加者は、その申請の日の翌日から起算して30日目の日の当社が定める時点又は当該清算参加者を当事者とするすべての清算約定が解消された時点のいずれか遅い時点(当該申請が破綻処理単位期間中に行われた場合又は当該申請の日から当該清算参加者についてCDS 清算資格の喪失の効力が生じるまでの間に破綻処理単位期間が開始した場合には、破綻処理単位期間が終了する日の当社が定める時点又は当該清算参加者を当事者とするすべての清算約定が解消された時点のいずれか遅い時点)において、CDS 清算資格を喪失する。

2 (略)

(CDS 清算資格の喪失申請者の合併等の特例)

第24条 当社は、CDS 清算資格の喪失申請者がCDS 清算資格の喪失と同時に、CDS 清算資格を取得する者又はCDS 清算資格を有する者に合併され、分割により事業を承継させ又は事業を譲渡する等の場合で、当該清算参加者の

清算約定で未決済のものすべてを解消させる必要がないと当社が認めるとき（受託清算参加者にあつては、当該受託清算参加者が締結している清算受託契約のすべてを解約させる必要がないと当社が認めるときを含む。）は、前条第1項の規定にかかわらず、当該喪失申請者は、当社がその都度定める時点において、CDS清算資格を喪失する。

（CDS清算資格を喪失した場合における清算約定の取扱い）

第38条 清算参加者は、CDS清算資格を取り消された場合には、当社がその都度定める期間内に、当該清算参加者の清算約定で未決済のものすべて（当社が定めるものを除く。）を解消しなければならない。

2 前項の場合において、清算参加者が前項に規定する期間内に清算約定で未決済のものすべてを解消することができないときは、当該清算約定は、第10章第2節の規定（第97条から第99条までの規定を除く。）に準じて処理されるものとする。この場合において、必要な事項は当社がその都度定める。

3 （略）

（清算約定の区分管理）

第46条 （略）

2 受託清算参加者は、清算約定（委託分）を、清算取次口座ごとに区分して管理しなければならない。

（清算約定の任意解約）

第53条 （略）

2～4 （略）

5 任意解約手数料の支払方である清算参加者は、当該任意解約手数料を、当社が第1項の規

清算約定のすべてを解消させる必要がないと当社が認めるとき（受託清算参加者にあつては、当該受託清算参加者が締結している清算受託契約のすべてを解約させる必要がないと当社が認めるときを含む。）は、前条第1項の規定にかかわらず、当該喪失申請者は、当社がその都度定める時点において、CDS清算資格を喪失する。

（CDS清算資格を喪失した場合における清算約定の取扱い）

第38条 清算参加者は、CDS清算資格を取り消された場合には、当社がその都度定める期間内に、当該清算参加者のすべての清算約定（当社が定めるものを除く。）を解消しなければならない。

2 前項の場合において、清算参加者が前項に規定する期間内にすべての清算約定を解消することができないときは、当該清算約定は、第10章第2節の規定（第97条から第99条までの規定を除く。）に準じて処理されるものとする。この場合において、必要な事項は当社がその都度定める。

3 （略）

（清算約定の区分管理）

第46条 （略）

2 受託清算参加者は、清算約定（委託分）を、清算委託者ごとに区分して管理しなければならない。

（清算約定の任意解約）

第53条 （略）

2～4 （略）

5 任意解約手数料の支払方である清算参加者は、当該任意解約手数料を、当社が第1項の規

定による清算約定の任意解約の申入れ及び当該清算約定の反対清算約定の任意解約の申入れを受けた日の3営業日後の日の午前11時までに、当社に支払わなければならない。

6 当社は、任意解約手数料の支払方である場合には、当該任意解約手数料を、当社が第1項の規定による清算約定の任意解約の申入れ及び当該清算約定の反対清算約定の任意解約の申入れを受けた日の3営業日後の日の午後1時30分以降遅滞なく、当社が任意解約する清算約定の当事者である清算参加者に支払う。

7 (略)

(清算参加者口座)

第59条 (略)

2 清算参加者口座は、清算参加者の自己の計算による清算約定を記録する口座（以下「自己取引口座」という。）と清算委託者の計算による清算約定を清算受託契約ごとに記録する口座（以下「委託取引口座」という。）に区分する。この場合、複数の清算委託者又は同一の清算委託者を当事者とする複数の清算受託契約について同一の委託取引口座を設定することはできない。

3 当社は、清算参加者の請求があった場合には、当該清算参加者のために自己取引口座又は複数の委託取引口座を開設することができる。

4～6 (略)

7 各清算約定並びにこれに係る当初証拠金及び変動証拠金に係る当社と清算参加者の間の債権債務及び当社と清算委託者の間の債権債務は、自己取引口座及び委託取引口座ごとに生じるものとする。

(清算取次口座)

第60条 受託清算参加者は、清算委託者との間

定による清算約定の任意解約の申入れ及び当該清算約定の反対清算約定の任意解約の申入れを受けた日の3営業日後の日の午後1時までに、当社に支払わなければならない。

6 当社は、任意解約手数料の支払方である場合には、当該任意解約手数料を、当社が第1項の規定による清算約定の任意解約の申入れ及び当該清算約定の反対清算約定の任意解約の申入れを受けた日の3営業日後の日の午後2時45分以降遅滞なく、当社が任意解約する清算約定の当事者である清算参加者に支払う。

7 (略)

(清算参加者口座)

第59条 (略)

2 清算参加者口座は、清算参加者の自己の計算による清算約定を記録する口座（以下「自己取引口座」という。）と清算委託者の計算による清算約定を清算委託者ごとに記録する口座（以下「委託取引口座」という。）に区分する。

3 当社は、清算参加者の請求があった場合には、当該清算参加者のために複数の自己取引口座又は委託取引口座を開設することができる。

4～6 (略)

(新設)

(清算取次口座)

第60条 受託清算参加者は、清算委託者ごとに、

で締結された清算受託契約ごとに、各清算委託者を当事者とする清算委託取引の内容、当該清算委託取引に係る当初証拠金、委託当初証拠金、変動証拠金、清算約定（委託分）のクレジットイベント決済時に授受する金銭等その他当該各清算受託契約並びに本業務方法書等に基づいて清算委託者との間で授受される金銭等を管理するための口座（以下「清算取次口座」という。）を開設する。

2 （略）

3 各清算委託取引並びにこれに係る当初証拠金及び変動証拠金に係る受託清算参加者と清算委託者との間の債権債務は、清算取次口座ごとに生じるものとする。

（清算参加者の当初証拠金所要額）

第64条 （略）

2 （略）

3 清算約定（委託分）に係る各委託取引口座の当初証拠金所要額は、当該各委託取引口座について算出した額（区分口座が設定されている委託取引口座にあっては、各区分口座について算出した額の合計額）とする。

4 （略）

（当初証拠金の預託時限）

第66条 清算参加者及び清算委託者は、当初証拠金として当社に預託した金銭及び代用有価証券の代用価格の合計額（以下「当初証拠金預託額」という。）が、当社に預託すべき自己取引口座又は委託取引口座ごとの当初証拠金所要額に不足する場合には、その不足が生じた日の翌当社営業日午前11時までに、その不足額を当社に預託しなければならない。

2 前項の規定にかかわらず、清算委託者が非居住者である場合には、当該清算委託者は、不足

各清算委託者を当事者とする清算委託取引の内容、当該清算委託取引に係る当初証拠金、委託当初証拠金、変動証拠金、清算約定（委託分）のクレジットイベント決済時に授受する金銭等その他清算受託契約並びに本業務方法書等に基づいて清算委託者との間で授受される金銭等を管理するための口座（以下「清算取次口座」という。）を開設する。

2 （略）

（新設）

（清算参加者の当初証拠金所要額）

第64条 （略）

2 （略）

3 清算約定（委託分）に係る当初証拠金所要額は、各委託取引口座について算出した額（区分口座が設定されている委託取引口座にあっては、各区分口座について算出した額の合計額）の合計額とする。

4 （略）

（当初証拠金の預託時限）

第66条 清算参加者及び清算委託者は、当初証拠金として当社に預託した金銭及び代用有価証券の代用価格の合計額が、当社に預託すべき当初証拠金所要額に不足する場合には、その不足が生じた日の翌当社営業日（当該清算委託者が非居住者である場合には、当該不足が生じた日の翌々当社営業日）正午までに、その不足額を当社に預託しなければならない。

（新設）

が生じた日の翌々当社営業日の午前11時まで
に当該不足額を当社に預託するものとする。

(清算委託者による当初証拠金の預託)

第68条 (略)

2 (略)

3 受託清算参加者は、清算委託者から当初証拠金として交付を受けた金銭及び代用有価証券について、清算取次口座ごとに帳簿を作成及び記帳するなどの区分管理を行わなければならない。

4 清算委託者が受託清算参加者に対し当初証拠金として交付した金銭及び代用有価証券の代用価格の合計額が、当該清算委託者が当社に預託すべき当初証拠金所要額を下回っている場合、当該受託清算参加者は、その不足額以上の金銭又は代用有価証券を、第66条第1項に規定する日時までに、自己の負担で当社に預託しなければならない。

5 (略)

(差換預託)

第69条 (略)

2 (略)

3 前項の場合において、受託清算参加者は、清算委託者から委託当初証拠金として預託を受けた金銭及び代用有価証券について清算取次口座ごとに帳簿を作成及び記帳するなどの区分管理しなければならない。

(当初証拠金の区分及び管理方法)

第71条 清算参加者は、当社に対して当初証拠金として金銭又は代用有価証券を交付する場合には、当該金銭又は代用有価証券を、次に掲げる当初証拠金に区分して預託するものとする。

(清算委託者による当初証拠金の預託)

第68条 (略)

2 (略)

3 受託清算参加者は、清算委託者から当初証拠金として交付を受けた金銭及び代用有価証券について、清算委託者ごとに帳簿を作成及び記帳するなどの区分管理を行わなければならない。

4 清算委託者が受託清算参加者に対し当初証拠金として交付した金銭及び代用有価証券の代用価格の合計額が、当該清算委託者が当社に預託すべき当初証拠金所要額を下回っている場合、当該受託清算参加者は、その不足額以上の金銭又は代用有価証券を、自己の負担で当社に預託しなければならない。

5 (略)

(差換預託)

第69条 (略)

2 (略)

3 前項の場合において、受託清算参加者は、清算委託者から委託当初証拠金として預託を受けた金銭及び代用有価証券について、清算委託者ごとに帳簿を作成及び記帳するなどの区分管理しなければならない。

(当初証拠金の区分及び管理方法)

第71条 清算参加者は、当社に対して当初証拠金として金銭又は代用有価証券を交付する場合には、当該金銭又は代用有価証券を、次に掲げる当初証拠金に区分して預託するものとする。

- (1) (略)
- (2) 各清算委託者の清算約定（委託分）に係る当初証拠金のうち清算委託者の代理人として預託するもの
- (3) 各清算委託者の清算約定（委託分）に係る当初証拠金のうち差換当初証拠金として預託するもの

2 (略)

3 第1項第3号に掲げる差換当初証拠金については、清算参加者は、委託当初証拠金の額（代用有価証券の場合にはその代用価格の合計額）を、毎当社営業日、当社に報告を行うものとし、当社は当該額と差換当初証拠金の差額を区分して管理するものとする。

(当初証拠金の返還請求権)

第72条 清算参加者及び清算委託者は、次の各号に掲げる当初証拠金の区分に応じ、当該各号に定めるところにより当社に対する当初証拠金の返還請求権を有する。

- (1) 清算約定（委託分）に係る当初証拠金
 - a 清算委託者は、当該清算委託者が当社に預託した清算約定（委託分）（当該清算委託者が受託清算参加者との間で締結した清算受託契約に基づく有価証券等清算取次ぎの委託により成立するものに限る。以下本号において同じ。）に係る当初証拠金の額及び当該清算委託者が当該清算約定（委託分）に関して当社に預託した差換当初証拠金の額の合計額から、当該清算委託者が清算委託取引に関して当該受託清算参加者に対して負担する未履行債務（当該清算参加者の破綻等その他の事由による当該清算約定（委託分）の処理に伴って生じる債務のうち未履行であるものを含む。以下本号において同じ。）を控除した額の範囲内で、当該清算委託者が当社

- (1) (略)
- (2) 清算約定（委託分）に係る当初証拠金のうち清算委託者の代理人として預託するもの
- (3) 清算約定（委託分）に係る当初証拠金のうち差換当初証拠金として預託するもの

2 (略)

(新設)

(当初証拠金の返還請求権)

第72条 清算参加者及び清算委託者は、次の各号に掲げる当初証拠金の区分に応じ、当該各号に定めるところにより当社に対する当初証拠金の返還請求権を有する。

- (1) 清算約定（委託分）に係る当初証拠金
 - a 清算委託者は、当該清算委託者が当社に預託した当初証拠金の額及び当該清算委託者が清算受託契約を締結している受託清算参加者が当社に預託した差換当初証拠金のうち清算委託者が当該受託清算参加者に預託した委託当初証拠金の額（当該受託清算参加者が当社に預託した差換当初証拠金の額が当該受託清算参加者と清算受託契約を締結しているすべての清算委託者が当該受託清算参加者に預託した委託当初証拠金の合計額に満たない場合には、各清算委託者が当該受託清算参加者に預託した委託当初証拠金の額に応じて按分した額）の合計額から、当該清算委託者が清算委託取引に関して当該受託清算参加者に対して負担する未履

に預託した当該清算約定（委託分）に係る当初証拠金の額及び当該受託清算参加者が当該清算約定（委託分）に関して当社に預託した差換当初証拠金の額のうち当該清算委託者が当該受託清算参加者に預託した清算委託取引（当該清算受託契約に基づく有価証券等清算取次ぎの委託により成立するものに限る。）に係る委託当初証拠金の額の合計額から、当該清算委託者が当該清算委託取引に関して当該受託清算参加者に対して負担する未履行債務（当該清算委託取引の終了に伴って生じる債務のうち未履行であるものを含む。）を控除した額に相当する部分について、当初証拠金の返還請求権を有する。

- b 清算参加者は、当該清算参加者と清算受託契約を締結している前 a に規定する清算委託者が当社に預託した清算約定（委託分）に係る当初証拠金及び当該清算参加者が当該清算約定（委託分）に関して当社に預託した差換当初証拠金の合計額から、当該清算参加者が当該清算約定（委託分）に関して当社に対して負担する未履行債務の額及び当該清算委託者が当初証拠金の返還請求権を有する額の合計額を控除した額に相当する部分について、当初証拠金の返還請求権を有する。

(2) (略)

2～5 (略)

(変動証拠金所要額)

第74条 (略)

2 当社は、清算約定（委託分）の変動証拠金所要額を、当社が定める方法により委託取引口座ごとに算出し、その金額を当該清算委託者と清算受託契約を締結している受託清算参加者に通

行債務（当該清算委託取引の終了に伴って生じる債務のうち未履行であるものを含む。）の額を控除した額に相当する部分について、当初証拠金の返還請求権を有する。

- b 清算参加者は、当該清算参加者と清算受託契約を締結している清算委託者が当社に預託した当初証拠金及び当該清算参加者が清算約定（委託分）に関して当社に預託した差換当初証拠金の合計額から、当該清算参加者が清算約定（委託分）に関して当社に対して負担する未履行債務（当該清算参加者の破綻等その他の事由による清算約定（委託分）の処理に伴って生じる債務のうち未履行であるものを含む。）の額及び前 a に規定する清算委託者が当初証拠金の返還請求権を有する額の合計額を控除した額に相当する部分について、当初証拠金の返還請求権を有する。

(2) (略)

2～5 (略)

(変動証拠金所要額)

第74条 (略)

2 当社は、清算約定（委託分）の変動証拠金所要額を、当社が定める方法により清算委託者ごとに算出し、その金額を当該清算委託者と清算受託契約を締結している受託清算参加者に通知

知する。

(変動証拠金の預託時限)

第77条 清算参加者は、変動証拠金の授受において支払方となる場合には、当該変動証拠金の算出日の翌当社営業日の午前11時までに、変動証拠金所要額に相当する金銭を当社に預託しなければならない。

2 当社は、変動証拠金の授受において受領方となる清算参加者に対し、当該変動証拠金の算出日の翌当社営業日の午後1時30分以降遅滞なく、変動証拠金所要額に相当する金銭を当該清算参加者に預託する。

(変動証拠金に係る利息の取扱い)

第78条 (略)

2 清算参加者は、変動証拠金に係る利息を、毎月第3当社営業日の午前11時までに、当社に支払わなければならない。

3 当社は、毎月第3当社営業日の午後1時30分以降遅滞なく、変動証拠金に係る利息を清算参加者に支払う。

(資金決済の方法)

第80条 (略)

2 当社は、清算参加者との間で授受する金銭を、当社が定めるところにより、自己取引口座及び委託取引口座ごとに、差引計算して授受することができる。

(当初証拠金及び決済金額等の差引計算)

第80条の2 前条第2項の規定により差引計算した結果、清算参加者が当社に対して決済金額及び変動証拠金(本条及び次条において「決済金額等」という。)を支払うこととなる場合には、当該決済金額等の支払い及び第66条に規

する。

(変動証拠金の預託時限)

第77条 清算参加者は、変動証拠金の授受において支払方となる場合には、当該変動証拠金の算出日の翌当社営業日の午後1時までに、変動証拠金所要額に相当する金銭を当社に預託しなければならない。

2 当社は、変動証拠金の授受において受領方となる清算参加者に対し、当該変動証拠金の算出日の翌当社営業日の午後2時45分以降遅滞なく、変動証拠金所要額に相当する金銭を当該清算参加者に預託する。

(変動証拠金に係る利息の取扱い)

第78条 (略)

2 清算参加者は、変動証拠金に係る利息を、毎月第3当社営業日の午後1時までに、当社に支払わなければならない。

3 当社は、毎月第3当社営業日の午後2時45分以降遅滞なく、変動証拠金に係る利息を清算参加者に支払う。

(資金決済の方法)

第80条 (略)

2 当社は、清算参加者との間で授受する金銭を、当社が定める種類ごとに、差引計算して授受することができる。

(新設)

定する当初証拠金の預託については、自己取引口座及び委託取引口座ごとに、次に掲げる計算式の順序に従って差引計算するものとし、それぞれ算出された額が負の数になる場合には、清算参加者は当社に対し当該額を預託するものとする。ただし、第1号に係る預託については、現金により預託しなければならない。

(1) (前当社営業日末時点における当初証拠金預託額のうち現金による預託額) - (同時点において清算参加者が支払うこととなる決済金額等)

(2) (前当社営業日末時点における当初証拠金預託額 - 充当現金預託額 (前号による差引計算の結果、清算参加者が支払うこととなる決済金額等に充当された当初証拠金預託額のうち現金による預託額をいう。)) - (同時点における当初証拠金所要額)

2 前条第2項の規定により差引計算した結果、清算参加者が当社から決済金額等を受領することとなる場合には、当該決済金額等の支払い及び第66条に規定する当初証拠金の預託については、自己取引口座及び委託取引口座ごとに、次に掲げる計算式に従って差引計算するものとし、算出された額が負の数になる場合には、清算参加者は当社に対し当該額を預託するものとする。

(新設)

(前当社営業日末時点における当初証拠金預託額 + 同時点において清算参加者が受領することとなる決済金額等) - (前当社営業日末時点における当初証拠金所要額)

(返戻の申請及び当初証拠金のみなし預託)

第80条の3 前条の差引計算の結果、決済金額等を受領することとなる清算参加者は、当社に対し、自己取引口座及び委託取引口座ごとに受領する金銭の額を明らかにしたうえで申請を行

(新設)

うことにより、当該金銭を受領するものとする。

2 前項の申請がなされなかった場合、自己取引口座又は委託取引口座ごとに算出された決済金額等は、当該口座に係る当初証拠金として預託されたものとみなす。

(清算預託金の管理及び運用)

第88条 当社は、前条の清算預託金の全額を、清算預託金を預託した清算参加者又は清算委託者のために、当社が定める方法により分別して管理するものとする。

(清算約定(委託分)等の承継)

第95条 清算委託者(清算受託契約に規定する期限の利益喪失事由が発生していない者に限る。以下、本条において同じ。)は、第92条の規定により当該清算委託者の計算により成立した清算約定(委託分)が終了した場合には、当社が規則で定める期間内に限り、承継清算参加者(本項に規定する承継清算参加者をいう。)を経由して当社に当社所定の承継申込書を交付することにより、当該清算約定(委託分)に対応する次に掲げる権利義務を一括して破綻清算参加者以外の清算参加者(当該清算委託者と清算受託契約を締結している清算参加者に限る。以下「承継清算参加者」という。)に承継(本条の定めるところにより、当社、承継清算参加者及び清算委託者の間で当該権利義務を新たに発生させるとともに、それに伴う金銭の授受及び権利義務の処理を行うことをいう。以下同じ。)させることができる。

(1)・(2) (略)

(新設)

(清算預託金の管理及び運用)

第88条 当社は、前条の清算預託金を、清算預託金を預託した清算参加者のために、自己の固有の財産と口座を区分する等の方法により分別して保管するものとし、当該清算参加者ごとに、CDS清算基金、当初証拠金、第三階層特別清算料担保金及び破綻時証拠金の種類に区分して帳簿により管理するものとする。

(清算約定(委託分)等の承継)

第95条 清算委託者は、第92条の規定により当該清算委託者の計算により成立した清算約定(委託分)が終了した場合には、当社が規則で定める期間内に限り、承継清算参加者(本項に規定する承継清算参加者をいう。)を経由して当社に当社所定の承継申込書を交付することにより、当該清算約定(委託分)に対応する次に掲げる権利義務を一括して破綻清算参加者以外の清算参加者(当該清算委託者と清算受託契約を締結している清算参加者に限る。以下「承継清算参加者」という。)に承継(本条の定めるところにより、当社、承継清算参加者及び清算委託者の間で当該権利義務を新たに発生させるとともに、それに伴う金銭の授受及び権利義務の処理を行うことをいう。以下同じ。)させることができる。

(1)・(2) (略)

2～6 (略)

(CDS 決済保証準備金等による損失の補填)

第104条 前条の規定による算出の結果、当社の破綻清算参加者に対する債権が生じ得る場合には、当社は、当初損失確定日において、当該債権の額に対応する当社の損失（当社が規則で定めるものを除く。）及び破綻清算参加者の破綻処理（当該破綻清算参加者の破綻等に伴う破綻処理入札の実施その他の必要な処理をいう。以下同じ。）について当初損失確定日までに当社に生じたその他の損失（当社が規則で定めるものに限る。）（以下「破綻処理損失」という。）を、次の各号に掲げる順序に従い、当該各号に掲げる方法により補填する。

(1) (略)

(2) 当該破綻清算参加者以外の各清算参加者が当社に預託したCDS清算基金（当該破綻清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額（同一の破綻処理単位期間において認定された他の破綻等について生じた当社の損失を補填するために、本条の規定により当該各清算参加者が当社に預託したCDS清算基金から取り崩された額があるときは、当該額を控除した残額とする。以下本条において同じ。）を上限とする。）及び第二階層CDS決済保証準備金の取崩し。

2・3 (略)

(第四階層特別清算料による損失の補填)

第106条 破綻処理損失について、前条に定めるところによってもなお補填することができない損失がある場合には、破綻認定日における破綻清算参加者以外の清算参加者のうち、破綻認定日から当初損失確定日までのすべての清算約定（破綻認定日後に成立した清算約定及び当初

2～6 (略)

(CDS 決済保証準備金等による損失の補填)

第104条 前条の規定による算出の結果、当社の破綻清算参加者に対する債権が生じ得る場合には、当社は、当初損失確定日において、当該債権の額に対応する当社の損失（当社が規則で定めるものを除く。）及び破綻清算参加者の破綻処理（当該破綻清算参加者の破綻等に伴う破綻処理入札の実施その他の必要な処理をいう。以下同じ。）について当初損失確定日までに当社に生じたその他の損失（当社が規則で定めるものに限る。）（以下「破綻処理損失」という。）を、次の各号に掲げる順序に従い、当該各号に掲げる方法により補填する。

(1) (略)

(2) 当該破綻清算参加者以外の各清算参加者が当社に預託したCDS清算基金（当該破綻清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額（同一の破綻処理単位期間において認定された他の破綻等について生じた当社の損失を補填するために、本条の規定により当該各清算参加者が当社に預託したCDS清算基金から取り崩された額があるときは、当該額を控除した残額とする。以下本条において同じ。）を上限とする。）及びCDS第二階層決済保証準備金の取崩し。

2・3 (略)

(第四階層特別清算料による損失の補填)

第106条 破綻処理損失について、前条に定めるところによってもなお補填することができない損失がある場合には、破綻認定日における破綻清算参加者以外の清算参加者のうち、破綻認定日から当初損失確定日までのすべての清算約定（破綻認定日後に成立した清算約定及び当初

損失確定日までに任意解約その他の事由により終了した清算約定を含む。以下同じ。)に係る変動証拠金等の受け取るべき額の総額が支払うべき額の総額を上回る者(以下本条において「第四階層特別清算料負担参加者」という。)は、当社が規則で定めるところにより、第四階層特別清算料を当社に支払う義務を負う。この場合において、当社は、第四階層特別清算料負担参加者から支払いを受けた第四階層特別清算料をもって、当該損失を補填する。

2 (略)

(破綻時証拠金の預託)

第107条の2 (略)

2～4 (略)

5 清算参加者は、破綻時証拠金として当社に預託した金銭及び代用有価証券の代用価格の合計額が、当社に預託すべき破綻時証拠金所要額に不足する場合には、その不足が生じた日の翌当社営業日の午前11時までに、その不足額を当社に預託しなければならない。

6・7 (略)

第108条 削除

(最終損失確定時の調整)

第110条 第102条第2項の規定による当社

損失確定日までに任意解約その他の事由により終了した清算約定を含む。以下同じ。)に係る変動証拠金等(変動証拠金、変動証拠金に係る利息、固定金額、変動支払及び任意解約手数料をいう。以下同じ。)の受け取るべき額の総額が支払うべき額の総額を上回る者(以下本条において「第四階層特別清算料負担参加者」という。)は、当社が規則で定めるところにより、第四階層特別清算料を当社に支払う義務を負う。この場合において、当社は、第四階層特別清算料負担参加者から支払いを受けた第四階層特別清算料をもって、当該損失を補填する。

2 (略)

(破綻時証拠金の預託)

第107条の2 (略)

2～4 (略)

5 清算参加者は、破綻時証拠金として当社に預託した金銭及び代用有価証券の代用価格の合計額が、当社に預託すべき破綻時証拠金所要額に不足する場合には、その不足が生じた日の翌当社営業日の正午までに、その不足額を当社に預託しなければならない。

6・7 (略)

(複数の破綻処理入札が同日に実施される場合におけるCDS清算基金の追加預託)

第108条 清算参加者は、複数の破綻処理入札が同日に実施される場合には、同日の正午までに、CDS清算基金所要額に同日に実施される破綻処理入札の数を乗じた額に満つるまでの金銭又は代用有価証券を、追加のCDS清算基金として当社に預託しなければならない。

(最終損失確定時の調整)

第110条 第102条第2項の規定による当社

の破綻清算参加者に対する債権の額が確定した場合において、当該債権の額が破綻処理損失の額を上回るときは、当社は、当該債権の額が確定した日において、その超過額に対応する当社の損失を、次の各号に掲げる順序に従い、当該各号に掲げる方法により補填する。

(1) 第一階層CDS決済保証準備金の取崩し

(2) 当該破綻清算参加者以外の各清算参加者が当社に預託したCDS清算基金（本項柱書の破綻清算参加者に係る破綻認定日の属する破綻処理単位期間の開始日の前当社営業日における当該各清算参加者のCDS清算基金所要額から第104条の規定により取り崩された額を控除した残額を上限とする。）及び第二階層CDS決済保証準備金の取崩し

(3)・(4) (略)

2 (略)

付 則

この改正規定は、平成26年2月24日から施行する。

の破綻清算参加者に対する債権の額が確定した場合において、当該債権の額が破綻処理損失の額を上回るときは、当社は、当該債権の額が確定した日において、その超過額に対応する当社の損失を、次の各号に掲げる順序に従い、当該各号に掲げる方法により補填する。

(1) 第一階層決済保証準備金の取崩し

(2) 当該破綻清算参加者以外の各清算参加者が当社に預託したCDS清算基金（当該破綻清算参加者に係る破綻認定日における当該各清算参加者のCDS清算基金所要額から第104条の規定により取り崩された額を控除した残額を上限とする。）及び第二階層決済保証準備金の取崩し

(3)・(4) (略)

2 (略)

CDS 清算業務に関する業務方法書の取扱いの一部改正新旧対照表

新	旧
<p>(金銭の授受の方法)</p> <p>第22条 業務方法書第17条第1項、第67条又は第107条第1項第1号の規定により金銭の授受を行う場合は、<u>日本銀行金融ネットワークシステムを利用して、当社名義の日本銀行当座勘定と当該清算参加者名義の日本銀行当座勘定の間の振替により行うものとする。</u></p>	<p>(金銭の授受の方法)</p> <p>第22条 業務方法書第17条第1項、第67条又は第107条第1項第1号の規定により金銭の授受を行う場合は、<u>次に定めるところにより行うものとする。</u></p> <p><u>(1) 金銭を支払う清算参加者は、当社が通知又は公示により指定する銀行のうちから清算参加者が選定した銀行に設けられた当社名義の口座に振り込むものとする。</u></p> <p><u>(2) 金銭を受領する清算参加者は、清算参加者が選定した銀行に口座を設け、当該口座において受領するものとする。</u></p>
<p>(清算約定の内容等)</p> <p>第37条 (略)</p> <p>2・3 (略)</p> <p>4 固定金額の支払いは、次に定めるところにより行う。</p> <p>(1) 清算約定の買い手である清算参加者は、<u>午前11時までに固定金額に相当する金銭を当社に支払わなければならない。</u></p> <p>(2) 当社は、<u>午後1時30分以降遅滞なく、固定金額に相当する金銭を清算約定の売り手である清算参加者に支払う。</u></p>	<p>(清算約定の内容等)</p> <p>第37条 (略)</p> <p>2・3 (略)</p> <p>4 固定金額の支払いは、次に定めるところにより行う。</p> <p>(1) 清算約定の買い手である清算参加者は、<u>午後1時までに固定金額に相当する金銭を当社に支払わなければならない。</u></p> <p>(2) 当社は、<u>午後2時45分以降遅滞なく、固定金額に相当する金銭を清算約定の売り手である清算参加者に支払う。</u></p>
<p>(資金決済の方法)</p> <p>第52条 (略)</p> <p>2 (略)</p> <p>3 業務方法書第80条第2項に規定する<u>差引計算は、次の各号に掲げる金銭ごとに、当該金銭の総受取額と総支払額の差引計算とする。</u></p> <p><u>(1) 第1項第2号に掲げる金銭</u></p>	<p>(資金決済の方法)</p> <p>第52条 (略)</p> <p>2 (略)</p> <p>3 業務方法書第80条第2項に規定する<u>当社が定める種類は、次に定めるとおりとする。</u></p> <p><u>(1) 変動証拠金及び第四階層特別清算料担保金</u></p>

<p>(2) <u>第1項各号に掲げる金銭から、前号に掲げる金銭を除いた金銭</u></p>	<p>(2) <u>任意解約手数料</u> (3) <u>変動証拠金に係る利息</u> (4) <u>固定金額</u> (5) <u>クレジットイベント決済代金及びクレジットイベント決済時における固定金額</u> (6) <u>損失回避取引に係るイニシャルペイメント金額</u></p>
<p>(清算預託金の管理) 第52条の2 <u>業務方法書第88条に規定する当社が定める方法は、次の各号に掲げる清算預託金(清算委託者が預託した当初証拠金を除く。)</u>の資産区分に応じて、当該各号に定める方法とする。</p> <p>(1) <u>金銭</u> 次に掲げる方法により当社の固有資産、<u>他の清算業務に係る預かり資産及び清算委託者の当初証拠金</u>とは分別して保管し、清算参加者ごとに、清算預託金の種類(CDS清算基金、当初証拠金、第三階層特別清算料担保金及び破綻時証拠金の種類をいう。以下本条において同じ。)に区分して帳簿により管理する。</p> <p>a・b (略)</p> <p>(2) (略)</p> <p>(3) <u>財務省証券</u> 次に掲げる方法により当社の固有財産、<u>他の清算業務に係る預かり資産及び清算委託者の当初証拠金</u>とは分別して保管し、清算参加者ごとに、清算預託金の種類に区分して帳簿により管理する。</p> <p>a・b (略)</p>	<p>(清算預託金の管理) 第52条の2 <u>業務方法書第88条に規定する当社が定める方法は、次の各号に掲げる清算預託金の資産区分に応じて、当該各号に定める方法とする。</u></p> <p>(1) <u>金銭</u> 次に掲げる方法により当社の固有資産<u>及び</u>他の清算業務に係る預かり資産とは分別して保管し、清算参加者ごとに、清算預託金の種類(CDS清算基金、当初証拠金、第三階層特別清算料担保金及び破綻時証拠金の種類をいう。以下本条において同じ。)に区分して帳簿により管理する。</p> <p>a・b (略)</p> <p>(2) (略)</p> <p>(3) <u>財務省証券</u> 次に掲げる方法により当社の固有財産とは分別して保管し、清算参加者ごとに、清算預託金の種類に区分して帳簿により管理する。</p> <p>a・b (略)</p>
<p>2 <u>清算委託者の当初証拠金に係る業務方法書第88条に規定する当社が定める方法は、次の各号に掲げる清算委託者の当初証拠金の資産区分に応じて、当該各号に定める方法とする。</u></p>	<p>(新設)</p>

(1) 金銭

次に掲げる方法により当社の固有資産、他の清算業務に係る預かり資産及び清算参加者が預託した清算預託金とは分別して保管し、清算委託者ごとに区分して帳簿により管理する。

a 当社名義の決済性預金口座への預金

b 信託業務を営む銀行への金銭信託

(2) 国債証券

次に掲げる方法により当社の固有財産とは分別して保管し、清算委託者ごとに区分して帳簿により管理する。

a 日本銀行の国債振替決済制度において日本銀行に開設された当社名義の分別管理口座への記録

b 信託業務を営む銀行への信託

(3) 財務省証券

次に掲げる方法により当社の固有財産、他の清算業務に係る預かり資産及び清算参加者が預託した清算預託金とは分別して保管し、清算委託者ごとに区分して帳簿により管理する。

a アメリカ合衆国ニューヨーク州ニューヨーク市に所在する銀行に開設された当社名義の口座への記録

b 信託業務を営む銀行への信託

(入札決済における金銭の支払時期等)

第55条 入札決済における入札決済金額に相当する金銭の授受は、次に定めるところにより行う。

(1) 当該入札決済に係る清算約定の売り手である清算参加者は、当該清算約定に適用ある入札決済日の午前11時までに入札決済金額に相当する金銭を当社に支払わなければならない。

(入札決済における金銭の支払時期等)

第55条 入札決済における入札決済金額に相当する金銭の授受は、次に定めるところにより行う。

(1) 当該入札決済に係る清算約定の売り手である清算参加者は、当該清算約定に適用ある入札決済日の午後1時までに入札決済金額に相当する金銭を当社に支払わなければならない。

(2) 当社は、前項の入札決済日の午後1時30分以降遅滞なく、入札決済金額に相当する金銭を当該入札決済に係る清算約定の買い手である清算参加者に支払う。

(事務の委任)

第58条 業務方法書第118条第1項に規定する当社が定める事務は、業務方法書第75条第1項及び第2項の規定による清算値段の算出に係る事務とする。

2 (略)

様式第3号 清算受託契約の様式

CDS 清算受託契約書

(定義)

第2条 本契約において使用する用語は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）及び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) 「委託清算約定」とは、本契約に基づく乙の有価証券等清算取次ぎの委託に基づき、甲とクリアリング機構の間に成立する清算約定をいう。

(2) (略)

(3) 「期限前終了金額」とは、第34条の規定によりすべての本清算委託取引が終了した場合に甲乙間で授受すべき金銭をいう。

(4)～(7) (略)

(8) 「本清算委託取引」とは、本契約に基づく個別の有価証券等清算取次ぎの委託により成立する甲乙間の法律関係であって、当該委託により成立する委託清算約定と同一の経済的効果を有するものをいう。

(2) 当社は、前項の入札決済日の午後2時45分以降遅滞なく、入札決済金額に相当する金銭を当該入札決済に係る清算約定の買い手である清算参加者に支払う。

(事務の委任)

第58条 業務方法書第118条第1項に規定する当社が定める事務は、清算値段の算出に係る事務とする。

2 (略)

様式第3号 清算受託契約の様式

CDS 清算受託契約書

(定義)

第2条 本契約において使用する用語は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）及び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) 「委託清算約定」とは、乙の有価証券等清算取次ぎの委託に基づき、甲とクリアリング機構の間に成立する清算約定をいう。

(2) (略)

(3) 「期限前終了金額」とは、第34条の規定によりすべての委託清算約定が終了した場合に甲乙間で授受すべき金銭をいう。

(4)～(7) (略)

(新設)

(固定金額の授受)
第8条 乙は、甲が委託清算約定について固定金額をクリアリング機構に交付すべき場合には、当該固定金額に相当する金銭を、クリアリング機構への交付時限(乙が非居住者である場合は、翌々JSCC営業日における当該時限)までの甲が定める時限までに、甲が定める方法により甲に交付する。

2 (略)

(清算取次口座)
第9条 甲は、本清算委託取引の内容、本清算委託取引に係る当初証拠金、委託当初証拠金、変動証拠金、委託清算約定のクレジットイベント決済時に授受する金銭等その他本契約並びに業務方法書等に基づいて乙との間で授受される金銭等を管理するための口座(以下「本清算取次口座」という。)を開設する。

2 甲は、乙の請求があった場合には、乙のために開設した本清算取次口座を複数に区分する口座を開設することができる。

(当初証拠金の預託義務)

第11条 (略)

2 委託清算約定に係る当初証拠金所要額は、業務方法書等の定めるところにより、クリアリング機構が算出するものとし、甲は当該所要額を乙に対して通知するものとする。

3 (略)

(当初証拠金の預託方法等)

第12条 (略)

(固定金額の授受)
第8条 乙は、甲が委託清算約定について固定金額をクリアリング機構に交付すべき場合には、当該固定金額に相当する金銭を、クリアリング機構への交付時限までの甲が定める時限までに、甲が定める方法により甲に交付する。

2 (略)

(清算取次口座)
第9条 甲は、清算委託取引の内容、清算委託取引に係る当初証拠金、委託当初証拠金、変動証拠金、委託清算約定のクレジットイベント決済時に授受する金銭等その他本契約並びに業務方法書等に基づいて乙との間で授受される金銭等を管理するための口座(以下「清算取次口座」という。)を開設する。

2 甲は、乙の請求があった場合には、乙のために開設した清算取次口座を複数に区分する口座を開設することができる。

(当初証拠金の預託義務)

第11条 (略)

2 委託清算約定に係る当初証拠金所要額は、業務方法書等の定めるところにより、クリアリング機構が算出するものとする。

3 (略)

(当初証拠金の預託方法等)

第12条 (略)

2 (略)

3 乙は、各 J S C C 営業日において、委託清算約定に係る当初証拠金 (以下単に「当初証拠金」という。)としてクリアリング機構に預託した金銭及び代用有価証券の額並びに本清算委託取引に係る委託当初証拠金 (以下単に「委託当初証拠金」という。)として甲に預託した金銭及び代用有価証券の額の合計額 (以下「当初証拠金等預託額」という。)が預託必要額に不足する場合には、その不足が生じた日の翌 J S C C 営業日 (乙が非居住者である場合は、当該不足額が発生した日の翌々 J S C C 営業日) のクリアリング機構への預託時限までの甲が指定する日時までに、その不足額を甲に交付するものとする。

4 (略)

(差換預託)

第 1 3 条 前 2 条の規定にかかわらず、甲は、あらかじめ乙の書面による同意を得て、乙から交付を受けた金銭又は代用有価証券を委託当初証拠金として保管することができる。

2・3 (略)

(当初証拠金の返還請求権)

第 1 4 条 クリアリング機構に対する当初証拠金の返還請求権は、次の各号に掲げる者が、当該各号に定める金額に相当する部分について有するものとする。

(1) 乙

乙がクリアリング機構に預託した当初証拠金の額及び甲が委託清算約定に関してクリアリング機構に預託した差換当初証拠金の合計額 (以下「当初証拠金預託総計額」という。)から甲が委託清算約定に関してクリアリング機構に対して負担する未履行債務 (甲の破綻

2 (略)

3 乙は、各 J S C C 営業日において、当初証拠金としてクリアリング機構に預託した金銭及び代用有価証券の額並びに委託当初証拠金として甲に預託した金銭及び代用有価証券の額の合計額が預託必要額に不足する場合には、その不足が生じた日の翌 J S C C 営業日 (乙が非居住者である場合は、当該不足額が発生した日から起算して 3 J S C C 営業日目) までの甲が指定する日時までに、その不足額を甲に交付するものとする。

4 (略)

(差換預託)

第 1 3 条 前 2 条の規定にかかわらず、甲は、あらかじめ乙の書面による同意を得て、乙から交付を受けた金銭又は有価証券を委託当初証拠金として保管することができる。

2・3 (略)

(当初証拠金の返還請求権)

第 1 4 条 クリアリング機構に対する当初証拠金に関する返還請求権は、次の各号に掲げる者が、当該各号に定める金額に相当する部分について有するものとする。

(1) 乙

乙がクリアリング機構に預託した当初証拠金の額及び甲がクリアリング機構に預託した差換当初証拠金の額のうち乙が甲に預託した委託当初証拠金の額を限度として業務方法書等で定める額の合計額から、乙が清算委託取引に関して甲に対して負担する未履行債務

等その他の事由による当該委託清算約定の処理に伴って生じる債務のうち未履行であるものを含む。以下本項において同じ。）の額を控除した額の範囲内で、乙がクリアリング機構に預託した当初証拠金の額及び甲が委託清算約定に関してクリアリング機構に預託した差換当初証拠金の額のうち乙が甲に預託した委託当初証拠金の額の合計額から、乙が本清算委託取引に関して甲に対して負担する未履行債務（当該本清算委託取引の終了に伴って生じる債務のうち未履行であるものを含む。）の額又は未払いの期限前終了金額を控除した額

(2) 甲

当初証拠金預託総計額から、甲が委託清算約定に関してクリアリング機構に対して負担する未履行債務の額及び第1号の額の合計額を控除した額

2～6 (略)

(変動証拠金)

第17条 (略)

2 委託清算約定に係る変動証拠金所要額は、業務方法書等の定めるところにより、クリアリング機構が算出するものとし、甲は当該所要額を乙に対して通知するものとする。

(変動証拠金の授受)

第18条 乙は、甲が委託清算約定に係る変動証拠金をクリアリング機構に交付すべき場合には、当該変動証拠金に相当する金銭を、当該変動証拠金の算出日の翌J S C C営業日（乙が非

(当該清算委託取引の終了に伴って生じる債務のうち未履行であるものを含む。)の額又は未払いの期限前終了金額を控除した額

(2) 甲

乙がクリアリング機構に預託した当初証拠金の額及び甲がクリアリング機構に預託した差換当初証拠金の額の合計額から、甲が委託清算約定に関してクリアリング機構に対して負担する未履行債務（甲の破綻等その他の事由による委託清算約定の処理に伴って生じる債務のうち未履行であるものを含む。）の額及び第1号の額の合計額を控除した額

2～6 (略)

(変動証拠金)

第17条 (略)

(新設)

(変動証拠金の授受)

第18条 乙は、甲が委託清算約定に係る変動証拠金をクリアリング機構に交付すべき場合には、当該変動証拠金に相当する金銭を、当該変動証拠金の算出日の翌J S C C営業日（乙が非

<p>居住者である場合は、<u>翌々 J S C C 営業日</u>) のクリアリング機構への交付時限までの甲が定める時限までに、甲が定める方法により甲に交付する。</p> <p>2 (略)</p>	<p>居住者である場合は、<u>変動証拠金算出日から起算して 3 J S C C 営業日目</u>) のクリアリング機構への交付時限までの甲が定める時限までに、甲が定める方法により甲に交付する。</p> <p>2 (略)</p>
<p>(変動証拠金に係る利息の授受)</p> <p>第 19 条 (略)</p> <p>2 乙は、甲が変動証拠金に係る利息をクリアリング機構に交付すべき場合には、当該利息に相当する金銭を、クリアリング機構への交付時限までの甲が定める時限<u>(乙が非居住者である場合は、翌々 J S C C 営業日における当該時限)</u>までに、甲が定める方法により甲に交付する。</p>	<p>(変動証拠金に係る利息の授受)</p> <p>第 19 条 (略)</p> <p>2 乙は、甲が変動証拠金に係る利息をクリアリング機構に交付すべき場合には、当該利息に相当する金銭を、クリアリング機構への交付時限までの甲が定める時限までに、甲が定める方法により甲に交付する。</p>
<p>3 (略)</p> <p>(変動証拠金の返還請求権)</p> <p>第 20 条 甲及び乙は、本契約及び業務方法書等の定めるところにより授受及び返還を行う場合を除くほか、相手方に対し、<u>本清算委託取引に係る変動証拠金の返還を請求することができない。</u></p>	<p>3 (略)</p> <p>(変動証拠金の返還請求権)</p> <p>第 20 条 甲及び乙は、本契約及び業務方法書等の定めるところにより授受及び返還を行う場合を除くほか、相手方に対し、<u>変動証拠金の返還を請求することができない。</u></p>
<p>(期限の利益喪失事由が発生している場合等の証拠金の返還請求権の取扱い)</p> <p>第 23 条 乙は、次に掲げる場合には、すべての<u>本清算委託取引の決済が完了するまでの間、クリアリング機構及び甲に対し、本契約に基づいて預託又は交付した証拠金</u><u>(以下単に「証拠金」という。)</u>の返還請求権を行使することができない。</p> <p>(1) (略)</p> <p>(2) 第 34 条の規定によりすべての<u>本清算委託取引が終了した場合</u></p>	<p>(期限の利益喪失事由が発生している場合等の証拠金の返還請求権の取扱い)</p> <p>第 23 条 乙は、次に掲げる場合には、すべての<u>清算委託取引の決済が完了するまでの間、クリアリング機構及び甲に対し、証拠金の返還請求権を行使することができない。</u></p> <p>(1) (略)</p> <p>(2) 第 34 条の規定によりすべての<u>清算委託取引が終了した場合</u></p>
<p>2・3 (略)</p>	<p>2・3 (略)</p>

<p>(決済金額等に相当する金銭の決済の方法)</p>	
<p>第23条の2 甲及び乙は、決済金額等に相当する金銭の総受取額と総支払額を差引計算して授受することができる。</p>	<p>(新設)</p>
<p>(当初証拠金及び決済金額等の差引計算)</p>	
<p>第23条の3 前条の規定により差引計算した結果、乙が甲に対し決済金額等に相当する金銭を支払うこととなる場合には、当該金銭の支払い及び第11条に規定する当初証拠金の預託については、次に掲げる計算式の順序に従って差引計算するものとし、それぞれ算出された額が負の数になる場合には、乙は甲に対し当該額を預託するものとする。ただし、第1号に係る預託については、金銭により預託しなければならない。</p> <p>(1) (前JSCC営業日末時点における当初証拠金等預託額のうち金銭による預託額) - (同時点において乙が甲に支払うこととなる決済金額等に相当する金銭の額)</p> <p>(2) (前JSCC営業日末時点における当初証拠金等預託額 - 充当金銭預託額 (前号による差引計算の結果、乙が甲に支払うこととなる決済金額等に相当する金銭に充当された当初証拠金等預託額のうち金銭による預託額をいう。)) - (同時点における当初証拠金預託必要額)</p>	<p>(新設)</p>
<p>2 前条の規定により差引計算した結果、乙が甲から決済金額等に相当する金銭を受領することとなる場合には、当該金銭の支払い及び第11条に規定する当初証拠金の預託については、次に掲げる計算式に従って差引計算するものとし、算出された額が負の数になる場合には、乙は甲に対し当該額を預託するものとする。</p> <p>(前JSCC営業日末時点における当初証拠金等預託額 + 同時点において乙が甲から受領す</p>	

<p><u>ることとなる決済金額等に相当する金銭の額) - (前JSCC営業日末時点における当初証拠金預託必要額)</u></p> <p><u>(返戻の申請及び当初証拠金のみなし預託)</u></p>	
<p><u>第23条の4 前条の差引計算の結果、乙が決済金額等に相当する金銭を受領することとなる場合には、甲に対し、受領する金銭の額を明らかにしたうえで申請を行うことにより、当該金銭を受領するものとする。</u></p> <p><u>2 前項の申請がなされなかった場合、乙が受領することとなる決済金額等に相当する金銭は、当初証拠金として預託されたものとみなす。</u></p>	<p>(新設)</p>
<p>(委託清算約定の終了に伴う本清算委託取引の決済)</p> <p>第25条 甲及び乙は、前条の規定による任意解約により委託清算約定が終了した場合には、当該委託清算約定に係る本清算委託取引の決済を行う。</p> <p>2・3 (略)</p>	<p>(委託清算約定の終了に伴う清算委託取引の決済)</p> <p>第25条 甲及び乙は、前条の規定による任意解約により委託清算約定が終了した場合には、当該委託清算約定に係る清算委託取引の決済を行う。</p> <p>2・3 (略)</p>
<p>(本清算委託取引の他の清算委託者への移管)</p> <p>第26条 乙は、業務方法書等の定めに従い、本清算委託取引を他の清算委託者(以下「移管先清算委託者」という。)に移管(本清算委託取引を業務方法書の定めるところにより将来に向かって消滅させると同時に、移管先清算委託者及び甲の間に当該本清算委託取引と同一内容の新たな法律関係を成立させることをいう。以下同じ。)することができる。</p> <p>2 (略)</p>	<p>(清算委託取引の他の清算委託者への移管)</p> <p>第26条 乙は、業務方法書等の定めに従い、清算委託取引を他の清算委託者(以下「移管先清算委託者」という。)に移管(清算委託取引を業務方法書の定めるところにより将来に向かって消滅させると同時に、移管先清算委託者及び甲の間に清算委託取引と同一内容の新たな法律関係を成立させることをいう。以下同じ。)することができる。</p> <p>2 (略)</p>
<p>(業務方法書等の参照)</p> <p>第32条 前3条に規定するほか、委託清算約定(CDS清算業務に関する業務方法書の取扱い</p>	<p>(業務方法書等の参照)</p> <p>第32条 前3条に規定するほか、委託清算約定(CDS清算業務に関する業務方法書の取扱い</p>

別表3の規定により成立したものをみなされる決済目的参加者取引等を含む。)に係るクレジットイベント決済並びにクレジットイベント決済に伴う当該委託清算約定及びその本清算委託取引の処理については、業務方法書等の規定及び当該委託清算約定の内容に従う。

(期限の利益喪失事由が発生した場合における本清算委託取引の終了)

第34条 甲は、乙について期限の利益喪失事由が発生し、継続している場合には、本清算委託取引の期限前終了日(本条の定めるところによりすべての本清算委託取引が委託清算約定の予定終了日の到来又はクレジットイベント決済によらずに終了する日をいう。以下同じ。)を指定することができる。期限前終了日の指定は、該当する期限の利益喪失事由を記載した20日以内の事前通知を乙に送付することにより、その効力を生じるものとする。ただし、甲乙間において、期限の利益喪失事由の全部又は一部について、あらかじめ一定の日を期限前終了日として指定する旨の別段の合意がある場合には、当該合意に従う。

2 期限前終了日時点におけるすべての本清算委託取引は、甲又は乙から別段の意思表示を要することなく、期限前終了日において当然に終了する。

3 前2項の規定にかかわらず、乙について前条第1項第3号dに掲げる期限の利益喪失事由が発生した場合、すべての本清算委託取引は、甲又は乙から別段の意思表示を要することなく、当該期限の利益喪失事由が発生する直前において当然に終了するものとし、その終了の日を期限前終了日とする。

4 甲又は乙は、前2項の規定により本清算委託取引が終了する場合には、あらかじめ、又はその

別表3の規定により成立したものをみなされる決済目的参加者取引等を含む。)に係るクレジットイベント決済並びにクレジットイベント決済に伴う当該委託清算約定及びその清算委託取引の処理については、業務方法書等の規定及び当該委託清算約定の内容に従う。

(期限の利益喪失事由が発生した場合における清算委託取引の終了)

第34条 甲は、乙について期限の利益喪失事由が発生し、継続している場合には、清算委託取引の期限前終了日(本条の定めるところによりすべての清算委託取引が委託清算約定の予定終了日の到来又はクレジットイベント決済によらずに終了する日をいう。以下同じ。)を指定することができる。期限前終了日の指定は、該当する期限の利益喪失事由を記載した20日以内の事前通知を乙に送付することにより、その効力を生じるものとする。ただし、甲乙間において、期限の利益喪失事由の全部又は一部について、あらかじめ一定の日を期限前終了日として指定する旨の別段の合意がある場合には、当該合意に従う。

2 期限前終了日時点におけるすべての清算委託取引は、甲又は乙から別段の意思表示を要することなく、期限前終了日において当然に終了する。

3 前2項の規定にかかわらず、乙について前条第1項第3号dに掲げる期限の利益喪失事由が発生した場合、すべての清算委託取引は、甲又は乙から別段の意思表示を要することなく、当該期限の利益喪失事由が発生する直前において当然に終了するものとし、その終了の日を期限前終了日とする。

4 甲又は乙は、前2項の規定により清算委託取引が終了する場合には、あらかじめ、又はその

の終了後遅滞なく、クリアリング機構に対し届出を行うものとする。

5 第2項又は第3項の規定によりすべての本清算委託取引が終了した場合、当該各本清算委託取引に係る委託清算約定は、甲の自己の計算による清算約定としてクリアリング機構との間で存続するものとする。

6 第2項又は第3項の規定によりすべての本清算委託取引が終了した場合、甲及び乙は、当該各本清算委託取引に係る委託清算約定の期限前終了日における清算値段に基づく期限前終了金額を授受するものとする。この場合において、当該各本清算委託取引に係る期限前終了金額は、当該各本清算委託取引に係る委託清算約定について期限前終了日の翌J S C C営業日までに甲からクリアリング機構に預託すべき変動証拠金の差引累計額（変動証拠金の総支払額から総受取額を控除した額をいう。以下同じ。）に相当する額とし、差引累計額が正数の場合には乙から甲に期限前終了金額を支払い、差引累計額が負数の場合には甲から乙に期限前終了金額を支払う。

7 甲及び乙が前条第3項の規定により同条第1項第3号dに掲げる事由を変更する旨の合意をした場合、第3項の規定は次のとおり読み替えられるものとする。

「前2項の規定にかかわらず、甲は、乙について前条第1項第3号dに掲げる期限の利益喪失事由が発生し、継続している場合には、当該事由の発生日から20日間（以下本項において「期限前終了日指定期間」という。）に限り、本清算委託取引の期限前終了日を指定することができる。この場合の期限前終了日の指定方法及びその効力は前2項の規定に従う。甲が期限前終了日指定期間内に期限前終了日の指定を行わなかった場合、すべての本清算委託取引は、甲又

終了後遅滞なく、クリアリング機構に対し届出を行うものとする。

5 第2項又は第3項の規定によりすべての清算委託取引が終了した場合、当該各清算委託取引に係る委託清算約定は、甲の自己の計算による清算約定としてクリアリング機構との間で存続するものとする。

6 第2項又は第3項の規定によりすべての清算委託取引が終了した場合、甲及び乙は、当該各清算委託取引に係る委託清算約定の期限前終了日における清算値段に基づく期限前終了金額を授受するものとする。この場合において、当該各清算委託取引に係る期限前終了金額は、当該各清算委託取引に係る委託清算約定について期限前終了日の翌J S C C営業日までに甲からクリアリング機構に預託すべき変動証拠金の差引累計額（変動証拠金の総支払額から総受取額を控除した額をいう。以下同じ。）に相当する額とし、差引累計額が正数の場合には乙から甲に期限前終了金額を支払い、差引累計額が負数の場合には甲から乙に期限前終了金額を支払う。

7 甲及び乙が前条第3項の規定により同条第1項第3号dに掲げる事由を変更する旨の合意をした場合、第3項の規定は次のとおり読み替えられるものとする。

「前2項の規定にかかわらず、甲は、乙について前条第1項第3号dに掲げる期限の利益喪失事由が発生し、継続している場合には、当該事由の発生日から20日間（以下本項において「期限前終了日指定期間」という。）に限り、清算委託取引の期限前終了日を指定することができる。この場合の期限前終了日の指定方法及びその効力は前2項の規定に従う。甲が期限前終了日指定期間内に期限前終了日の指定を行わなかった場合、すべての清算委託取引は、甲又は乙

は乙から別段の意思表示を要することなく、当該期限前終了日指定期間の満了時において当然に終了する。」

(本清算委託取引終了時における委託当初証拠金等の返還)

第35条 前条第2項又は第3項の規定によりすべての本清算委託取引が終了した場合、甲は、乙から預託を受けた委託当初証拠金を直ちに乙に返還するものとする。ただし、次条の規定により当該委託当初証拠金に係る債権債務が清算される場合を除き、乙は、第23条第1項の規定に基づき、すべての本清算委託取引の決済が完了するまでの間、甲に対し、当該委託当初証拠金の返還を請求することができない。

2 (略)

3 前条第2項又は第3項の規定によりすべての本清算委託取引が終了した場合、甲及び乙は、本契約に基づき相手方から預託を受けた変動証拠金を直ちに相手方に返還するものとする。ただし、次条の規定により当該変動証拠金に係る債権債務が清算される場合を除き、乙は、第23条第1項の規定に基づき、すべての本清算委託取引の決済が完了するまでの間、甲に対し、当該変動証拠金の返還を請求することができない。

(本清算委託取引終了時における債権債務の一括清算)

第36条 第34条第2項又は第3項の規定によりすべての本清算委託取引が終了した場合、期限前終了日において甲乙間に存在するすべての本契約に基づく金銭債務(第34条第6項の規定による本清算委託取引の終了に伴う期限前終了金額の支払債務、前条の規定による委託当初証拠金及び変動証拠金の返還債務、未払いの固

から別段の意思表示を要することなく、当該期限前終了日指定期間の満了時において当然に終了する。」

(清算委託取引終了時における委託当初証拠金等の返還)

第35条 前条第2項又は第3項の規定によりすべての清算委託取引が終了した場合、甲は、乙から預託を受けた委託当初証拠金を直ちに乙に返還するものとする。ただし、次条の規定により当該委託当初証拠金に係る債権債務が清算される場合を除き、乙は、第23条第1項の規定に基づき、すべての清算委託取引の決済が完了するまでの間、甲に対し、当該委託当初証拠金の返還を請求することができない。

2 (略)

3 前条第2項又は第3項の規定によりすべての清算委託取引が終了した場合、甲及び乙は、相手方から預託を受けた変動証拠金を直ちに相手方に返還するものとする。ただし、次条の規定により当該変動証拠金に係る債権債務が清算される場合を除き、乙は、第23条第1項の規定に基づき、すべての清算委託取引の決済が完了するまでの間、甲に対し、当該変動証拠金の返還を請求することができない。

(清算委託取引終了時における債権債務の一括清算)

第36条 第34条第2項又は第3項の規定によりすべての清算委託取引が終了した場合、期限前終了日において甲乙間に存在するすべての本契約に基づく金銭債務(第34条第6項の規定による清算委託取引の終了に伴う期限前終了金額の支払債務、前条の規定による委託当初証拠金及び変動証拠金の返還債務、未払いの固定金

定金額の支払債務その他甲乙間の一切の金銭債務を含む。)は、次に定めるところにより清算されるものとする。

(1) 第34条第2項又は第3項の規定により終了したすべての本清算委託取引について甲から乙に支払うべき期限前終了金額の総額、甲から乙に返還すべき変動証拠金の総額その他期限前終了日において存在する甲の乙に対する金銭債務(前条の規定による委託当初証拠金の返還債務を除き、以下「期限前終了日甲負担債務」という。)と、当該本清算委託取引について乙から甲に支払うべき期限前終了金額の総額、乙から甲に返還すべき変動証拠金の総額その他期限前終了日において存在する乙の甲に対する金銭債務(以下「期限前終了日乙負担債務」という。)とを差引計算する。

(2) ~ (5) (略)

(未決済約定の承継)

第38条 乙は、前条の規定により委託清算約定が終了した場合には、業務方法書等の定める期間内に限り、業務方法書等の定めに従い、承継清算参加者(本項に規定する承継清算参加者をいう。)を経由してクリアリング機構にクリアリング機構所定の承継申込書を交付することにより、次に掲げる権利義務(以下総称して「未決済約定」という。)を一括して他の清算参加者(以下「承継清算参加者」という。)に承継(業務方法書等の定めるところにより、クリアリング機構、承継清算参加者及び乙の間で未決済約定を新たに発生させるとともに、それに伴う金銭の授受及び権利義務の処理を行うことをいう。以下本節において同じ。)させることができる。

(1) (略)

額の支払債務その他甲乙間の一切の金銭債務を含む。)は、次に定めるところにより清算されるものとする。

(1) 第34条第2項又は第3項の規定により終了したすべての清算委託取引について甲から乙に支払うべき期限前終了金額の総額、甲から乙に返還すべき変動証拠金の総額その他期限前終了日において存在する甲の乙に対する金銭債務(前条の規定による委託当初証拠金の返還債務を除き、以下「期限前終了日甲負担債務」という。)と、当該清算委託取引について乙から甲に支払うべき期限前終了金額の総額、乙から甲に返還すべき変動証拠金の総額その他期限前終了日において存在する乙の甲に対する金銭債務(以下「期限前終了日乙負担債務」という。)とを差引計算する。

(2) ~ (5) (略)

(未決済約定の承継)

第38条 乙は、前条第1項の規定により委託清算約定が終了した場合には、業務方法書等の定める期間内に限り、業務方法書等の定めに従い、承継清算参加者(本項に規定する承継清算参加者をいう。)を経由してクリアリング機構にクリアリング機構所定の承継申込書を交付することにより、次に掲げる権利義務(以下総称して「未決済約定」という。)を一括して他の清算参加者(以下「承継清算参加者」という。)に承継(業務方法書等の定めるところにより、クリアリング機構、承継清算参加者及び乙の間で未決済約定を新たに発生させるとともに、それに伴う金銭の授受及び権利義務の処理を行うことをいう。以下本節において同じ。)させることができる。

(1) (略)

(2) 甲及び乙の間の本清算委託取引に係る権利義務（前条の規定により委託清算約定が終了する直前のもの）と業務方法書等の定める条件が同一となる権利義務

2・3 (略)

4 承継清算参加者が未決済約定を承継した場合、甲乙の間の本清算委託取引及び当該本清算委託取引について授受された変動証拠金に係る権利義務（甲の破綻等が認定された時点で弁済期が到来している甲の債務を除く。）及び委託当初証拠金に係る権利義務（第2項の規定により承継清算参加者を代理人としてクリアリング機構に預託されたものとみなされる部分に限る。）は、業務方法書等の定めるところにより、将来に向かって消滅する。

（未決済約定の承継が行われなかった場合の本清算委託取引の一括清算等）

第39条 (略)

2 第37条の規定により委託清算約定が終了した場合において、前条の規定による未決済約定の承継が行われなかったときは、甲及び乙は、本契約に基づき相手方から預託を受けた変動証拠金を直ちに相手方に返還するものとする。ただし、第5項の規定により当該変動証拠金に係る債権債務が清算される場合を除き、甲及び乙は、第23条第2項及び第3項の規定に基づき、すべての委託清算約定の決済が完了するまでの間、相手方に対し、当該変動証拠金の返還請求権を行使することができない。

3・4 (略)

5 第37条の規定により委託清算約定が終了した場合において、前条の規定による未決済約定の承継が行われなかったときは、当初損失確定日において甲乙間に存在するすべての本契約に基づく金銭債務（第1項の期限前終了手数料に

(2) 甲及び乙の間の清算委託取引に係る権利義務（前条の規定により委託清算約定が終了する直前のもの）と業務方法書等の定める条件が同一となる権利義務

2・3 (略)

4 承継清算参加者が未決済約定を承継した場合、甲乙の間の清算委託取引及び当該清算委託取引について授受された変動証拠金に係る権利義務（甲の破綻等が認定された時点で弁済期が到来している甲の債務を除く。）及び委託当初証拠金に係る権利義務（第2項の規定により承継清算参加者を代理人としてクリアリング機構に預託されたものとみなされる部分に限る。）は、業務方法書等の定めるところにより、将来に向かって消滅する。

（未決済約定の承継が行われなかった場合の清算委託取引の一括清算等）

第39条 (略)

2 第37条の規定により委託清算約定が終了した場合において、前条の規定による未決済約定の承継が行われなかったときは、甲及び乙は、相手方から預託を受けた変動証拠金を直ちに相手方に返還するものとする。ただし、第5項の規定により当該変動証拠金に係る債権債務が清算される場合を除き、甲及び乙は、第23条第2項及び第3項の規定に基づき、すべての委託清算約定の決済が完了するまでの間、相手方に対し、当該変動証拠金の返還請求権を行使することができない。

3・4 (略)

5 第37条の規定により委託清算約定が終了した場合において、前条の規定による未決済約定の承継が行われなかったときは、当初損失確定日において甲乙間に存在するすべての本契約に基づく金銭債務（第1項の期限前終了手数料に

相当する額（以下「期限前終了手数料相当額」という。）の支払債務、第2項の規定による変動証拠金の返還債務、前2項の規定による委託当初証拠金の返還債務、未払いの固定金額の支払債務その他甲乙間の一切の金銭債務を含む。以下「当初損失確定日現存債務」という。）は、次に定めるところにより清算されるものとする。

(1)～(3) (略)

(4) 前号の規定による差引計算の結果、当初損失確定日乙負担債務がある場合には、その金額をもってすべての本清算委託取引の終了に伴う乙の甲に対する債務（以下本条において「乙最終債務」という。）とし、乙最終債務に係る債権を甲の乙に対する債権とする。

(5) 第1号の規定による差引計算の結果、当初損失確定日甲負担債務がある場合には、その金額及び前2項の規定による委託当初証拠金の返還債務の合計額をもってすべての本清算委託取引の終了に伴う甲の乙に対する債務（以下本条において「甲最終債務」という。）とし、甲最終債務に係る債権を乙の甲に対する債権とする。

6・7 (略)

(損失回避取引)

第41条 (略)

2 前項の規定によりクリアリング機構及び甲の間で損失回避取引が成立した場合、当該損失回避取引は乙の甲に対する有価証券等清算取次ぎの委託により成立した委託清算約定と、当該損失回避取引に係る甲と乙の間の法律関係は本項の規定により委託清算約定とみなされる当該損失回避取引に係る本清算委託取引と、それぞれみなして本契約の規定を適用する。

相当する額（以下「期限前終了手数料相当額」という。）の支払債務、第2項の規定による変動証拠金の返還債務、前2項の規定による委託当初証拠金の返還債務、未払いの固定金額の支払債務その他甲乙間の一切の金銭債務を含む。以下「当初損失確定日現存債務」という。）は、次に定めるところにより清算されるものとする。

(1)～(3) (略)

(4) 前号の規定による差引計算の結果、当初損失確定日乙負担債務がある場合には、その金額をもってすべての清算委託取引の終了に伴う乙の甲に対する債務（以下本条において「乙最終債務」という。）とし、乙最終債務に係る債権を甲の乙に対する債権とする。

(5) 第1号の規定による差引計算の結果、当初損失確定日甲負担債務がある場合には、その金額及び前2項の規定による委託当初証拠金の返還債務の合計額をもってすべての清算委託取引の終了に伴う甲の乙に対する債務（以下本条において「甲最終債務」という。）とし、甲最終債務に係る債権を乙の甲に対する債権とする。

6・7 (略)

(損失回避取引)

第41条 (略)

2 前項の規定によりクリアリング機構及び甲の間で損失回避取引が成立した場合、当該損失回避取引は乙の甲に対する有価証券等清算取次ぎの委託により成立した委託清算約定と、当該損失回避取引に係る甲と乙の間の法律関係は本項の規定により委託清算約定とみなされる当該損失回避取引に係る清算委託取引と、それぞれみなして本契約の規定を適用する。

(本契約の強制解約等)

第44条 (略)

2～4 (略)

5 第1項の規定により本契約が終了した場合において、その終了時点で本清算委託取引の清算が完了していない場合には、当該本清算委託取引及びその清算に関しては、引き続き本契約を適用する。

(報告)

第45条 乙は、甲が請求したときは、本清算委託取引に関して必要な事項を甲に対して遅滞なく報告しなければならない。

2 (略)

(定めのない事項)

第54条 本清算委託取引に関し、本契約に定めのない事項については、前条の甲乙間の覚書その他の合意書の定めによるほか、業務方法書等に従うものとする。

(裁判管轄)

第57条 本契約又は本清算委託取引に関する訴訟については、甲の本店又は〇〇支店の所在地を管轄する裁判所を合意管轄裁判所とする。

2 前項の規定にかかわらず、甲及び乙は、本契約又は本清算委託取引に関する紛争に関し、専属的合意管轄の合意又は仲裁合意をすることができる。

(注1) 第43条第2項中「〇JSCC営業日」の部分については、甲と乙の合意により、任意の数を定めることができる。

(注2) 第47条(同条第2項第4号を除く。)
については、甲と乙の合意により任意の内容に

(本契約の強制解約等)

第44条 (略)

2～4 (略)

5 第1項の規定により本契約が終了した場合において、その終了時点で清算委託取引の清算が完了していない場合には、当該清算委託取引及びその清算に関しては、引き続き本契約を適用する。

(報告)

第45条 乙は、甲が請求したときは、清算委託取引に関して必要な事項を甲に対して遅滞なく報告しなければならない。

2 (略)

(定めのない事項)

第54条 清算委託取引に関し、本契約に定めのない事項については、前条の甲乙間の覚書その他の合意書の定めによるほか、業務方法書等に従うものとする。

(裁判管轄)

第57条 本契約又は清算委託取引に関する訴訟については、甲の本店又は〇〇支店の所在地を管轄する裁判所を合意管轄裁判所とする。

2 前項の規定にかかわらず、甲及び乙は、本契約又は清算委託取引に関する紛争に関し、専属的合意管轄の合意又は仲裁合意をすることができる。

(注1) 第43条第2項中「〇JSCC営業日」の部分については、甲と乙の合意により、任意の数を定めることができる。

(新設)

変更することができる。

(注3) 第57条第1項中「〇〇支店」の部分については、これを削除し、又は甲と乙の合意により任意の支店名を定めることができる。また、同条については、甲と乙の合意により、第1項及び第2項を任意の内容に変更することができる。

(注4) 本則の規定中「甲乙間の合意」又は「甲乙間に別段の合意がある場合」との文言のある箇所については、第53条の規定により別途覚書を締結する方法のほか、本契約への規定又は別紙を参照する等の方法により本契約中に当該合意の内容を定めることができる。

付 則

この改正規定は、平成26年2月24日から施行する。

(注2) 第57条第1項中「〇〇支店」の部分については、これを削除し、又は甲と乙の合意により任意の支店名を定めることができる。また、同条については、甲と乙の合意により、第1項及び第2項を任意の内容に変更することができる。

(注3) 本則の規定中「甲乙間の合意」又は「甲乙間に別段の合意がある場合」との文言のある箇所については、第53条の規定により別途覚書を締結する方法のほか、本契約への規定又は別紙を参照する等の方法により本契約中に当該合意の内容を定めることができる。

CDS 清算基金所要額に関する規則の一部改正新旧対照表

新	旧
<p>別表 CDS 清算基金所要額の算出に関する表</p> <p>各清算参加者に係るCDS 清算基金所要額は、CDS 清算基金算出日（債務負担処理期間（CDS 清算業務に関する業務方法書の取扱い第35条第2項に規定する債務負担処理期間をいう。以下同じ。）における第3当社営業日（当社が通知により別に定める場合を除く。）をいう。以下同じ。）において、次のaに定めるCDS 清算基金基礎基準額とbに定めるストレス時想定損失負担額のうちいずれか大きい額（これらの額がいずれも1億円を下回る場合には1億円）とし、当該額を当該CDS 清算基金算出日からその直後の清算基金算出日の前日まで適用する。</p> <p>a （略）</p> <p>b ストレス時想定損失負担額は、対応するCDS 清算基金算出日の1か月前の応当日（応当日が存在しない場合又は休業日に当たる場合には、その直前の当社営業日）から当該CDS 清算基金算出日までの期間に属する各当社営業日における担保超過リスク額が上位である清算参加者2社（当該清算参加者を含む企業集団に含まれる他の清算参加者を含む。）の担保超過リスク額の合計額の平均額を、当該CDS 清算基金算出日における当該各清算参加者の当初証拠金所要額（業務方法書第29条の規定により当初証拠金所要額の引上げ措置を受けている清算参加者については、当該引上げ措置を行う前の当初証拠金所要額）に応じて按分した額とする。なお、このbにおいて「担保超過リスク額」とは、当該各清</p>	<p>別表 CDS 清算基金所要額の算出に関する表</p> <p>各清算参加者に係るCDS 清算基金所要額は、CDS 清算基金算出日（債務負担処理期間（CDS 清算業務に関する業務方法書の取扱い第35条第2項に規定する債務負担処理期間をいう。以下同じ。）における第3当社営業日（当社が通知により別に定める場合を除く。）をいう。以下同じ。）において、次のaに定めるCDS 清算基金基礎基準額とbに定めるストレス時想定損失負担額のうちいずれか大きい額（これらの額がいずれも1億円を下回る場合には1億円）とし、当該額を当該CDS 清算基金算出日からその直後の清算基金算出日の前日まで適用する。</p> <p>a （略）</p> <p>b ストレス時想定損失負担額は、対応するCDS 清算基金算出日の1か月前の応当日（応当日が存在しない場合又は休業日に当たる場合には、その直前の当社営業日）から当該CDS 清算基金算出日までの期間に属する各当社営業日における担保超過リスク額が上位である清算参加者2社（当該清算参加者を含む企業集団に含まれる他の清算参加者を含む。）の担保超過リスク額の合計額の平均額を、当該CDS 清算基金算出日における当該各清算参加者の当初証拠金所要額（業務方法書第29条の規定により当初証拠金所要額の引上げ措置を受けている清算参加者については、当該引上げ措置を行う前の当初証拠金所要額）に応じて按分した額とする。なお、このbにおいて「担保超過リスク額」とは、当該各清</p>

算参加者の当該期間に属する各当社営業日における自己取引口座及び各委託取引口座（当社が業務方法書第59条第6項の規定により区分口座を設定している場合には、区分口座）ごとの清算約定に係るストレス時リスク相当額（CDS取引に係る価格の極端な変動により、当該清算約定から当該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。）から当該清算参加者の当該当社営業日の当該自己取引口座及び各委託取引口座に係る当初証拠金所要額を差し引いた額（当該額が負数となる場合は、0とする。）を、すべての当該自己取引口座及び各委託取引口座について合算した額をいう。

付 則

この改正規定は、平成26年2月24日から施行する。

算参加者の当該期間に属する各当社営業日における清算参加者口座（当社が業務方法書第59条第4項の規定により区分口座を設定している場合には、区分口座）ごとの清算約定に係るストレス時リスク相当額（CDS取引に係る価格の極端な変動により、当該清算約定から当該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。）から当該清算参加者の当該当社営業日の当該清算参加者口座に係る当初証拠金所要額を差し引いた額（当該額が負数となる場合は、0とする。）を、すべての当該清算参加者口座について合算した額をいう。

CDS清算業務に関する清算参加者の破綻処理に関する規則の一部改正新旧対照表

新	旧
<p>(定義)</p> <p>第2条 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。</p> <p>(1) (略)</p> <p>(2) 「<u>固定的損失補填財源</u>」とは、<u>第一階層CDS決済保証準備金、第二階層CDS決済保証準備金</u>及び破綻清算参加者以外の各清算参加者が当社に預託したCDS清算基金(当該破綻清算参加者に係る破綻認定日における当該各清算参加者のCDS清算基金所要額を上限とする。)をいう。</p> <p>(3) (略)</p> <p><u>(4) 削除</u></p> <p>(5)～(12) (略)</p>	<p>(定義)</p> <p>第2条 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。</p> <p>(1) (略)</p> <p>(2) 「<u>固定的損失補填財源</u>」とは、<u>第一階層決済保証準備金、第二階層決済保証準備金</u>及び破綻清算参加者以外の各清算参加者が当社に預託したCDS清算基金(当該破綻清算参加者に係る破綻認定日における当該各清算参加者のCDS清算基金所要額を上限とする。)をいう。</p> <p>(3) (略)</p> <p><u>(4) 「変動証拠金等」とは、業務方法書第106条第1項に規定する変動証拠金等をいう。</u></p> <p>(5)～(12) (略)</p>
<p>(<u>第一階層CDS決済保証準備金の積立て等</u>)</p> <p>第3条 当社は、CDS清算業務の開始に際し、20億円を、<u>第一階層CDS決済保証準備金</u>として積み立てる。</p> <p>2 当社は、各事業年度の終了後、CDS清算業務に係る利益のうち当社がその都度定める額を、<u>第一階層CDS決済保証準備金</u>として積み立てる。</p> <p>3 本業務方法書等の定めるところにより<u>第一階層CDS決済保証準備金</u>の全部又は一部が取り崩された場合には、その取り崩された額を</p>	<p>(<u>第一階層決済保証準備金の積立て等</u>)</p> <p>第3条 当社は、CDS清算業務の開始に際し、20億円を、<u>第一階層決済保証準備金</u>として積み立てる。</p> <p>2 当社は、各事業年度の終了後、CDS清算業務に係る利益のうち当社がその都度定める額を、<u>第一階層決済保証準備金</u>として積み立てる。</p> <p>3 本業務方法書等の定めるところにより<u>第一階層決済保証準備金</u>の全部又は一部が取り崩された場合には、その取り崩された額を第一階</p>

第一階層CDS決済保証準備金の額から減じる。

(第二階層CDS決済保証準備金の積立て等)

第4条 当社は、CDS清算業務の開始に際し、20億円を、第二階層CDS決済保証準備金として積み立てる。

2 本業務方法書等の定めるところにより第二階層CDS決済保証準備金の全部又は一部が取り崩された場合には、その取り崩された額を第二階層CDS決済保証準備金の額から減じる。

(破綻等の個別処理の原則)

第5条 複数の清算参加者について破綻等が認定された場合における期限前終了手数料の算出、業務方法書第95条の規定による同条第1項に規定する承継、損失回避取引の実施、破綻処理入札の実施、業務方法書第97条の規定による協議の実施及び同条第2項の合意の成立又は協議が不調となった場合におけるすべての清算約定の強制終了、清算参加者が当社に支払うべき特別清算料の額の算出及びその支払い、清算参加者が当社に預託すべき特別清算料担保金の額の算出及びその預託、破綻処理損失の算出及びその補填（当該補填のためにする第一階層CDS決済保証準備金、第二階層CDS決済保証準備金及びCDS清算基金の取崩しを含む。）、当社の破綻清算参加者に対する債権の額が確定した場合の調整その他破綻等の認定に関連する事項並びにこれらの事項に係る本業務方法書等の規定の適用については、本業務方法書等に別段の定めがある場合を除き、破綻清算参加者ごとに個別に行うものとする。

層決済保証準備金の額から減じる。

(第二階層決済保証準備金の積立て等)

第4条 当社は、CDS清算業務の開始に際し、20億円を、第二階層決済保証準備金として積み立てる。

2 本業務方法書等の定めるところにより第二階層決済保証準備金の全部又は一部が取り崩された場合には、その取り崩された額を第二階層決済保証準備金の額から減じる。

(破綻等の個別処理の原則)

第5条 複数の清算参加者について破綻等が認定された場合における期限前終了手数料の算出、業務方法書第95条の規定による同条第1項に規定する承継、損失回避取引の実施、破綻処理入札の実施、業務方法書第97条の規定による協議の実施及び同条第2項の合意の成立又は協議が不調となった場合におけるすべての清算約定の強制終了、清算参加者が当社に支払うべき特別清算料の額の算出及びその支払い、清算参加者が当社に預託すべき特別清算料担保金の額の算出及びその預託、破綻処理損失の算出及びその補填（当該補填のためにする第一階層決済保証準備金、第二階層決済保証準備金及びCDS清算基金の取崩しを含む。）、当社の破綻清算参加者に対する債権の額が確定した場合の調整その他破綻等の認定に関連する事項並びにこれらの事項に係る本業務方法書等の規定の適用については、本業務方法書等に別段の定めがある場合を除き、破綻清算参加者ごとに個別に行うものとする。

(すべての清算約定の強制終了)

第22条 (略)

2 当社及び清算参加者は、前項の各清算約定について、次の各号に掲げる場合に依り、当該各号に定めるところにより、当該各清算約定に係る期限前終了金額を支払い、又は当該各清算約定について預託を受けた変動証拠金を返還する。

(1)・(2) (略)

3 (略)

(第三階層特別清算料担保金の預託義務)

第29条 清算参加者は、他の清算参加者について破綻等が認定された場合には、次の各号に掲げる場合に依りて、当該各号に定める日時までに、当該各号に定める金額(ただし、各清算参加者が第三階層特別清算料担保金として当社に預託すべき金額の累計額は、同一の破綻処理単位期間につき、当該各清算参加者の当該破綻処理単位期間の開始日の前当社営業日におけるCDS清算基金所要額を上限とする。)を、第三階層特別清算料担保金として当社に預託しなければならない。

(1) 破綻処理清算約定等に係る損失相当額(破綻処理清算約定の反対清算約定及び業務方法書第94条第2項の規定により清算約定とみなされた損失回避取引について、破綻認定日(破綻清算参加者が破綻処理清算約定について当該破綻認定日に履行すべき債務の履行を完了している場合は、当該破綻認定日の翌当社営業日)以降の各当社営業日において当社が清算参加者に支払うべき変動証拠金等の総額から当社が当該清算参加者から受け取るべき変動証拠金等の総額を控除した額が正数である場合の当該額をいう。以下同じ。)が、固定的損失補填財源の合計

(すべての清算約定の強制終了)

第22条 (略)

2 当社及び清算参加者は、前項の各清算約定について、次の各号に掲げる場合に依り、当該各号に定めるところにより、当該各清算委託取引に係る期限前終了金額を支払い、又は当該各清算委託取引について預託を受けた変動証拠金を返還する。

(1)・(2) (略)

3 (略)

(第三階層特別清算料担保金の預託義務)

第29条 清算参加者は、他の清算参加者について破綻等が認定された場合には、次の各号に掲げる場合に依りて、当該各号に定める日時までに、当該各号に定める金額(ただし、各清算参加者が第三階層特別清算料担保金として当社に預託すべき金額の累計額は、同一の破綻処理単位期間につき、当該各清算参加者の当該破綻処理単位期間の開始日の前当社営業日におけるCDS清算基金所要額を上限とする。)を、第三階層特別清算料担保金として当社に預託しなければならない。

(1) 破綻処理清算約定等に係る損失相当額(破綻処理清算約定の反対清算約定及び業務方法書第94条第2項の規定により清算約定とみなされた損失回避取引について、破綻認定日(破綻清算参加者が破綻処理清算約定について当該破綻認定日に履行すべき債務の履行を完了している場合は、当該破綻認定日の翌当社営業日)以降の各当社営業日において当社が清算参加者に支払うべき変動証拠金等の総額から当社が当該清算参加者から受け取るべき変動証拠金等の総額を控除した額が正数である場合の当該額をいう。以下同じ。)が、固定的損失補填財源の合計

額を超過している場合において、その超過額のうち当該各清算参加者が第三階層特別清算料として負担することとなる額が、当該各清算参加者が当社に現に預託している清算約定（自己分）に係る当初証拠金及び破綻時証拠金の合計額を超過したとき

a 日時 当該超過した日の翌当社営業日の午前11時

b (略)

(2)・(3) (略)

(4) 第15条第4項、第17条第4項及び第17条の2第5項の場合において、各清算参加者が負担することとなる第三階層特別清算料として当社が第15条第4項第2号、第17条第4項第2号及び第17条の2第5項第2号の規定により当該各清算参加者に通知した金額が、当該各清算参加者が当社に現に預託している第三階層特別清算料担保金の合計額を超過したとき

a 日時 当該通知の行われた日の翌当社営業日の午前11時

b (略)

(第四階層特別清算料担保金の預託義務)

第30条 各清算参加者は、他の清算参加者について破綻等が認定された場合には、次の各号に掲げる場合に応じて、当該各号に定める日時までに、当該各号に定める金額を、第四階層特別清算料担保金として当社に預託しなければならない。

(1) 破綻処理清算約定等に係る損失相当額が、固定的損失補填財源の合計額を超過している場合において、その超過額のうち当該各清算参加者が第三階層特別清算料及び第四階層特別清算料として負担することとなる額の合計額（当該損失相当額をその時点で破

額を超過している場合において、その超過額のうち当該各清算参加者が第三階層特別清算料として負担することとなる額が、当該各清算参加者が当社に現に預託している清算約定（自己分）に係る当初証拠金及び破綻時証拠金の合計額を超過したとき

a 日時 当該超過した日の翌当社営業日の正午

b (略)

(2)・(3) (略)

(4) 第15条第4項、第17条第4項及び第17条の2第5項の場合において、各清算参加者が負担することとなる第三階層特別清算料として当社が第15条第4項第2号、第17条第4項第2号及び第17条の2第5項第2号の規定により当該各清算参加者に通知した金額が、当該各清算参加者が当社に現に預託している第三階層特別清算料担保金の合計額を超過したとき

a 日時 当該通知の行われた日の翌当社営業日の正午

b (略)

(第四階層特別清算料担保金の預託義務)

第30条 各清算参加者は、他の清算参加者について破綻等が認定された場合には、次の各号に掲げる場合に応じて、当該各号に定める日時までに、当該各号に定める金額を、第四階層特別清算料担保金として当社に預託しなければならない。

(1) 破綻処理清算約定等に係る損失相当額が、固定的損失補填財源の合計額を超過している場合において、その超過額のうち当該各清算参加者が第三階層特別清算料及び第四階層特別清算料として負担することとなる額の合計額（当該損失相当額をその時点で破

綻処理入札が実施された場合に当社に生じ得る破綻処理損失とみなした場合において、第27条及び第28条の規定により当該各清算参加者が第三階層特別清算料及び第四階層特別清算料として負担することとなる額の合計額をいう。)が、当該各清算参加者が当社に現に預託している清算約定(自己分)に係る当初証拠金、破綻時証拠金及び第三階層特別清算料担保金及び第四階層特別清算料担保金の合計額を超過したとき

a 日時 当該超過した日の翌当社営業日の午前11時

b (略)

(2)・(3) (略)

(4) 第15条第4項、第17条第4項及び第17条の2第5項の場合において、各清算参加者が負担することとなる第三階層特別清算料及び第四階層特別清算料として当社が第15条第4項第2号、第17条第4項第2号及び第17条の2第5項第2号の規定により当該各清算参加者に通知した金額の合計額が、当該各清算参加者が当社に現に預託している第三階層特別清算料担保金及び第四階層特別清算料担保金の合計額を超過したとき

a 日時 当該通知の行われた日の翌当社営業日の午前11時

b (略)

(回収金等の分配を受ける清算参加者が存在しない場合の取扱い)

第35条 当社は、業務方法書第111条第1項各号の額の分配を受ける清算参加者が存在しない場合には、次の各号に掲げる順序に従い、当該各号の定めるところにより当該額からその回収等に要した諸費用を控除した残額を処

綻処理入札が実施された場合に当社に生じ得る破綻処理損失とみなした場合において、第27条及び第28条の規定により当該各清算参加者が第三階層特別清算料及び第四階層特別清算料として負担することとなる額の合計額をいう。)が、当該各清算参加者が当社に現に預託している清算約定(自己分)に係る当初証拠金、破綻時証拠金及び第三階層特別清算料担保金及び第四階層特別清算料担保金の合計額を超過したとき

a 日時 当該超過した日の翌当社営業日の正午

b (略)

(2)・(3) (略)

(4) 第15条第4項、第17条第4項及び第17条の2第5項の場合において、各清算参加者が負担することとなる第三階層特別清算料及び第四階層特別清算料として当社が第15条第4項第2号、第17条第4項第2号及び第17条の2第5項第2号の規定により当該各清算参加者に通知した金額の合計額が、当該各清算参加者が当社に現に預託している第三階層特別清算料担保金及び第四階層特別清算料担保金の合計額を超過したとき

a 日時 当該通知の行われた日の翌当社営業日の正午

b (略)

(回収金等の分配を受ける清算参加者が存在しない場合の取扱い)

第35条 当社は、業務方法書第111条第1項各号の額の分配を受ける清算参加者が存在しない場合には、次の各号に掲げる順序に従い、当該各号の定めるところにより当該額からその回収等に要した諸費用を控除した残額を処

<p>理するものとする。</p> <p>(1) 当社は、当該残額を、金20億円に満つるまで、<u>第二階層CDS決済保証準備金</u>として積み立てる。</p> <p>(2) 当社は、前号の積立て後の残額を、<u>第一階層CDS決済保証準備金</u>として積み立てる。</p> <p style="text-align: center;">付 則</p> <p>この改正規定は、平成26年2月24日から施行する。</p>	<p>理するものとする。</p> <p>(1) 当社は、当該残額を、金20億円に満つるまで、<u>第二階層決済保証準備金</u>として積み立てる。</p> <p>(2) 当社は、前号の積立て後の残額を、<u>第一階層決済保証準備金</u>として積み立てる。</p>
--	--