# 自己資本比率規制(第1の柱)に関する告示の一部改正等に伴う 「業務方法書」等の一部改正について

#### I. 改正趣旨

本年3月31日から施行される「自己資本比率規制(第1の柱)に関する告示の一部改正」において、海外事業拠点を有する信用金庫連合会に対して国際統一基準行と同一の自己資本比率規制が適用されることを踏まえ、清算資格の取得審査に当たっての財務基準に係る要件等及び清算参加者の報告事項に関し、取引所取引等に係る清算業務について規定する「業務方法書」等、CDS取引に係る清算業務について規定する「CDS清算業務に関する業務方法書」等、金利スワップ取引に係る清算業務について規定する「金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書」等及び国債店頭取引清算業務について規定する「国債店頭取引清算業務に関する業務方法書」等について、所要の改正を行う。

#### Ⅱ. 改正概要

- 1. 海外拠点を有する信用金庫連合会に係る清算資格の取得審査基準等の見直し
  - ・国際統一基準行等に係る国際統一基準を、海 外事業拠点を有する信用金庫連合会にも適 用することとする。

(備 考)

- ・業務方法書第7条第1項第2号、第 29条第3項第5号及び第6号、第 4項第4号及び第5号及び業務方法 書の取扱い第8条第1項第7号
- ・CDS清算業務に関する業務方法書 第9条第1項第2号、第28条第3 項第1号及び第2号、第4項第2号 及び第3号、第5項第1号、第6項 第2号及び第3号及びCDS清算業 務に関する業務方法書の取扱い第3 1条第3項第1号及び第2号、第6 項第1号及び第2号、第8項第2号 及び第3号
- ・金利スワップ取引清算業務に関する 業務方法書第9条第1項第2号、第 28条第3項第1号及び第2号、第 4項第2号及び第3号、第5項第1 号、第6項第2号及び第3号及び金 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24条第3項第 1号及び第2号、第8項第2号及び

## 第3号

・国債店頭取引清算業務に関する業務 方法書第7条第1項第2号、第2項 第1号及び第2号、第28条第3項 第5号及び第6号、第4項第5号及 び第6号及び国債店頭取引清算業務 に関する業務方法書の取扱い第7条 第1項第10号

# 2. 清算参加者の当社への報告事項の追加

・清算参加者が法令の規定により処分を受け、 それに伴い行政官庁に対して改善策等の報告を 行ったときには、その内容を当社に報告するこ ととする。

- ・業務方法書の取扱い第8条第1項第 9号の3
- ・CDS清算業務に関する業務方法書の取扱い第24条第1項第12号の
- ・ 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20条第12 号の2
- ・国債店頭取引清算業務に関する業務 方法書の取扱い第7条第1項第15 号の2

# 3. その他

・その他所要の改正を行う。

# Ⅲ. 施行日

平成26年3月31日から施行する。

以 上

新 旧

(清算資格の要件)

第7条 前条第1項の申請に係る同条第3項の審査第7条 前条第1項の申請に係る同条第3項の審査 は、清算資格の取得申請者に関する次の各号に掲げ る事項その他金融商品債務引受業等の運営に関し て必要と認める事項について行うものとする。

- (1) (略)
- (2) 財務基盤

当該清算資格を取得すべき期日までに、次のa 又はbに掲げる区分に従い、当該a又はbに定め る基準に適合すると見込まれ、かつ、清算参加者 として安定した収益力が見込まれること。

- a (略)
- b 登録金融機関
  - (a)·(b) (略)
  - (c) 国際統一基準行、農林中央金庫、国 際統一基準金庫及び株式会社商工組合中 央金庫(以下「国際統一基準行等」という。) にあっては、次のイからハまでに該当して いること(外国銀行にあっては、これに準 ずる場合に該当していること)。
    - イ 単体又は連結普通株式等 Tier1 比率(農林中央金庫及び国際統一基準 金庫にあっては、単体又は連結普通出 資等Tier1比率とする。以下同 じ。)が4.5パーセントを上回ってい ること。

ロ・ハ (略)

(d) 国際統一基準行等、外国銀行及び保 険会社以外の登録金融機関(以下「国内基 準行等」という。<u>)</u>にあっては、国内基準に 係る単体又は連結自己資本比率が4パーセン トを上回っていること。

(清算資格の要件)

は、清算資格の取得申請者に関する次の各号に掲げ る事項その他金融商品債務引受業等の運営に関し て必要と認める事項について行うものとする。

- (略) (1)
- (2) 財務基盤

当該清算資格を取得すべき期日までに、次のa 又はbに掲げる区分に従い、当該a又はbに定め る基準に適合すると見込まれ、かつ、清算参加者 として安定した収益力が見込まれること。

- a (略)
- b 登録金融機関
  - (a) (b) (略)
  - (c) 国際統一基準行、農林中央金庫及び 株式会社商工組合中央金庫にあっては、次 のイからハまでに該当していること(外国 銀行にあっては、これに準ずる場合に該当 していること)。
    - イ 単体又は連結普通株式等 Tier1 比率(農林中央金庫にあっては、単体 又は連結普通出資等Tier1比率と する。以下同じ。)が4.5パーセント を上回っていること。

ロ・ハ (略)

(d) 国際統一基準行、農林中央金庫、株 式会社商工組合中央金庫、外国銀行及び保 険会社以外の登録金融機関にあっては、海 外事業拠点を有する場合は国際統一基準に係 る単体又は連結自己資本比率が8パーセント を、海外事業拠点を有しない場合は国内基準 に係る単体又は連結自己資本比率が4パーセ (e) (略)

(3)(略)

2 (略)

(清算参加者に対する措置)

第29条 (略)

(略)

3 当社は、清算参加者が次の各号のいずれかに該当3 当社は、清算参加者が次の各号のいずれかに該当 することとなった場合には、当該清算参加者を審問 のうえ、その事由の消滅するまで、当該清算参加者 を当事者とする清算対象取引に基づく債務の引受 けの全部又は一部の停止の措置を行うことができ る。

 $(1) \sim (4)$  (略)

国際統一基準行等について、次のaか らcまでのいずれかに該当することとなった とき(外国銀行にあっては、これに準ずる場合で 当社が必要と認めるとき)。

 $a \sim c$  (略)

(6) 国内基準行等(当該国内基準行等が証券 金融会社である場合には、第6条第3項の申請に 基づき清算資格を取得した者を除く。) について、 国内基準に係る単体又は連結自己資本比率が2 パーセントを下回り、速やかな回復が見込めない とき。

(7)(略)

4 当社は、清算参加者が他社清算参加者である場合|4 当社は、清算参加者が他社清算参加者である場合 で、当該清算参加者が次の各号のいずれかに該当す ることとなったときは、当該清算参加者を審問のう

ントを上回っていること。

(e) (略)

(3) (略)

2 (略)

(清算参加者に対する措置)

第29条 (略)

(略)

することとなった場合には、当該清算参加者を審問 のうえ、その事由の消滅するまで、当該清算参加者 を当事者とする清算対象取引に基づく債務の引受 けの全部又は一部の停止の措置を行うことができ る。

 $(1) \sim (4)$  (略)

(5) 国際統一基準行、農林中央金庫及び株 式会社商工組合中央金庫について、次のaか らcまでのいずれかに該当することとなった とき(外国銀行にあっては、これに準ずる場合で 当社が必要と認めるとき)。

 $a \sim c$  (略)

(6) 国際統一基準行、農林中央金庫、株式 会社商工組合中央金庫、外国銀行及び保険会 社以外の登録金融機関(当該登録金融機関が証 券金融会社である場合には、第6条第3項の申請 に基づき清算資格を取得した者を除く。) につい て、海外事業拠点を有する場合は国際統一基準に 係る単体又は連結自己資本比率が4パーセント を、海外事業拠点を有しない場合は国内基準に係 る単体又は連結自己資本比率が2パーセントを 下回り、速やかな回復が見込めないとき。

(7) (略)

で、当該清算参加者が次の各号のいずれかに該当す ることとなったときは、当該清算参加者を審問のう え、その事由の消滅するまで、当該清算参加者を当 え、その事由の消滅するまで、当該清算参加者を当 事者とする清算対象取引に基づく債務(有価証券等 清算取次ぎに係るものに限る。)の全部又は一部の 引受けの停止の措置を行うことができる。

- $(1) \sim (3)$  (略)
- (4) <u>国際統一基準行等</u>について、次の a から c までのいずれかに該当することとなったと き (外国銀行にあっては、これに準ずる場合で当 社が必要と認めるとき)。

 $a \sim c$  (略)

(5) <u>国内基準行等</u>について、国内基準に係る 単体又は連結自己資本比率が4パーセントを下 回り、速やかな回復が見込めないとき。

(6) (略)

5 • 6 (略)

付 則

この改正規定は、平成26年3月31日から施行する。

事者とする清算対象取引に基づく債務(有価証券等 清算取次ぎに係るものに限る。)の全部又は一部の 引受けの停止の措置を行うことができる。

 $(1) \sim (3)$  (略)

(4) 国際統一基準行、農林中央金庫及び株式会社商工組合中央金庫について、次のaからcまでのいずれかに該当することとなったとき(外国銀行にあっては、これに準ずる場合で当社が必要と認めるとき)。

 $a \sim c$  (略)

- (5) 国際統一基準行、農林中央金庫、株式会社商工組合中央金庫、外国銀行及び保険会社以外の登録金融機関について、海外事業拠点を有する場合は国際統一基準に係る単体又は連結自己資本比率が8パーセントを、海外事業拠点を有しない場合は国内基準に係る単体又は連結自己資本比率が4パーセントを下回り、速やかな回復が見込めないとき。
- (6) (略)
- 5・6 (略)

### 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

(定義)

る。

第2条 本業務方法書等において使用する用語は、金第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IS DA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

 $(1) \sim (15)$  (略)

(16) 「自己資本額」とは、金融商品取引業者 にあっては、金融商品取引業等に関する内閣府令 (平成19年内閣府令第52号)第1条第4項第 2 号に規定する固定化されていない自己資本の 額をいい、保険会社及び信用金庫以外の海外事業 拠点を有する登録金融機関にあっては、国際統一 基準に係る単体総自己資本比率の計算に用いる 総自己資本の額(外国銀行にあっては、これに相 当する額)をいい、保険会社以外の海外事業拠点 を有しない登録金融機関及び海外事業拠点を有 する信用金庫である登録金融機関にあっては、国 内基準に係る単体自己資本比率の計算に用いる 自己資本の額をいい、保険会社である登録金融機 関にあっては、純資産額をいう。

 $(17) \sim (66)$  (略)

2 · 3 (略)

(CDS清算資格の要件)

- 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)(略)
  - (2) 財務基盤
    - (略) a
  - b 登録金融機関

旧

(定義)

融商品取引法(昭和23年法律第25号)及びIS DA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。

 $(1) \sim (15)$ (略)

(16) 「自己資本額」とは、金融商品取引業者 にあっては、金融商品取引業等に関する内閣府令 (平成19年內閣府令第52号)第1条第4項第 2号に規定する固定化されていない自己資本の 額をいい、保険会社以外の登録金融機関にあって は、海外事業拠点を有する場合は国際統一基準に 係る単体自己資本比率の計算に用いる自己資本 の額(外国銀行にあっては、これに相当する額) を、海外事業拠点を有しない場合は国内基準に係 る単体自己資本比率の計算に用いる自己資本の 額をいい、保険会社である登録金融機関にあって は、純資産額をいう。

 $(17) \sim (66)$  (略)

2 · 3 (略)

(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 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)(略)
- (2) 財務基盤
- (略)
- b 登録金融機関

(a) (略)

(b) 国際統一基準行、農林中央金庫、国 際統一基準金庫及び株式会社商工組合中 央金庫(以下「国際統一基準行等」とい う。) にあっては、次のイからハまでに 該当していること(外国銀行にあっては、 これに準ずる場合に該当していること)。 イ 単体又は連結普通株式等 Tier1 比率(農林中央金庫及び国際統一基準 金庫にあっては、単体又は連結普通出 資等Tier1比率とする。以下同 じ。)が4.5パーセント(その信用状 況に照らし当社が必要と認める場合には 5.625パーセント)を上回っている こと。

ロ・ハ (略)

(c) 国際統一基準行等、外国銀行及び保 険会社以外の登録金融機関(以下「国内 基準行等」という。) にあっては、国内基 準に係る単体又は連結自己資本比率が4パ ーセント(その信用状況に照らし当社が必要 と認める場合には5パーセント)を上回って いること。

(d)·(e) (略)

(3) (略)

(清算参加者に対する措置)

第28条 (略)

2 (略)

(a) (略)

(b) 国際統一基準行、農林中央金庫及び 株式会社商工組合中央金庫にあっては、 次のイからハまでに該当していること (外国銀行にあっては、これに準ずる場 合に該当していること)。

イ 単体又は連結普通株式等 Tier1 比率(農林中央金庫にあっては、単体 又は連結普通出資等Tier1比率と する。以下同じ。)が4.5パーセント (その信用状況に照らし当社が必要と認 める場合には5.625パーセント)を上 回っていること。

ロ・ハ (略)

(c) 国際統一基準行、農林中央金庫、株 式会社商工組合中央金庫、外国銀行及び 保険会社以外の登録金融機関にあって は、海外事業拠点を有する場合は国際統一基 準に係る単体又は連結自己資本比率が8パ ーセント(その信用状況に照らし当社が必要 と認める場合には10パーセント)を、海外 事業拠点を有しない場合は国内基準に係る 単体又は連結自己資本比率が 4 パーセント (その信用状況に照らし当社が必要と認め る場合には5パーセント)を上回っているこ と。

(d)·(e) (略)

(3) (略)

(清算参加者に対する措置)

第28条 (略)

2 (略)

3 当社は、次の各号に掲げる場合に応じて、清算参3 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 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、当該清算参加者を審問のうえ、その事由が消滅するまで、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CDS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、CDS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) 当該清算参加者が親会社等保証を受けてい ない場合

a (略)

b 当該清算参加者が<u>国際統一基準行等</u>である場合にあっては、次の(a)から(c)までのいずれかに該当し、かつ、その信用力が相当悪化するおそれがあると当社が認めるとき(外国銀行にあっては、これに準ずる場合に該当したとき)。

#### $(a) \sim (c)$ (略)

c 当該清算参加者が<u>国内基準行等</u>である場合 にあっては、国内基準に係る単体又は連結自己 資本比率が5パーセントを下回り、かつその信 用力が相当悪化するおそれがあると当社が認 めるとき。

d·e (略)

- (2) 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
  - a (略)
  - b 当該清算参加者が<u>国際統一基準行等</u>である場合にあっては、次の(a)から(c)までのいずれかに該当するとともに、当該

となったと認める場合には、当該清算参加者を審問のうえ、その事由が消滅するまで、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CDS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、CDS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) 当該清算参加者が親会社等保証を受けていない場合

a (略)

b 当該清算参加者が<u>国際統一基準行、農林中央金庫又は株式会社商工組合中央金庫</u>である場合にあっては、次の(a)から(c)までのいずれかに該当し、かつ、その信用力が相当悪化するおそれがあると当社が認めるとき(外国銀行にあっては、これに準ずる場合に該当したとき)。

 $(a) \sim (c)$  (略)

c 当該清算参加者が<u>国際統一基準行、農林中</u> 央金庫、株式会社商工組合中央金庫、外国 銀行又は保険会社以外の登録金融機関である 場合にあっては、海外事業拠点を有するときは 国際統一基準に係る単体又は連結自己資本比 率が10パーセントを、海外事業拠点を有しな いときは国内基準に係る単体又は連結自己資 本比率が5パーセントを下回り、かつその信用 力が相当悪化するおそれがあると当社が認め るとき。

d · e (略)

- (2) 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
  - a (略)
  - b 当該清算参加者が<u>国際統一基準行、農林中</u> 央金庫及び株式会社商工組合中央金庫であ る場合にあっては、次の(a)から(c)

親会社等が信用悪化事由に該当し、かつ、 当該親会社等の信用力が相当悪化するおそれ があると当社が認めるとき(外国銀行にあっ ては、これに準ずる場合に該当したとき)。

### (a) ~ (c) (略)

c 当該清算参加者が国内基準行等である場合 にあっては、国内基準に係る単体又は連結自己 資本比率が5パーセントを下回るとともに、当 該親会社等が信用悪化事由に該当し、かつ、当 該親会社等の信用力が相当悪化するおそれが あると当社が認めるとき。

d·e (略)

- 4 前項第2号の「信用悪化事由」とは、次の各号に4 前項第2号の「信用悪化事由」とは、次の各号に 掲げる清算参加者の親会社等の区分に従い、当該各 号に定める事由をいう。
  - (1) (略)
  - (2)国際統一基準行等である場合

次のaからcまでのいずれかに該当するこ と(外国銀行にあっては、これに準ずる場合 に該当すること)。

 $a \sim c$  (略)

(3) 国内基準行等である場合

国内基準に係る単体又は連結自己資本比率が 5パーセントを下回ること。

までのいずれかに該当するとともに、当該 親会社等が信用悪化事由に該当し、かつ、 当該親会社等の信用力が相当悪化するおそれ があると当社が認めるとき(外国銀行にあっ ては、これに準ずる場合に該当したとき)。 (a)~(c) (略)

c 当該清算参加者が<u>国際統一基準行、農林中</u> 央金庫、株式会社商工組合中央金庫、外国 銀行又は保険会社以外の登録金融機関である 場合にあっては、当該清算参加者が海外事業拠 点を有するときは国際統一基準に係る単体又 は連結自己資本比率が10パーセントを、海外 事業拠点を有しないときは国内基準に係る単 体又は連結自己資本比率が5パーセントを下 回るとともに、当該親会社等が信用悪化事由に 該当し、かつ、当該親会社等の信用力が相当悪 化するおそれがあると当社が認めるとき。

d·e (略)

- 掲げる清算参加者の親会社等の区分に従い、当該各 号に定める事由をいう。
  - (1) (略)
  - 国際統一基準行、農林中央金庫又は株 (2)式会社商工組合中央金庫である場合

次のaからcまでのいずれかに該当するこ と(外国銀行にあっては、これに準ずる場合 に該当すること)。

 $a \sim c$  (略)

(3) 国際統一基準行、農林中央金庫、株式会社 商工組合中央金庫、外国銀行及び保険会社以外の 登録金融機関である場合

海外事業拠点を有するときは国際統一基準に 係る単体又は連結自己資本比率が10パーセン トを、海外事業拠点を有しないときは国内基準に 係る単体又は連結自己資本比率が5パーセント を下回ること。

(4) • (5) (略)

- 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、当該清算参加者を審問 のうえ、その事由が消滅するまで、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 負担の全部又は一部の停止の措置を行うことがで きる。
  - (1) 当該清算参加者が親会社等保証を受けてい ない場合

 $a \sim c$  (略)

d 当該清算参加者が国際統一基準行等である 場合にあっては、次の(a)から(c)までの いずれかに該当したとき(外国銀行にあって は、これに準ずる場合に該当したとき)。

 $(a) \sim (c)$ (略)

e 当該清算参加者が国内基準行等である場合 にあっては、国内基準に係る単体又は連結自己 資本比率が4パーセントを下回り、速やかな回 復を見込めないとき。

f (略)

(2)(略)

- 6 前項第2号c及びdの「信用悪化事由」とは、6 前項第2号c及びdの「信用悪化事由」とは、 次の各号に掲げる清算参加者の親会社等の区分 に従い、当該各号に定める事由をいう。
  - (1)(略)
  - (2)国際統一基準行等である場合

次のaからcまでのいずれかに該当するこ と(外国銀行にあっては、これに準ずる場合 (4) • (5) (略)

5 当社は、次の各号に掲げる場合に応じて、清算参 5 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、当該清算参加者を審問 のうえ、その事由が消滅するまで、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 負担の全部又は一部の停止の措置を行うことがで きる。

> (1) 当該清算参加者が親会社等保証を受けてい ない場合

 $a \sim c$  (略)

- d 当該清算参加者が<u>国際統一基準行、農林中央</u> 金庫又は株式会社商工組合中央金庫である場 合にあっては、次の(a)から(c)までのい ずれかに該当したとき(外国銀行にあっては、 これに準ずる場合に該当したとき)。
  - $(a) \sim (c)$  (略)
- e 当該清算参加者が国際統一基準行、農林中 央金庫、株式会社商工組合中央金庫、外国 銀行及び保険会社以外の登録金融機関である 場合にあっては、海外事業拠点を有するときは 国際統一基準に係る単体又は連結自己資本比 率が8パーセントを、海外事業拠点を有しない ときは国内基準に係る単体又は連結自己資本 比率が4パーセントを下回り、速やかな回復を 見込めないとき。

f (略)

(2)(略)

- 次の各号に掲げる清算参加者の親会社等の区分 に従い、当該各号に定める事由をいう。
- (1) (略)
- (2)国際統一基準行、農林中央金庫又は株 式会社商工組合中央金庫である場合

次のaからcまでのいずれかに該当するこ と(外国銀行にあっては、これに準ずる場合 に該当すること)。

 $a \sim c$  (略)

(3) 国内基準行等である場合

国内基準に係る単体又は連結自己資本比率が4パーセントを下回ること。

(4) • (5) (略)

7 (略)

付 則

この改正規定は、平成26年3月31日から施行する。

に該当すること)。

 $a \sim c$  (略)

(3) <u>国際統一基準行、農林中央金庫、株式会社</u> <u>商工組合中央金庫、外国銀行及び保険会社以外の</u> 登録金融機関である場合

海外事業拠点を有するときは国際統一基準に 係る単体又は連結自己資本比率が8パーセント を、海外事業拠点を有しないときは国内基準に係 る単体又は連結自己資本比率が4パーセントを 下回ること。

 $(4) \cdot (5) \qquad (略)$ 

7 (略)

### 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

(定義)

第2条 本業務方法書等において使用する用語は、金第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IS 各号に定めるところによる。

 $(1) \sim (20)$  (略)

(21) 「自己資本額」とは、金融商品取引業者 にあっては、金融商品取引業等に関する内閣府令 (平成19年内閣府令第52号)第1条第4項第 2号に規定する固定化されていない自己資本の 額をいい、保険会社及び信用金庫以外の海外事業 拠点を有する登録金融機関にあっては、国際統一 基準に係る単体総自己資本比率の計算に用いる 総自己資本の額(外国銀行にあっては、これに相 当する額)をいい、保険会社以外の海外事業拠点 を有しない登録金融機関及び海外事業拠点を有 する信用金庫である登録金融機関にあっては、国 内基準に係る単体自己資本比率の計算に用いる 自己資本の額をいい、保険会社である登録金融機 関にあっては、純資産額をいう。

 $(22) \sim (72)$  (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。
  - (1) (略)
  - (2) 財務基盤
    - a (略)
    - b 登録金融機関
      - (a) (略)

旧

(定義)

融商品取引法(昭和23年法律第25号)及びIS DA定義集において使用される用語の例によるは DA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。

 $(1) \sim (20)$  (略)

(21) 「自己資本額」とは、金融商品取引業者 にあっては、金融商品取引業等に関する内閣府令 (平成19年内閣府令第52号)第1条第4項第 2 号に規定する固定化されていない自己資本の 額をいい、保険会社以外の登録金融機関にあって は、海外事業拠点を有する場合は国際統一基準に 係る単体自己資本比率の計算に用いる自己資本 の額(外国銀行にあっては、これに相当する額) を、海外事業拠点を有しない場合は国内基準に係 る単体自己資本比率の計算に用いる自己資本の 額をいい、保険会社である登録金融機関にあって は、純資産額をいう。

 $(22) \sim (72)$  (略)

2 · 3 (略)

(金利スワップ清算資格の要件)

- 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。
  - (1) (略)
  - (2) 財務基盤
  - a (略)
  - b 登録金融機関
    - (a) (略)

- (b) 国際統一基準行、農林中央金庫、国 際統一基準金庫及び株式会社商工組合中 央金庫(以下「国際統一基準行等」という。) にあっては、次のイからハまでに該当して いること (外国銀行にあっては、これに準 ずる場合に該当していること)。
- イ 単体又は連結普通株式等Tier1 比率(農林中央金庫及び国際統一基準金 庫にあっては、単体又は連結普通出資等 Tier1比率とする。以下同じ。)が 4.5パーセント(その信用状況に照らし 当社が必要と認める場合には5.625パ ーセント)を上回っていること。

ロ・ハ (略)

(c) 国際統一基準行等、外国銀行及び保 険会社以外の登録金融機関(以下「国内基 準行等」という。) にあっては、国内基準 に係る単体又は連結自己資本比率が4パー セント(その信用状況に照らし当社が必要と 認める場合には5パーセント)を上回ってい ること。

(d) • (e) (略)

(3) (略)

2 (略)

(清算参加者に対する措置)

第28条 (略)

(略)

3 当社は、次の各号に掲げる場合に応じて、清算参|3 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 加者が当該各号のいずれかの事由に該当すること のうえ、その事由が消滅するまで、当該清算参加者 のうえ、その事由が消滅するまで、当該清算参加者

- (b) 国際統一基準行、農林中央金庫及び 株式会社商工組合中央金庫にあっては、次 のイからハまでに該当していること(外国 銀行にあっては、これに準ずる場合に該当 していること)。
  - イ 単体又は連結普通株式等 Tier1 比率(農林中央金庫にあっては、単体又 は連結普通出資等Tier1比率とす る。以下同じ。)が4.5パーセント(そ の信用状況に照らし当社が必要と認める 場合には5.625パーセント)を上回っ ていること。

ロ・ハ (略)

(c) 国際統一基準行、農林中央金庫、株 式会社商工組合中央金庫、外国銀行及び保 険会社以外の登録金融機関にあっては、海 外事業拠点を有する場合は国際統一基準に 係る単体又は連結自己資本比率が8パーセ ント(その信用状況に照らし当社が必要と認 める場合には10パーセント)を、海外事業 拠点を有しない場合は国内基準に係る単体 又は連結自己資本比率が4パーセント(その 信用状況に照らし当社が必要と認める場合 には5パーセント)を上回っていること。

(d) • (e) (略)

(3) (略)

2 (略)

(清算参加者に対する措置)

第28条 (略)

2 (略)

となったと認める場合には、当該清算参加者を審問 となったと認める場合には、当該清算参加者を審問

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) 当該清算参加者が親会社等保証を受けてい ない場合

a (略)

b 当該清算参加者が<u>国際統一基準行等</u>である場合にあっては、次の(a)から(c)までのいずれかに該当し、かつ、その信用力が相当悪化するおそれがあると当社が認めるとき(外国銀行にあっては、これに準ずる場合に該当したとき)。

#### $(a) \sim (c)$ (略)

c 当該清算参加者が<u>国内基準行等</u>である場合にあっては、国内基準に係る単体又は連結自己 資本比率が5パーセントを下回り、かつその信用力が相当悪化するおそれがあると当社が認めるとき。

d·e (略)

(2) 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

a (略)

b 当該清算参加者が<u>国際統一基準行等</u>である場合にあっては、次の(a)から(c)までのいずれかに該当するとともに、当該親会社等が信用悪化事由に該当し、かつ、当該親会社等の信用力が相当悪化するおそれがあると当社が認めるとき(外国銀行にあっては、これ

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) 当該清算参加者が親会社等保証を受けてい ない場合

a (略)

b 当該清算参加者が<u>国際統一基準行、農林中央金庫又は株式会社商工組合中央金庫</u>である場合にあっては、次の(a)から(c)までのいずれかに該当し、かつ、その信用力が相当悪化するおそれがあると当社が認めるとき(外国銀行にあっては、これに準ずる場合に該当したとき)。

 $(a) \sim (c)$  (略)

c 当該清算参加者が国際統一基準行、農林中央 金庫、株式会社商工組合中央金庫、外国銀行又 は保険会社以外の登録金融機関である場合に あっては、海外事業拠点を有するときは国際統 一基準に係る単体又は連結自己資本比率が1 0パーセントを、海外事業拠点を有しないとき は国内基準に係る単体又は連結自己資本比率 が5パーセントを下回り、かつその信用力が相 当悪化するおそれがあると当社が認めるとき。

d·e (略)

(2) 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

a (略)

b 当該清算参加者が<u>国際統一基準行、農林中央金庫及び株式会社商工組合中央金庫</u>である場合にあっては、次の(a)から(c)までのいずれかに該当するとともに、当該親会社等が信用悪化事由に該当し、かつ、当該親会社等の信用力が相当悪化するおそれがあると

に準ずる場合に該当したとき)。

(a) ~ (c) (略)

c 当該清算参加者が国内基準行等である場合 にあっては、国内基準に係る単体又は連結自己 資本比率が5パーセントを下回るとともに、当 該親会社等が信用悪化事由に該当し、かつ、当 該親会社等の信用力が相当悪化するおそれが あると当社が認めるとき。

d·e (略)

- 号に定める事由をいう。
  - (1) (略)
  - (2) 国際統一基準行等である場合

次のaからcまでのいずれかに該当するこ と(外国銀行にあっては、これに準ずる場合 に該当すること)。

 $a \sim c$  (略)

(3) 国内基準行等である場合

国内基準に係る単体又は連結自己資本比率が 5パーセントを下回ること。

(4) • (5) (略)

当社が認めるとき(外国銀行にあっては、こ れに準ずる場合に該当したとき)。

(a) ~ (c) (略)

c 当該清算参加者が国際統一基準行、農林中 央金庫、株式会社商工組合中央金庫、外国 銀行又は保険会社以外の登録金融機関である 場合にあっては、当該清算参加者が海外事業拠 点を有するときは国際統一基準に係る単体又 は連結自己資本比率が10パーセントを、海外 事業拠点を有しないときは国内基準に係る単 体又は連結自己資本比率が5パーセントを下 回るとともに、当該親会社等が信用悪化事由に 該当し、かつ、当該親会社等の信用力が相当悪 化するおそれがあると当社が認めるとき。

d·e (略)

- 4 前項第2号の「信用悪化事由」とは、次の各号に4 前項第2号の「信用悪化事由」とは、次の各号に 掲げる清算参加者の親会社等の区分に従い、当該各 掲げる清算参加者の親会社等の区分に従い、当該各 号に定める事由をいう。
  - (1) (略)
  - (2) 国際統一基準行、農林中央金庫又は株式 会社商工組合中央金庫である場合

次のaからcまでのいずれかに該当するこ と(外国銀行にあっては、これに準ずる場合 に該当すること)。

 $a \sim c$  (略)

(3) 国際統一基準行、農林中央金庫、株式会社 商工組合中央金庫、外国銀行及び保険会社以外の 登録金融機関である場合

海外事業拠点を有するときは国際統一基準に 係る単体又は連結自己資本比率が10パーセン トを、海外事業拠点を有しないときは国内基準に 係る単体又は連結自己資本比率が5パーセント を下回ること。

(4)・(5) (略)

5 当社は、次の各号に掲げる場合に応じて、清算参 5 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 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、当該清算参加者を審問 のうえ、その事由が消滅するまで、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 負担の全部又は一部の停止の措置を行うことがで きる。

(1) 当該清算参加者が親会社等保証を受けてい ない場合

 $a \sim c$  (略)

d 当該清算参加者が<u>国際統一基準行等</u>であ る場合にあっては、次の(a)から(c) までのいずれかに該当したとき(外国銀行 にあっては、これに準ずる場合に該当した とき)。

 $(a) \sim (c)$  (略)

e 当該清算参加者が国内基準行等である場合 にあっては、国内基準に係る単体又は連結自己 資本比率が4パーセントを下回り、速やかな回 復を見込めないとき。

f (略)

(2) (略)

- い、当該各号に定める事由をいう。
  - (1)(略)
  - (2)国際統一基準行等である場合

次のaからcまでのいずれかに該当すること (外国銀行にあっては、これに準ずる場合に該当 すること)。

 $a \sim c$  (略)

となったと認める場合には、当該清算参加者を審問 のうえ、その事由が消滅するまで、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 負担の全部又は一部の停止の措置を行うことがで きる。

(1) 当該清算参加者が親会社等保証を受けてい ない場合

 $a \sim c$  (B)

d 当該清算参加者が国際統一基準行、農林 中央金庫又は株式会社商工組合中央金庫で ある場合にあっては、次の(a)から(c) までのいずれかに該当したとき(外国銀行 にあっては、これに準ずる場合に該当した とき)。

 $(a) \sim (c)$ (略)

e 当該清算参加者が国際統一基準行、農林中 央金庫、株式会社商工組合中央金庫、外国 銀行及び保険会社以外の登録金融機関である 場合にあっては、海外事業拠点を有するときは 国際統一基準に係る単体又は連結自己資本比 率が8パーセントを、海外事業拠点を有しない ときは国内基準に係る単体又は連結自己資本 比率が4パーセントを下回り、速やかな回復を 見込めないとき。

f (略)

(2) (略)

6 前項第2号c及びdの「信用悪化事由」とは、次|6 前項第2号c及びdの「信用悪化事由」とは、次| の各号に掲げる清算参加者の親会社等の区分に従 の各号に掲げる清算参加者の親会社等の区分に従 い、当該各号に定める事由をいう。

- (1)(略)
- (2)国際統一基準行、農林中央金庫又は株式会 社商工組合中央金庫である場合

次のaからcまでのいずれかに該当すること (外国銀行にあっては、これに準ずる場合に該当 すること)。

 $a \sim c$  (略)

(3) 国内基準行等である場合

国内基準に係る単体又は連結自己資本比率が4パーセントを下回ること。

(4) • (5) (略)

7 (略)

付 則

この改正規定は、平成26年3月31日から施行する。

(3) <u>国際統一基準行、農林中央金庫、株式会社</u> <u>商工組合中央金庫、外国銀行及び保険会社以外の</u> 登録金融機関である場合

海外事業拠点を有するときは国際統一基準に 係る単体又は連結自己資本比率が8パーセント を、海外事業拠点を有しないときは国内基準に係 る単体又は連結自己資本比率が4パーセントを 下回ること。

(4) • (5) (略)

7 (略)

#### 国債店頭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

(清算資格の要件)

第7条 前条第1項の申請に係る同条第4項の審査第7条 前条第1項の申請に係る同条第4項の審査 は、資格取得申請者に関する次の各号に掲げる事項は、資格取得申請者に関する次の各号に掲げる事項 その他国債店頭取引清算業務の運営に関して必要 と認める事項について行うものとする。

- (1)(略)
- (2)財務基盤

清算資格を取得すべき期日までに、次のa又は bに掲げる区分に従い、当該a又はbに定める基 準に適合すると見込まれること。

- a (略)
- b 銀行、協同組織金融機関、株式会社商工組合 中央金庫又は保険会社
  - (a)·(b) (略)
  - (c) 銀行等(銀行、協同組織金融機関及び 株式会社商工組合中央金庫をいう。以下同 じ。) のうち、国際統一基準行、農林中央金 庫、国際統一基準金庫及び株式会社商工組合 中央金庫(以下「国際統一基準行等」という。) にあっては、次のイからハまでに該当してい ること(外国銀行にあっては、これに準ずる 場合に該当していること)。
  - イ 単体及び連結普通株式等Tier1比率 (農林中央金庫及び国際統一基準金庫にあ っては、単体及び連結普通出資等 Tier 1比率とする。以下同じ。) が4.5パー セント以上であること。

ロ・ハ (略)

(d) 国際統一基準行等以外の銀行等(以下) 「国内基準行等」という。)にあっては、国 内基準に係る単体及び連結自己資本比率が4 パーセント以上であること。

(清算資格の要件)

その他国債店頭取引清算業務の運営に関して必要 と認める事項について行うものとする。

- (1)(略)
- (2)財務基盤

清算資格を取得すべき期日までに、次のa又は bに掲げる区分に従い、当該a又はbに定める基 準に適合すると見込まれること。

- (略)
- b 銀行、協同組織金融機関、株式会社商工組合 中央金庫又は保険会社
  - (a)·(b) (略)
  - (c) 銀行等(銀行、協同組織金融機関及び 株式会社商工組合中央金庫をいう。以下同 じ。)のうち、国際統一基準行、農林中央金 庫及び株式会社商工組合中央金庫にあって は、次のイからハまでに該当していること(外 国銀行にあっては、これに準ずる場合に該当 していること)。
  - イ 単体及び連結普通株式等Tier1比率 (農林中央金庫にあっては、単体及び連結 普通出資等Tier1比率とする。以下同 じ。)が4.5パーセント以上であること。

ロ・ハ (略)

(d) 国際統一基準行、農林中央金庫及び株 式会社商工組合中央金庫以外の銀行等にあっ ては、海外事業拠点を有する場合は国際統一 基準に係る単体及び連結自己資本比率が8パ ーセント以上、海外事業拠点を有しない場合 (e) (略)

(3) (略)

他国債店頭取引清算業務の運営に関して必要と認 める事項について行うものとする。

### (1) 財務基盤

清算資格を取得すべき期日までに、次のa又は bに掲げる区分に従い、当該a又はbに定める基 準に適合すると見込まれること。

a (略)

b 銀行、協同組織金融機関、株式会社商工組合 中央金庫又は保険会社

(c) 国際統一基準行等にあっては、次のイ からハまでに該当していること(外国銀行に あっては、これに準ずる場合に該当している こと)。

イ~ハ (略)

(d) 国内基準行等にあっては、国内基準に 係る単体及び連結自己資本比率が4パーセ ント以上であること。

(e)·(f) (略)

#### (2) 親会社の財務基盤

国債店頭取引清算資格を取得すべき期日まで に、次のa又はbに掲げる区分に従い、当該資格 取得申請者の親会社が当該a又はbに定める基 準に適合すると見込まれること。

a (略)

は国内基準に係る単体及び連結自己資本比率 が4パーセント以上であること。

(e) (略)

(3) (略)

2 前条第2項の申請に係る同条第4項の審査は、資2 前条第2項の申請に係る同条第4項の審査は、資 格取得申請者に関する次の各号に掲げる事項その 格取得申請者に関する次の各号に掲げる事項その 他国債店頭取引清算業務の運営に関して必要と認 める事項について行うものとする。

### (1) 財務基盤

清算資格を取得すべき期日までに、次のa又は bに掲げる区分に従い、当該a又はbに定める基 準に適合すると見込まれること。

(略)

b 銀行、協同組織金融機関、株式会社商工組合 中央金庫又は保険会社

(c) 銀行等のうち、国際統一基準行、農林 中央金庫及び株式会社商工組合中央金庫に あっては、次のイからハまでに該当している こと(外国銀行にあっては、これに準ずる場 合に該当していること)。

イ~ハ (略)

(d) 国際統一基準行、農林中央金庫及び株 式会社商工組合中央金庫以外の銀行等にあ っては、海外事業拠点を有する場合は国際統 一基準に係る単体及び連結自己資本比率が 8パーセント以上、海外事業拠点を有しない 場合は国内基準に係る単体及び連結自己資 本比率が4パーセント以上であること。

(e)·(f) (略)

#### (2) 親会社の財務基盤

国債店頭取引清算資格を取得すべき期日まで に、次のa又はbに掲げる区分に従い、当該資格 取得申請者の親会社が当該a又はbに定める基 準に適合すると見込まれること。

(略)

b 当該資格取得申請者の親会社が銀行、協同組 織金融機関、株式会社商工組合中央金庫又は保 険会社である場合

- (a)·(b) (略)
- (c) 国際統一基準行等にあっては、次のイ からハまでに該当していること(外国銀行に あっては、これに準ずる場合に該当している こと)。

イ~ハ (略)

(d) 国内基準行等にあっては、国内基準に 係る単体及び連結自己資本比率が4パーセ ント以上であること。

(e) (略)

(3) (略)

3 (略)

第28条 (略)

2 (略)

- 3 当社は、清算参加者が次の各号のいずれかに該当3 当社は、清算参加者が次の各号のいずれかに該当 することとなったときは、当該清算参加者を審問の することとなったときは、当該清算参加者を審問の うえ、その事由の消滅するまで、当該清算参加者を 当事者とする清算対象取引に基づく債務の引受け の全部又は一部の停止の措置を行うことができる。
  - $(1) \sim (4)$  (略)
  - (5) 国際統一基準行等について、次のaからc までのいずれかに該当することとなったとき (外 国銀行にあっては、これに準ずる場合において当 社が必要と認めるとき)。

 $a \sim c$  (略)

b 当該資格取得申請者の親会社が銀行、協同組 織金融機関、株式会社商工組合中央金庫又は保 険会社である場合

(a)·(b) (略)

(c) 銀行等のうち、国際統一基準行、農林 中央金庫及び株式会社商工組合中央金庫に あっては、次のイからハまでに該当している こと(外国銀行にあっては、これに準ずる場 合に該当していること)。

イ~ハ (略)

(d) 国際統一基準行、農林中央金庫及び株 式会社商工組合中央金庫以外の銀行等にあ っては、海外事業拠点を有する場合は国際統 一基準に係る単体及び連結自己資本比率が 8パーセント以上、海外事業拠点を有しない 場合は国内基準に係る単体及び連結自己資 本比率が4パーセント以上であること。

(e) (略)

(3) (略)

3 (略)

(清算参加者が業務方法書に違反した場合等の措置) │(清算参加者が業務方法書に違反した場合等の措置) 第28条 (略)

2 (略)

うえ、その事由の消滅するまで、当該清算参加者を 当事者とする清算対象取引に基づく債務の引受け の全部又は一部の停止の措置を行うことができる。

 $(1) \sim (4)$  (略)

(5) 銀行等のうち、国際統一基準行、農林中央 金庫及び株式会社商工組合中央金庫について、次 のaからcまでのいずれかに該当することとな ったとき(外国銀行にあっては、これに準ずる場 合において当社が必要と認めるとき)。

 $a \sim c$  (略)

(6) 国内基準行等について、国内基準に係る単 体又は連結自己資本比率が4パーセントを下回 り、速やかな回復が見込めないとき。

(7) (略)

者である場合において、当該清算参加者が次の各号 のいずれかに該当することとなったときは、当該清 算参加者を審問のうえ、その事由の消滅するまで、 当該清算参加者を当事者とする清算対象取引に基 づく債務(有価証券等清算取次ぎに係るものに限 る。) の引受けの全部又は一部の停止の措置を行う ことができる。

 $(1) \sim (4)$ (略)

(5) 国際統一基準行等について、次のaからc までのいずれかに該当することとなったとき (外 国銀行にあっては、これに準ずる場合において当 社が必要と認めるとき)。

 $a \sim c$ (略)

(6) 国内基準行等について、国内基準に係る単 体又は連結自己資本比率が4パーセントを下回 り、速やかな回復が見込めないとき。

(7) (略)

 $5 \sim 10$  (略)

則 付

この改正規定は、平成26年3月31日から施行す

(6) 国際統一基準行、農林中央金庫及び株式会 社商工組合中央金庫以外の銀行等について、海外 事業拠点を有する場合は国際統一基準に係る単 体又は連結自己資本比率が8パーセントを、海外 事業拠点を有しない場合は国内基準に係る単体 又は連結自己資本比率が4パーセントを下回り、 速やかな回復が見込めないとき。

(7) (略)

4 当社は、清算参加者が国債店頭取引他社清算参加4 当社は、清算参加者が国債店頭取引他社清算参加 者である場合において、当該清算参加者が次の各号 のいずれかに該当することとなったときは、当該清 算参加者を審問のうえ、その事由の消滅するまで、 当該清算参加者を当事者とする清算対象取引に基 づく債務(有価証券等清算取次ぎに係るものに限 る。) の引受けの全部又は一部の停止の措置を行う ことができる。

 $(1) \sim (4)$  (略)

(5) 銀行等のうち、国際統一基準行、農林中央 金庫及び株式会社商工組合中央金庫について、次 のaからcまでのいずれかに該当することとな ったとき(外国銀行にあっては、これに準ずる場 合において当社が必要と認めるとき)。

 $a \sim c$  (略)

(6) 国際統一基準行、農林中央金庫及び株式会 社商工組合中央金庫以外の銀行等について、海外 事業拠点を有する場合は国際統一基準に係る単 体又は連結自己資本比率が8パーセントを、海外 事業拠点を有しない場合は国内基準に係る単体 又は連結自己資本比率が4パーセントを下回り、 速やかな回復が見込めないとき。

(7) (略)

 $5 \sim 10$  (略)

る。	

新

旧

(報告事項)

第8条 業務方法書第20条に規定する当社が定め第8条 業務方法書第20条に規定する当社が定め る場合は、次の各号に掲げる場合とし、所定の報告 書に当社が必要と認める書類を添付して報告する ものとする。

 $(1) \sim (6)$  (略)

(7) 次のaからdまでに掲げる区分に従い、当 該aからdまでに定める事由に該当したとき。

a (略)

b 国際統一基準行、農林中央金庫、国際統一基 準金庫及び株式会社商工組合中央金庫(以下 「国際基準行等」という。)

次の(a)から(c)までのいずれかに該当 したとき(外国銀行にあっては、これに準ずる 場合に該当したとき)。

- (a) 単体又は連結普通株式等Tier 1 比率 (農林中央金庫及び国際統一基準) 金庫にあっては、単体又は連結普通出資 等Tier1比率とする。以下同じ。) が2.25パーセントを下回ったとき(当 該清算参加者が他社清算参加者である場合 は、単体又は連結普通株式等Tier1 比率が4.5パーセントを下回ったと き)。
- (b) · (c) (略)
- c 国際統一基準行等、外国銀行及び保険会社以 外の登録金融機関

国内基準に係る単体又は連結自己資本比率 が2パーセントを下回ったとき(当該清算参加 者が他社清算参加者である場合は、国内基準に 係る単体又は連結自己資本比率が4パーセン トを下回ったとき)。

(報告事項)

る場合は、次の各号に掲げる場合とし、所定の報告 書に当社が必要と認める書類を添付して報告する ものとする。

 $(1) \sim (6)$  (略)

(7) 次のaからdまでに掲げる区分に従い、当 該aからdまでに定める事由に該当したとき。

(略)

b 国際統一基準行、農林中央金庫及び株式会社 商工組合中央金庫

次の(a)から(c)までのいずれかに該当 したとき(外国銀行にあっては、これに準ずる 場合に該当したとき)。

(a) 単体又は連結普通株式等Tier 1比率(農林中央金庫にあっては、単体 又は連結普通出資等Tier1比率とす る。以下同じ。)が2.25パーセント を下回ったとき(当該清算参加者が他社清 算参加者である場合は、単体又は連結普通 株式等 Tier1 比率が 4.5パーセン トを下回ったとき)。

(b) · (c) (略)

c 国際統一基準行、農林中央金庫、株式会社商 工組合中央金庫、外国銀行及び保険会社以外の 登録金融機関

海外営業又は事業拠点を有する場合は国際 統一基準に係る単体又は連結自己資本比率が 4パーセントを、海外営業又は事業拠点を有し ない場合は国内基準に係る単体又は連結自己 資本比率が2パーセントを下回ったとき(当該 d (略)

(7) の2~ (9) の2 (略)

(9)の3 前2号に規定する処分に伴い行政官庁

に対し改善策等を報告したとき。

 $(10) \sim (26)$  (略)

2 (略)

付 則

この改正規定は、平成26年3月31日から施行する。

清算参加者が他社清算参加者である場合は、海 外営業又は事業拠点を有する場合は国際統一 基準に係る単体又は連結自己資本比率が8パ ーセントを、海外営業又は事業拠点を有しない 場合は国内基準に係る単体又は連結自己資本 比率が4パーセントを下回ったとき)。

d (略)

(7) の2~ (9) の2 (略)

(新設)

 $(10) \sim (26)$  (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

(報告事項)

第24条 業務方法書第20条に規定する当社が定第24条 業務方法書第20条に規定する当社が定 める場合は、清算参加者について次に掲げる事項が 生じた場合とし、当該清算参加者は、当社所定の報 告書に当社が必要と認める書類を添付して当該事 項を当社に報告するものとする。

- $(1) \sim (12)$  (略)
- (12)の2 前2号に規定する処分に伴い行政官

庁に対し改善策等を報告したとき。

 $(13) \sim (35)$  (略)

 $2 \sim 4$  (略)

(信用状況に応じた清算参加者に対する措置)

第31条 (略)

(略)

- 3 業務方法書第32条第1号bに規定する当社の3 業務方法書第32条第1号bに規定する当社の 各号に定めるものとする。
  - (1) 国際統一基準行、農林中央金庫、国際 統一基準金庫及び株式会社商工組合中央金庫 (以下「国際統一基準行等」という。) であ る場合

次のaからcまでに定める水準(外国銀行 にあっては、これに準ずる水準)

a 単体又は連結普通株式等Tier1比率 (農林中央金庫及び国際統一基準金庫にあ っては、単体又は連結普通出資等Tier 1比率とする。以下同じ。)については5. 625パーセント、その信用状況については 当該清算参加者の信用力が十分でないおそれ があると当社が通知又は公示により定める場 合

b • c (略)

(2) 国際統一基準行等、外国銀行及び保険会社

旧

(報告事項)

める場合は、清算参加者について次に掲げる事項が 生じた場合とし、当該清算参加者は、当社所定の報 告書に当社が必要と認める書類を添付して当該事 項を当社に報告するものとする。

 $(1) \sim (12)$  (略)

(新設)

 $(13) \sim (35)$  (略)

 $2 \sim 4$  (略)

(信用状況に応じた清算参加者に対する措置)

第31条 (略)

(略)

定める水準は、次の各号に掲げる区分に従い、当該 定める水準は、次の各号に掲げる区分に従い、当該 各号に定めるものとする。

> (1) 国際統一基準行、農林中央金庫及び株 式会社商工組合中央金庫である場合

次のaからcまでに定める水準(外国銀行 にあっては、これに準ずる水準)

a 単体又は連結普通株式等Tier1比率 (農林中央金庫にあっては、単体又は連結 普通出資等Tier1比率とする。以下同 じ。)については5.625パーセント、 その信用状況については当該清算参加者の信 用力が十分でないおそれがあると当社が通知 又は公示により定める場合

b·c (略)

(2) 国際統一基準行、農林中央金庫、株式会

以外の登録金融機関(以下「国内基準行等」とい う。) である場合

清算参加者の国内基準に係る単体又は連結自 己資本比率については5パーセント、その信用状 況については当該清算参加者の信用力が十分で ないおそれがあると当社が通知又は公示により 定める場合

#### 4 · 5 (略)

- 6 業務方法書第32条第2号bに規定する当社の6 業務方法書第32条第2号bに規定する当社の 定める水準は、次の各号に掲げる清算参加者の区分 に従い、当該各号に定めるものとする。
  - 国際統一基準行等である場合 (1)

次のaからcまでに定める水準(外国銀行 にあっては、これに準ずる水準)

 $a \sim c$  (略)

(2) 国内基準行等である場合

清算参加者の国内基準に係る単体又は連結自 己資本比率については5パーセント、当該親会社 等の信用状況については当該親会社等の信用力 が十分でないおそれがあると当社が通知又は公 示により定める場合

商工組合中央金庫、外国銀行及び保険会社以外の 登録金融機関である場合

海外事業拠点を有するときは清算参加者の国 際統一基準に係る単体又は連結自己資本比率に ついては10パーセント、その信用状況について は当該清算参加者の信用力が十分でないおそれ があると当社が通知又は公示により定める場合、 海外事業拠点を有しないときは清算参加者の国 内統一基準に係る単体又は連結自己資本比率に ついては5パーセント、その信用状況については 当該清算参加者の信用力が十分でないおそれが あると当社が通知又は公示により定める場合

4 · 5 (略)

- 定める水準は、次の各号に掲げる清算参加者の区分 に従い、当該各号に定めるものとする。
  - 国際統一基準行、農林中央金庫及び株 式会社商工組合中央金庫である場合

次のaからcまでに定める水準(外国銀行 にあっては、これに準ずる水準)

 $a \sim c$  (略)

(2) 国際統一基準行、農林中央金庫、株式会社 商工組合中央金庫、外国銀行及び保険会社以外の 登録金融機関である場合

海外事業拠点を有するときは清算参加者の国 際統一基準に係る単体又は連結自己資本比率に ついては10パーセント、当該親会社等の信用状 況については当該親会社等の信用力が十分でな いおそれがあると当社が通知又は公示により定 める場合、海外事業拠点を有しないときは清算参 加者の国内統一基準に係る単体又は連結自己資 本比率については5パーセント、当該親会社等の 信用状況については当該親会社等の信用力が十 分でないおそれがあると当社が通知又は公示に より定める場合

(略)

(略)

- 8 業務方法書第32条第2号aからcまでに規定8 業務方法書第32条第2号aからcまでに規定 する当社の定める事由は、次の各号に掲げる清算参する当社の定める事由は、次の各号に掲げる清算参 加者の親会社等の区分に従い、当該各号に定める事 由とする。
  - (1) (略)
  - (2) 国際統一基準行等である場合

次のaからcまでに該当すること(外国銀行に あっては、これに準ずる場合に該当しているこ と)。

 $a \sim c$  (略)

(3) 国内基準行等である場合

国内基準に係る単体又は連結自己資本比率が 5パーセントを下回ること。

(4) • (5) (略)

什 則

この改正規定は、平成26年3月31日から施行す る。

加者の親会社等の区分に従い、当該各号に定める事 由とする。

- (1) (略)
- (2) 国際統一基準行、農林中央金庫及び株式会 社商工組合中央金庫である場合

次のaからcまでに該当すること(外国銀行に あっては、これに準ずる場合に該当しているこ と)。

 $a \sim c$  (略)

(3) 国際統一基準行、農林中央金庫、株式会社 商工組合中央金庫、外国銀行及び保険会社以外の 登録金融機関である場合

海外事業拠点を有するときは国際統一基準に 係る単体又は連結自己資本比率が10パーセン トを、海外事業拠点を有しないときは国内基準に 係る単体又は連結自己資本比率が5パーセント を下回ること。

(4) • (5) (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

(報告事項)

第20条 業務方法書第20条に規定する当社が定第20条 業務方法書第20条に規定する当社が定 める場合は、清算参加者について次に掲げる事項が 生じた場合とし、当該清算参加者は、当社所定の報 告書に当社が必要と認める書類を添付して当該事 項を当社に報告するものとする。

 $(1) \sim (12)$  (略)

(12)の2 前2号に規定する処分に伴い行政官

庁に対し改善策等を報告したとき。

 $(13) \sim (35)$  (略)

 $2 \sim 4$  (略)

(信用状況に応じた清算参加者に対する措置)

第24条 (略)

(略)

- 3 業務方法書第32条第1号bに規定する当社の3 業務方法書第32条第1号bに規定する当社の 各号に定めるものとする。
  - (1) 国際統一基準行、農林中央金庫、国際 統一基準金庫及び株式会社商工組合中央金庫 (以下「国際統一基準行等」という。) であ る場合

次のaからcまでに定める水準(外国銀行 にあっては、これに準ずる水準)

a 単体又は連結普通株式等Tier1比率 (農林中央金庫及び国際統一基準金庫にあ っては、単体又は連結普通出資等Tier 1比率とする。以下同じ。)については5. 625パーセント、その信用状況については 当該清算参加者の信用力が十分でないおそれ があると当社が通知又は公示により定める場 合

b • c

(略)

(2) 国際統一基準行等、外国銀行及び保険会社

旧

(報告事項)

める場合は、清算参加者について次に掲げる事項が 生じた場合とし、当該清算参加者は、当社所定の報 告書に当社が必要と認める書類を添付して当該事 項を当社に報告するものとする。

 $(1) \sim (12)$  (略)

(新設)

 $(13) \sim (35)$  (略)

 $2 \sim 4$  (略)

(信用状況に応じた清算参加者に対する措置)

第24条 (略)

(略)

定める水準は、次の各号に掲げる区分に従い、当該 定める水準は、次の各号に掲げる区分に従い、当該 各号に定めるものとする。

> (1) 国際統一基準行、農林中央金庫及び株 式会社商工組合中央金庫である場合

次のaからcまでに定める水準(外国銀行 にあっては、これに準ずる水準)

a 単体又は連結普通株式等Tier1比率 (農林中央金庫にあっては、単体又は連結 普通出資等Tier1比率とする。以下同 じ。)については5.625パーセント、 その信用状況については当該清算参加者の信 用力が十分でないおそれがあると当社が通知 又は公示により定める場合

b·c (略)

(2) 国際統一基準行、農林中央金庫、株式会

以外の登録金融機関(以下「国内基準行等」とい う。) である場合

清算参加者の国内基準に係る単体又は連結自 己資本比率については5パーセント、その信用状 況については当該清算参加者の信用力が十分で ないおそれがあると当社が通知又は公示により 定める場合

#### 4 · 5 (略)

- 6 業務方法書第32条第2号bに規定する当社の6 業務方法書第32条第2号bに規定する当社の 定める水準は、次の各号に掲げる清算参加者の区分 に従い、当該各号に定めるものとする。
  - (1) 国際統一基準行等である場合

次のaからcまでに定める水準(外国銀行 にあっては、これに準ずる水準)

 $a \sim c$  (略)

(2) 国内基準行等である場合

清算参加者の国内基準に係る単体又は連結自 己資本比率については5パーセント、当該親会社 等の信用状況については当該親会社等の信用力 が十分でないおそれがあると当社が通知又は公 示により定める場合

商工組合中央金庫、外国銀行及び保険会社以外の 登録金融機関である場合

海外事業拠点を有するときは清算参加者の国 際統一基準に係る単体又は連結自己資本比率に ついては10パーセント、その信用状況について は当該清算参加者の信用力が十分でないおそれ があると当社が通知又は公示により定める場合、 海外事業拠点を有しないときは清算参加者の国 内統一基準に係る単体又は連結自己資本比率に ついては5パーセント、その信用状況については 当該清算参加者の信用力が十分でないおそれが あると当社が通知又は公示により定める場合

4 · 5 (略)

- 定める水準は、次の各号に掲げる清算参加者の区分 に従い、当該各号に定めるものとする。
  - 国際統一基準行、農林中央金庫及び株 式会社商工組合中央金庫である場合

次のaからcまでに定める水準(外国銀行 にあっては、これに準ずる水準)

 $a \sim c$  (略)

(2) 国際統一基準行、農林中央金庫、株式会社 商工組合中央金庫、外国銀行及び保険会社以外の 登録金融機関である場合

海外事業拠点を有するときは清算参加者の国 際統一基準に係る単体又は連結自己資本比率に ついては10パーセント、当該親会社等の信用状 況については当該親会社等の信用力が十分でな いおそれがあると当社が通知又は公示により定 める場合、海外事業拠点を有しないときは清算参 加者の国内統一基準に係る単体又は連結自己資 本比率については5パーセント、当該親会社等の 信用状況については当該親会社等の信用力が十 分でないおそれがあると当社が通知又は公示に より定める場合

(略) 7

7 (略)

- 由とする。
  - (1) (略)
  - (2)国際統一基準行等である場合

次のaからcまでに該当すること(外国銀行に あっては、これに準ずる場合に該当しているこ と)。

 $a \sim c$  (略)

(3) 国内基準行等である場合

国内基準に係る単体又は連結自己資本比率が 5パーセントを下回ること。

(4) • (5) (略)

付 則

この改正規定は、平成26年3月31日から施行す る。

- 8 業務方法書第32条第2号aからcまでに規定 8 業務方法書第32条第2号aからcまでに規定 する当社の定める事由は、次の各号に掲げる清算参 する当社の定める事由は、次の各号に掲げる清算参 加者の親会社等の区分に従い、当該各号に定める事 加者の親会社等の区分に従い、当該各号に定める事 由とする。
  - (1) (略)
  - 国際統一基準行、農林中央金庫及び株式会 (2)社商工組合中央金庫である場合

次のaからcまでに該当すること(外国銀行に あっては、これに準ずる場合に該当しているこ ح) 。

 $a \sim c$  (略)

(3) 国際統一基準行、農林中央金庫、株式会社 商工組合中央金庫、外国銀行及び保険会社以外の 登録金融機関である場合

海外事業拠点を有するときは国際統一基準に 係る単体又は連結自己資本比率が10パーセン トを、海外事業拠点を有しないときは国内基準に 係る単体又は連結自己資本比率が5パーセント を下回ること。

(4) • (5) (略)

### 国債店頭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

(報告事項)

第7条 業務方法書第19条に規定する当社が定め第7条 業務方法書第19条に規定する当社が定め ものとする。

 $(1) \sim (9)$  (略)

(10) 次のaからdまでに掲げる区分に従い、 当該aからdまでに定める事由に該当したとき。

a (略)

b 国際統一基準行、農林中央金庫、国際統一基 準金庫及び株式会社商工組合中央金庫(以下 「国際統一基準行等」という。)

次の(a)から(c)までのいずれかに該当 したとき(外国銀行にあっては、これに準ずる 場合に該当したとき)。

(a) 単体又は連結普通株式等Tier1比 率(農林中央金庫及び国際統一基準金庫にあ っては、単体又は連結普通出資等Tier1 比率とする。以下同じ。)が4.5パーセン トを下回ったとき。

(b)·(c) (略)

c 国際統一基準行等以外の銀行等

国内基準に係る単体又は連結自己資本比率 が4パーセントを下回ったとき。

d (略)

 $(11) \sim (15)$ (略)

(15)の2 前2号に規定する処分に伴い行政官

庁に対し改善策等を報告したとき。

 $(16) \sim (36)$  (略)

(報告事項)

る場合は、次の各号に掲げる場合とし、所定の報告 る場合は、次の各号に掲げる場合とし、所定の報告 書に当社が必要と認める書類を添付して報告する│書に当社が必要と認める書類を添付して報告する ものとする。

 $(1) \sim (9)$  (略)

(10) 次のaからdまでに掲げる区分に従い、 当該aからdまでに定める事由に該当したとき。

a (略)

b 国際統一基準行、農林中央金庫及び株式会社 商工組合中央金庫

次の(a)から(c)までのいずれかに該当 したとき(外国銀行にあっては、これに準ずる 場合に該当したとき)。

(a) 単体又は連結普通株式等Tier1比 率(農林中央金庫にあっては、単体又は連結 普通出資等Tier1比率とする。以下同 じ。)が4.5パーセントを下回ったとき。

(b) • (c) (略)

c 国際統一基準行、農林中央金庫及び株式会社 商工組合中央金庫以外の銀行等

海外事業拠点を有する場合は国際統一基準 に係る単体又は連結自己資本比率が8パーセ <u>ントを、海外事業拠点を有し</u>ない場合は国内基 準に係る単体又は連結自己資本比率が 4 パー セントを下回ったとき。

d (略)

 $(11) \sim (15)$ (略)

(新設)

 $(16) \sim (36)$ (略)

$2\sim4$ (略)	$2\sim 4$	(略)	
付 則			
この改正規定は、平成26年3月31日から施行す			
る。			