

**債務負担の対象とする適格金利スワップ取引の要件等の見直しに伴う
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について**

I. 改正趣旨

当社が行う金利スワップ取引清算業務において債務負担の対象としている適格金利スワップ取引の要件について、当該要件として定める内容を金利スワップ取引の経済条件等に係る内容に限るものとして整理すべく、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について、所要の制度改正を行う。

記

II. 改正概要

○適格金利スワップ取引の要件の変更等

- ・適格金利スワップ取引の要件の一つとして定めている、当社が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という要件を、適格金利スワップ取引の要件ではなく債務負担等の申込方法として整理する。

(備 考)

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条第2号等

III. 施行日

平成26年7月15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の取扱いの一部改正新旧対照表

新	旧
<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27条第1項第2号</u>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。</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</u>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。</p>
<p>(適格金利スワップ取引の要件)</p> <p>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。</p> <p>(1) (略)</p> <p><u>(2) 削除</u></p> <p>(3) ～ (15) (略)</p>	<p>(適格金利スワップ取引の要件)</p> <p>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。</p> <p>(1) (略)</p> <p><u>(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。</u></p> <p>(3) ～ (15) (略)</p>
<p>(債務負担等の申込方法等)</p> <p>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。</p> <p>(1) (略)</p> <p>(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 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</p> <p>2 (略)</p>	<p>(債務負担等の申込方法等)</p> <p>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。</p> <p>(1) (略)</p> <p>(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 <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を用いる方法</u></p> <p>2 (略)</p>

(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) (略)

(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27条第1項第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

2～4 (略)

(清算約定の一括コンプレッションの申込み)

第30条の2 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27条第1項第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。

2～7 (略)

(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27条第1項第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 (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)

(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) (略)

(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

2～4 (略)

(清算約定の一括コンプレッションの申込み)

第30条の2 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。

2～7 (略)

(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 (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27条第1項第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27条第1項第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。

2～3 （略）

付 則

この改正規定は、平成26年7月15日から施行する。

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。

2～3 （略）