

〇 I S等の清算取扱い及びユーロ円T I B O Rの対象年限拡大等に係る 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

金利スワップ取引に係る清算業務について、清算参加者の利便性を向上すべく、日本円無担保コールレート（オーバーナイト物）と日本円固定金利を交換する金利スワップ取引（O v e r n i g h t I n d e x S w a p。以下「〇 I S」という。）等の清算対象取引としての追加及びユーロ円T I B O Rの清算対象年限の拡大を行うとともに、債務負担処理等の改善を行う。併せて、リスク管理制度の精緻化を図るべく、当初証拠金制度の見直しを行う。

上記に伴い、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、別紙のとおり所要の改正を行う。

II. 改正概要

1. 〇 I S等の清算取扱い及びユーロ円T I B O Rの清算対象年限 拡大

- ・ 〇 I S及び変動金利が日本円T I B O R（以下「D T I B O R」という。）（金利計算期間が3か月又は6か月であるものに限る）である金利スワップ取引を清算対象取引に追加する。
- ・ 新たに清算対象とする取引の残存期間について、D T I B O Rを変動金利とする金利スワップ取引に係る残存期間を3日以上3, 6 6 6日以内と、〇 I Sに係る同期間を3日以上1 4, 6 2 3日以内とするとともに、現在、清算対象としているユーロ円T I B O Rを変動金利とする金利スワップ取引に係る同期間を3日以上7, 3 1 8日以内とする。

2. 債務負担処理等の改善

(1) 債務負担処理を行う時間の延長

- ・ 債務負担処理を行う時間帯を、当社営業日午前9時から正午まで及び午後1時から午後4時までとする。

(2) バックロード取引に係る債務負担処理の変更

- ・ 午後4時から午後8時までの間に債務負担の申込みが行われたバックロード取引（債務負担の申込みが行われた日において取引日から10営業日が経過している取引をいう。）について、債務負担の可否の判定を通常債務負担処理とは別に行う。

（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（以下「業務方法書の取扱い」という。）第9条

業務方法書の取扱い第27条等

業務方法書の取扱い第2条第4号、第27条、第28条

(3) 任意解約のリアルタイム処理化

- ・任意解約処理について、債務負担処理と同様、任意解約の申込みが行われる都度、当該任意解約が行われたと仮定して証拠金を算出し、任意解約の申込みを行った清算参加者が再計算された証拠金の所要額以上の当初証拠金を預託している場合に、任意解約処理を行うこととする。

・金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書（以下「業務方法書」という。）第53条、業務方法書の取扱い第30条

(4) 清算約定の承継（ポジション移管）の当日処理化

- ・清算委託者が、自身が委託先としている受託清算参加者から他の清算参加者へ自己のポジションを承継させようとする場合で、当社が午後1時まで当該承継の申込みを受領したときは、当社は申込日と同日に当該承継の成立の可否を判断することとする。
- ・清算委託取引の移管についても、同様とする。

・業務方法書第58条の2、第58条の3、業務方法書の取扱い第35条の3、第38条、金利スワップ清算受託契約書第28条の3、第28条の4
・業務方法書第58条の4、第58条の5、業務方法書の取扱い第38条

3. 当初証拠金制度の見直し

(1) 当初証拠金算出方法の見直し

- ・当初証拠金所要額の算出方式を、期待ショートフォール方式に変更する。
- ・過去の金利変動が特に大きかった期間をストレスイベントシナリオとし、当該ストレスイベントシナリオにおいて損失額が上位のシナリオを参照期間（1, 250日間）に追加する。

・業務方法書の取扱い別表2

(2) 当初証拠金割増制度の見直し

- ・流動性等に係る当初証拠金の割増制度に係る算出方法について、テナー間のリスク相殺を精緻に反映することが可能となるよう、相関係数を考慮した算出方法へ変更する。

・業務方法書の取扱い第23条

4. その他

- ・その他、所要の改正を行うものとする。

III. 施行日

平成26年11月4日から施行する。ただし、DTIBORの取扱いに関する規定は、当社が定める日から施行する。

(注)「当社が定める日」は平成26年12月15日。

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

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>(清算受託契約の締結の届出)</p> <p>第44条 (略)</p> <p>2 <u>当社は、清算参加者から前項の規定による届出を受けた場合(当該届出に係る清算受託契約の締結に係る清算委託者について、他の清算参加者から既に同項の規定による届出を受けている場合を除く。)</u> その他当社が適当と認めるときは、<u>速やかに他の清算参加者に当該清算委託者の商号その他の事項を通知し、かつ公表する。</u></p>	<p>(清算受託契約の締結の届出)</p> <p>第44条 (略)</p> <p>(新設)</p>
<p>(清算受託契約の解約の届出)</p> <p>第45条 (略)</p> <p>2・3 (略)</p> <p>4 <u>当社は、清算参加者から第1項の規定による届出を受けた場合(当該届出に係る清算受託契約の解約により、当該解約に係る清算委託者がいずれの清算参加者との間でも清算受託契約を締結していない状況になる場合に限る。)</u> その他当社が適当と認めるときは、<u>速やかに他の清算参加者に当該清算委託者の商号その他の事項を通知し、かつ公表する。</u></p>	<p>(清算受託契約の解約の届出)</p> <p>第45条 (略)</p> <p>2・3 (略)</p> <p>(新設)</p>
<p>(債務負担による清算約定の成立)</p> <p>第49条 (略)</p> <p>2・3 (略)</p> <p>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、<u>前条第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。</u>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</p>	<p>(債務負担による清算約定の成立)</p> <p>第49条 (略)</p> <p>2・3 (略)</p> <p>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、<u>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。</u>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</p>

するものとする。

(1)・(2) (略)

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通知することにより、その旨の申込みをするものとする。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 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に係る通知を受領した場合において、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任意解約の申込みに係る通知を受領したときは、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並びに当該清算参加者及び当該他の清算参加者が債務負担時所要証拠金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「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、前項の規定により任意解約要件の確認を行った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、第1項の規定にかかわらず、任意解約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

ものとする。

(1)・(2) (略)

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

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) 変更後の当社が任意解約の申込みに係る通知を受領する時間

(削る)

5 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、当社との間で任意解約に係る任意解約手数料の授受を行う。

6 (略)

(清算約定(委託分)の承継の申込み)

第58条の2 (略)

2・3 (略)

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午後1時までに、当社に対して、当該承継申込書(承継清算参加者が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

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に預託又は交付すべき当初証拠金及び変動証拠金等の内容及び額

(3) すべての清算参加者が前号の当初証拠金及び変動証拠金等を当社に預託又は交付すべき時限

5 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。

6 (略)

(清算約定(委託分)の承継の申込み)

第58条の2 (略)

2・3 (略)

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時までに、当社に対して、当該承継申込書(承継清算参加者が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、承継日（第4項第1号に規定する承継日をいう。以下同じ。）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、当該承継日の午後4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の額（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。）に当該変動証拠金の額を加減した額が預託又は交付されている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。

2～5 （略）

（清算委託者の清算委託取引の移管の申込み）

第58条の4 （略）

2 （略）

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た移管の申込みを受領した場合には、当該移管を希望する日において、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

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。

2～5 （略）

（清算委託者の清算委託取引の移管の申込み）

第58条の4 （略）

2 （略）

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

金等を算出することとし、当該日の午後4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の額（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。）に当該変動証拠金の額を加減した額が預託又は交付されている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。

2～6 （略）

（当初証拠金の預託時限）

第66条 （略）

2 （略）

3 前2項の規定にかかわらず、当初証拠金預託額が、債務負担又は任意解約の申込みを受領することに伴い当社が算出した債務負担時所要証拠金の額（未決済金額（第85条の2第1項第1号の規定により差引計算した結果負数である場合の当該負数の額の絶対値をいう。以下同じ。）を控除した額とする。以下本項において同じ。）以上となった場合には、債務負担時所要証拠金の額を当初証拠金所要額とみなす。

（日中証拠金の預託時限）

第70条 （略）

2 （略）

3 当初証拠金預託額が、債務負担又は任意解約の申込みを受領することに伴い当社が算出した債務負担時所要証拠金の額以上となった場合には、債務負担時所要証拠金の額を日中証拠金所要額とみなす。

（当初証拠金及び決済金額の差引計算）

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。

2～6 （略）

（当初証拠金の預託時限）

第66条 （略）

2 （略）

（新設）

（日中証拠金の預託時限）

第70条 （略）

2 （略）

3 当初証拠金預託額が、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、日中証拠金所要額の不足は解消されたものとする。

（当初証拠金及び決済金額の差引計算）

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、金銭により預託しなければならない。

(1) (当初証拠金預託額のうち金銭による預託額) - (清算参加者が支払うこととなる決済金額等)

(2) (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金銭による預託額をいう。)) - (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。

(当初証拠金預託額 + 清算参加者が受領することとなる決済金額等) - (当初証拠金所要額)

第85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85条の3 第85条第2項の差引計算の結果、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ていない場合、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。

(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)

第94条 (略)

2～4 (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、当該承継の申込みが行われた日において、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。

6～8 (略)

(返戻の申請及び当初証拠金のみなし預託)
第85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。

(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)

第94条 (略)

2～4 (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。

6～8 (略)

付 則

この改正規定は、平成26年11月4日から施行する。

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)～(3) (略)</p> <p>(4) <u>「バックロード取引」とは、清算参加者が当社に対して当社営業日の午後4時から午後8時の間に債務負担の申込みを行った適格金利スワップ取引であって、当該申込みが行われた日において取引日から10当社営業日が経過しているものをいう。</u></p> <p><u>(5) (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)～(3) (略)</p> <p>(新設)</p> <p><u>(4) (略)</u></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、<u>第1号</u>を除くすべての要件）とする。</p> <p>(1)～(4) (略)</p> <p>(5) 変動金利の決定方法が<u>次のaからdまでに掲げるものであり、かつ、変動金利の金利計算期間が当該aからdに定める期間であること。</u></p> <p><u>a JPY-LIBOR-BBA 3か月又は6か月</u></p> <p><u>b JPY-TIBOR-ZTIBOR 3か月又は6か月</u></p> <p><u>c JPY-TIBOR-17097 3か</u></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、<u>第1号及び第2号</u>を除くすべての要件）とする。</p> <p>(1)～(4) (略)</p> <p>(5) 変動金利の決定方法が<u>JPY-LIBOR-BBA又はJPY-TIBOR-ZTIBORであること。</u></p>

月又は6か月

d JPY-TONA-OIS-COMPO
UND 1日

- (6) (削除)
- (7) 想定元本及び決済通貨が日本円であること。
- (8) 契約期間が、次のa及びbに掲げる変動金利の決定方法の金利スワップ取引ごとに、当該a及びbに定める日数以上であること。

a JPY-TONA-OIS-COMPO
UND 7日

b 上記aに掲げる変動金利の決定方法以外
の変動金利の決定方法 28日

- (9) 債務負担の申込みの日における終了日までの期間について、次のaからcまで掲げる金利スワップ取引ごとに、当該aからcまでに定める期間であること。
- a 変動金利としてJPY-TIBOR-17097であるものを対象とする金利スワップ取引 3日以上3,666日以内
- b 変動金利としてJPY-TIBOR-ZTIBORであるものを対象とする金利スワップ取引（当該取引のうち、前aに掲げる取引に該当するものを除く。） 3日以上7,318日以内

c (略)

(10)～(15) (略)

(リスク量大きい場合における当初証拠金所要額の引上げ)

第23条 (略)

2 業務方法書第29条第2項の当初証拠金所要

- (6) 変動金利の金利計算期間が3か月又は6か月であること。

(7) 想定元本及び決済通貨が日本円であること。

- (8) 契約期間が28日以上であること。

- (9) 債務負担の申込みの日における終了日までの期間について、次のaからcまで掲げる金利スワップ取引ごとに、当該aからcまでに定める期間であること。

a 変動金利としてJPY-TIBOR-ZTIBORであり変動金利の金利計算期間が3か月であるものを対象とする金利スワップ取引 3日以上1,839日以内

b 変動金利としてJPY-TIBOR-ZTIBORであり変動金利の金利計算期間が6か月であるものを対象とする金利スワップ取引（当該取引のうち、前aに掲げる取引に該当するものを除く。） 3日以上3,666日以内

c (略)

(10)～(15) (略)

(リスク量大きい場合における当初証拠金所要額の引上げ)

第23条 (略)

2 業務方法書第29条第2項の当初証拠金所要

額の引上げ措置は、前項の規定により算出した P V O 1 の水準が同項の規定により定める水準を超過した額に、基準ベースポイント（P V O 1 の水準に応じた金利変動のリスクとして当社が通知により定める数値をいう。）を乗じた額に、当社が前項の規定により定める区分ごとの金利変動のリスクの相関関係を当社が公示により定める方法により反映した額を当初証拠金所要額割増額とする方法により行うものとする。

（債務負担等の申込方法等）

第 27 条 （略）

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 9 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。

3 前項の規定にかかわらず、バックロード取引に係る債務負担の申込みが行われた場合には、当社は、当該申込みに係る通知を、当該申込みが行われた日の翌当社営業日の午前 8 時までに受領するものとする。

（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、次の各号に掲げる債務負担の申込みの区分に応じて、当該各号に定めるところにより行うものとする。

（1）バックロード取引に係る債務負担の申込み

当該債務負担の申込みを受領した日の午前 8 時までに行う。

（2）バックロード取引以外の取引に係る債務負担の申込み

債務負担の申込みを受領した後速やかに行

額の引上げ措置は、前項の規定により算出した P V O 1 の水準が同項の規定により定める水準を超過した額に、基準ベースポイント（P V O 1 の水準に応じた金利変動のリスクとして当社が通知により定める数値をいう。）を乗じた額を当初証拠金所要額割増額とする方法により行うものとする。

（債務負担等の申込方法等）

第 27 条 （略）

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。

（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、当社が債務負担の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>う。</p> <p>3 業務方法書第49条第1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債務負担要件の充足を確認（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。</p> <p>4 (略)</p> <p>5 業務方法書第49条第2項及び第3項に規定する当社の通知は、C F T C R e g u l a t i o n 3 9 . 1 2 (b) (7) (i i) 及び (i i i) 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>6 前項の規定にかかわらず、当社は、当社が前条第3項の規定に従い受領した債務負担の申込みに関する業務方法書第49条第2項及び第3項に規定する当社の通知を、当該債務負担の申込みに係る通知を受領した日の午前8時5分以降速やかに行う。</p> <p>7 (略)</p>	<p>3 業務方法書第49条第1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債務負担要件の確認（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。</p> <p>4 (略)</p> <p>5 業務方法書第49条第2項及び第3項に規定する当社の通知は、C F T C R e g u l a t i o n 3 9 . 1 2 (b) (7) (i i) 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>(新設)</p> <p>6 (略)</p>
<p>(清算約定の任意解約の申込みの方法等)</p> <p>第30条 (略)</p> <p>2 当社は、業務方法書第53条第1項に規定する通知の受領を、当社営業日の午前9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。</p> <p>3 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の翌当社営業日以降であることとする。</p> <p>4 当社は、業務方法書第53条第2項の規定による任意解約要件の確認を、当社が任意解約の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>(清算約定の任意解約の申込みの方法等)</p> <p>第30条 (略)</p> <p>(新設)</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

<p>5 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<u>行った時点</u>とする。</p>	<p>4 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<u>行う日の午前11時</u>とする。</p>
<p>6 <u>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、任意解約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。</u></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>(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る。</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る。</p>
<p>(1) 期限前終了手数料の額は、当該各清算約定について<u>当該終了の日</u>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。）に<u>当該終了の日の翌当社営業日に授受すべき変動証拠金に係る利息を加減した額</u>と同額とし、<u>当該額</u>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、<u>当該額</u>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。</p>	<p>(1) 期限前終了手数料の額は、当該各清算約定について<u>当該終了の日の前当社営業日</u>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、<u>差引累計額</u>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、<u>差引累計額</u>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。</p>
<p>(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。<u>以下</u></p>	<p>(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</p>

同じ。)の終了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に当該終了の日の翌当社営業日に授受すべき変動証拠金に係る利息を加減した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、当該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、業務方法書第58条の3第4項第3号の規定に従い、前項の規定により算出した承継時支払金額及び期限前終了手数料を、対象清算約定の終了の日の翌当社営業日に変動証拠金等と差引計算して授受を行う。

(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ロード・カーブに基づいて当該当社営業日の午後4時の時点(業務方法書第58条の3第1項又は同第58条の5第1項の規定に従い当社が清算参加者からの承継又は移管の申込みを承諾したときは、当該承諾の時点)における清算約定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ロード・カーブに基づいて当該算出日の午後4時の時点(業務方法書第58条の3第1項又は同第58条の5第1項の規定に従い当社が清算参加者からの承継又は移管の申込みを承諾したときは、当該承諾の時点)における各清算約定について

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。)

(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ロード・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ロード・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。

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)

付 則

1 この改正規定は、平成26年11月4日から施行する。

2 前項の規定にかかわらず、改正後の第9条第5号c及び同条第9号aの規定は、当社が定める日から施行する。

別表2 当初証拠金所要額の算出方法

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(業務方法書第58条の3第1項又は同第58条の5第1項の規定に従い当社が承継又は移管の申込みを承諾したときは、当該承諾の時点)における清算約定の同日午後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、次の(a)及び(b)に規定する変動額のうち、当該変動額が負の数となるものについてその絶対値が大きい順に上位12位までの値の平均値として算出される額をいう。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。

(a) 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

(b) ストレスイベントシナリオ想定変動

2 (略)

別表2 当初証拠金所要額の算出方法

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。

イールド・カーブにより算出した正味現在価値の変動額のうち、当社が公示により定める額

b 前 a (a) に規定する「想定変動イールド・カーブ」とは、算出日から起算して過去 1, 250 当社営業日における日々の清算イールド・カーブの作成に利用した金利スワップ取引等の気配値の 5 日間の変動率と同じ率の変動が、算出日の清算イールド・カーブの作成に利用する金利スワップ取引等の気配値に生じた場合における当該気配値を基に作成したイールド・カーブをいう。なお、過去の変動率については、当社が公示により定める方法により一定の調整を行う。

c 上記 a (b) に規定する「ストレスイベントシナリオ想定変動イールド・カーブ」とは、当社が公示により定める期間における日々の清算イールド・カーブの作成に利用した金利スワップ取引等の気配値の 5 日間の変動率と同じ率の変動が、算出日の清算イールド・カーブの作成に利用する金利スワップ取引等の気配値に生じた場合における当該気配値を基に作成したイールド・カーブをいう。

(2) (略)

(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」といい、本号におけるストレスイベントシナリオ

b 前 a に規定する「想定変動イールド・カーブ」とは、計算日から起算して過去 1, 250 当社営業日における日々の清算イールド・カーブの作成に利用した金利スワップ取引等の気配値の 5 日間の変動率と同じ率の変動が、計算日の清算イールド・カーブの作成に利用する金利スワップ取引等の気配値に生じた場合における当該気配値を基に作成したイールド・カーブをいう。なお、過去の変動率については、当社が公示により定める方法により一定の調整を行う。

(新設)

(2) (略)

(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。）。

想定変動イールド・カーブを「ストレスイベントシナリオ特別想定変動イールド・カーブ」という。)。

(4) (略)

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 (略)

b 前 a に規定する「当初証拠金相当額」とは、前 a の算出日の午前 1 1 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、次の (a) 及び (b) に規定する変動額のうち、当該変動額が負の数となるものについてその絶対値が大きい順に上位 1 2 位までの値の平均値として算出される額をいう。

(a) 前項第 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変動額

(b) 前項第 1 号 c に定めるストレスイベントシナリオ想定変動イールド・カーブにより算出した変動額のうち、当社が公示により定める額

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 1 1 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) (略)

(3) 清算約定（委託分）（業務方法書第 9 4

(4) (略)

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 (略)

b 前 a に規定する「当初証拠金相当額」とは、前 a の清算約定の算出日のその日の午前 1 1 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、前項第 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、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 5 3 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 1 1 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) (略)

(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、「ストレスイベントシナリオ想定変動イールド・カーブ」とあるのは、「前項第3号に定めるストレスイベントシナリオ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) (略)

3 債務負担時所要証拠金

(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又は同第53条第1項に規定する任意解約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又は清算約定を加減し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に、未決済金額を加算した額とする。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の債務負担又は任意解約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9時か

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) (略)

3 債務負担時所要証拠金

(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

ら正午までの間に債務負担若しくは任意解約の申込みを受領した場合又は第27条第3項に規定する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、次の(a)及び(b)に規定する変動額のうち、当該変動額が負の数となるものについてその絶対値が大きい順に上位12位までの値の平均値として算出される額をいう。

(a) 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変動額

(b) 第1項第1号cに定めるストレスイベントシナリオ想定変動イールド・カーブにより算出した変動額のうち、当社が公示により定める額

c 上記aに規定する「変動証拠金相当額」とは、申込受領日の前当社営業日の午後4時時点(業務方法書第58条の3第1項又は同第58条の5第1項の規定に従い当社が承継又は移管の申込みを承諾したときは、当該承諾の時点)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9時から正午までの間に債務負担若しくは任意解約の申込みを受領した場合又は第27条第3項に規定する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) (略)

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) (略)

(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、「ストレスイベントシナリオ想定変動イールド・カーブ」とあるのは、「前項第3号に定めるストレスイベントシナリオ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) (略)

様式第3号 清算受託契約の様式

金利スワップ清算受託契約書

(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)～(8) (略)

(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清算参加者をいう。

(10) (略)

(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

(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) (略)

様式第3号 清算受託契約の様式

金利スワップ清算受託契約書

(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)～(8) (略)

(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) (略)

(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

<p>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。<u>ただし、業務方法書第66条第3項の規定により当該委託清算約定に係る債務負担時所要証拠金の額が当初証拠金所要額とみなされた場合は、この限りでない。</u></p>	<p>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。</p>
<p>3 (略)</p>	<p>3 (略)</p>
<p>(当初証拠金の預託時限)</p>	<p>(当初証拠金の預託時限)</p>
<p>第13条 (略)</p>	<p>第13条 (略)</p>
<p>2 <u>前項の規定にかかわらず、当初証拠金預託額が、クリアリング機構が債務負担又は任意解約の申込みを受領することに伴い算出した債務負担時所要証拠金の額(第26条の3第1項第1号の規定により差引計算した結果負数である場合の当該負数の額の絶対値を控除した額とする。以下本項において同じ。)以上となった場合には、債務負担時所要証拠金の額を当初証拠金預託必要額(当初証拠金について甲乙間に別段の合意がない場合に限る。)とみなす。</u></p>	<p>(新設)</p>
<p>(日中証拠金の預託義務)</p>	<p>(日中証拠金の預託義務)</p>
<p>第14条 (略)</p>	<p>第14条 (略)</p>
<p>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。<u>ただし、業務方法書第70条第3項の規定により当該委託清算約定に係る債務負担時所要証拠金の額が日中証拠金所要額とみなされた場合は、この限りでない。</u></p>	<p>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。</p>
<p>(日中証拠金の預託時限)</p>	<p>(日中証拠金の預託時限)</p>
<p>第15条 (略)</p>	<p>第15条 (略)</p>
<p>2 当初証拠金等預託額が、クリアリング機構が</p>	<p>2 当初証拠金等預託額が、クリアリング機構の</p>

債務負担又は任意解約の申込みを受領することに伴い算出した債務負担時所要証拠金の額以上となった場合には、債務負担時所要証拠金の額を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。）とみなす。

（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）（当初証拠金等預託額のうち金銭による預託額）－（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）（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。））－（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。

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。

（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J S C C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J S C C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。

(当初証拠金等預託額+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)
一 (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 第26条の2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。

2 前項の申請がなされていない場合、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。

(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 (略)

2 (略)

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に伴い授受することとなる委託清算約定に係る当初証拠金及び変動証拠金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・5 (略)

(前J S C C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J S C C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。

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。

(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 (略)

2 (略)

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・5 (略)

<p>(他の清算参加者からの清算委託取引等の承継)</p> <p>第28条の4 (略)</p> <p>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、<u>承継を希望するJSCC営業日の午後1時まで</u>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。</p> <p>3 (略)</p> <p>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(<u>承継元清算参加者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。</u>)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。</p>	<p>(他の清算参加者からの清算委託取引等の承継)</p> <p>第28条の4 (略)</p> <p>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、<u>承継を希望する日の前JSCC営業日の午後1時まで</u>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。</p> <p>3 (略)</p> <p>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(<u>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。</u>)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。</p>
---	---