外貨建て金利スワップ取引の取扱い開始等に伴う
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

当社の金利スワップ取引清算業務について、円以外の通貨の金利スワップ取引（以下「外貨建て金利スワップ取引」という。）を清算対象取引として追加するとともに、円金利スワップ取引と国債先物清算約定のリスク相殺を可能とするクロスマージン制度及び原取引の相手方の同意を得ることなく満期到来前に取引を終了させる取引毎コンプレッション制度の導入により昨今の規制環境を踏まえた清算参加者の担保・資本効率の向上に寄与するなど、海外清算機関との競争を見据えたサービスの改善・拡大を行うべく、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、証券取引等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、所要の改正を行う。

また、ＣＤＳ清算業務について、ＣＤＳ取引における変動証拠金の利息を日次決済に変更することに伴い、ＣＤＳ清算業務に関する業務方法書等について、別紙３のとおり所要の改正を行う。

Ⅱ．改正概要	（備　考）
１．金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書等	
（１）外貨建て金利スワップ取引等の取扱い	
①清算対象取引の追加	
・変動金利がＵＳＤ-ＬＩＢＯＲ-ＢＢＡ（金利計算期間が１か月、３か月又は６か月であるもの。）の米ドル建て金利スワップ取引、変動金利がＥＵＲ－ＥＵＲＩＢＯＲ－Ｔｅｌｅｒａｔｅ又はＥＵＲ－ＥＵＲＩＢＯＲ－Ｒｅｕｔｅｒｓ（金利計算期間が３か月又は６か月であるもの。）のユーロ建て金利スワップ取引及び変動金利がＡＵＤ-ＢＢＲ-ＢＢＳＷ（金利計算期間が３か月又は６か月であるもの。）の豪ドル建て金利スワップ取引を清算対象取引として追加する。	・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（以下「ＩＲＳ業務方法書の取扱い」という。）第９条等
・変動金利がＪＰＹ-ＬＩＢＯＲ-ＢＢＡ、ＪＰＹ-ＴＩＢＯＲ-ＺＴＩＢＯＲ又はＪＰＹ-ＴＩＢＯＲ-１７０９７の円建て金利スワップ取引について、金利計算期間が１か月であるものを清算対象取引として追加する。	
②外貨建て金利スワップ取引に関する届出	
・清算参加者が外貨建て金利スワップ取引について債務負担の申込みを行おうとする場合は、あらかじめ当社に対して当該申込みを行おうとする金利スワップ取引の通貨の種類について届出を行う。	・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２７条の６
③変動証拠金等に関する取扱い	
・変動証拠金、変動証拠金の利息、クーポン及びアップフロ	・ＩＲＳ業務方法書第７７

ントフィー（以下「変動証拠金等」という。）については、清算約定の想定元本及び決済通貨の種類ごとに算出し、当該通貨の種類ごとに決済を行う。	条、第８３条等
・外貨により授受する変動証拠金及びその利息の預託時限は、当該変動証拠金及びその利息の算出日の後最初に到来する当社営業日かつ外貨本国営業日（豪ドルはシドニー営業日を、米ドルはニューヨーク営業日を、ユーロはＴａｒｇｅｔ営業日をいう。以下同じ。）の午前１１時とする。	・ＩＲＳ業務方法書第８１条等
・外貨により授受するクーポン及びアップフロントフィーは、外貨本国営業日に、豪ドルはシドニー、米ドルはニューヨーク、ユーロはロンドンにおいて、それぞれ当社と清算参加者の間で授受を行う。	・ＩＲＳ業務方法書第８５条の４等
・変動証拠金等の授受は、当社が指定する資金決済銀行に開設する当社名義の口座を通じて行う。	・ＩＲＳ業務方法書第８５条の４等
・外貨により授受する変動証拠金等の支払方参加者が決済時限までに決済を行うことができなかった場合、それが当該清算参加者の信用力悪化に起因するものではないことを当社が確認できたときは、当該決済に係る時限を繰り延べる。	・ＩＲＳ業務方法書第８５条の５等
④外貨のポジションを有する清算参加者の破綻処理	
・外貨のポジションを有する清算参加者が破綻した場合には、損失回避取引、破綻処理入札及び損失の補填等の破綻処理は、通貨の種類ごとに行う。それに伴い、損失補填財源も通貨の種類ごとに配分したうえで各通貨の損失に充当する。	・ＩＲＳ業務方法書第９５条、第９５条の２、第１０１条、第１０２条、第１０３条、第１０５条、第１０６条等
・各通貨に配分した損失補填財源に余剰が生じた場合には、当該余剰を他の通貨に係る損失補填財源として再配分する。	・ＩＲＳ業務方法書第１０２条の２、第１０３条の２、第１０５条の２等
・外貨建ての金利スワップ取引に係る助言を行う破綻管理委員会委員として、外貨建金利スワップ取引のポジションを有する委員のうち２社を指定する。	・金利スワップ破綻管理委員会規則第６条の３、第６条の４等
（２）クロスマージン制度の導入	
①クロスマージンに関する届出	
・清算参加者は、清算参加者又はそのアフィリエイト（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をいう。）がクロスマージン制度を利用しようとする場合には、あらかじめ当社に対して届出を行う。	・ＩＲＳ業務方法書第８４条の２等
②クロスマージンの承諾及び効力の発生	

・クロスマージン承諾者（クロスマージンの申請に対する諾否を行う清算参加者をいう。以下同じ。）が、クロスマージン申請者（クロスマージンの申請を行う国債先物等清算参加者をいう。以下同じ。）より行われた申請に対して承諾の通知を行い、クロスマージン対象の国債先物清算約定の建玉を含めて算出した証拠金所要額を充足した時点で、クロスマージンの効力が発生する。	・ＩＲＳ業務方法書第８４条の４等
③クロスマージン対象国債先物清算約定に係る債権債務の発生	
・クロスマージン利用者の破綻を認定した場合には、破綻後のクロスマージン対象の国債先物清算約定に係る損益を金利スワップ清算制度で処理するため、当社とクロスマージン申請者の間のクロスマージン対象国債先物清算約定に係る履行期が未到来の債権債務が消滅すると同時に、当社と金利スワップ清算参加者の間に当該債権債務と同一内容の債権債務が成立する。	・ＩＲＳ業務方法書第８４条の５等
④クロスマージン利用者の破綻処理	
・クロスマージン対象の国債先物清算約定を処分することによるリスク量の変化を抑えるため、金利スワップ取引によるヘッジ取引を実行する。 ・当該金利スワップ取引は、破綻処理入札の対象に含める。	・ＩＲＳ業務方法書第９３条の２等
⑤当初証拠金所要額の算出	
・クロスマージン利用者の当初証拠金所要額は、クロスマージン対象の国債先物清算約定を含むポジションについて、期待ショートフォールの方式により算出する。	・ＩＲＳ業務方法書の取扱い別表２等
（３）取引毎コンプレッション制度の導入等	
・任意解約制度を廃止し、原取引の相手方の同意を得ることなく満期到来前に清算約定の解約を可能とする取引毎コンプレッション制度を導入する。	・ＩＲＳ業務方法書第５３条等
・併せて、ＴｒｉＯｐｔｉｍａ社が提供するサービスを使用した一括コンプレッションについても、原取引の相手方からの申込みを不要とする。	・ＩＲＳ業務方法書第５３条の２等
（４）手数料	
・外貨建金利スワップ取引に係る手数料として、外貨建金利スワップ取引の債務負担に応じた清算手数料及び外貨建金利スワップ取引における変動証拠金等の決済に伴う外貨決済	・金利スワップ取引清算業務に係る手数料に関する規則（以下「手数料規

手数料を設定する。	則」という。）第４条の２、第５条の５等
・ＪＰＹ-ＬＩＢＯＲ-ＢＢＡ及びＵＳＤ-ＬＩＢＯＲ-ＢＢＡに係るＬＩＢＯＲライセンス手数料を設定する。	・ 手数料規則第５条の７等
（５）その他	
・その他、所要の改正を行う。	
２．証券取引等清算業務に関する業務方法書等	
（１）クロスマージン制度の導入	
・国債先物等清算参加者は、クロスマージンの申請を行うことを可能とする。	・ 業務方法書第７３条の１５の２、第７３条の１５の３等
・クロスマージン利用者の破綻等があった場合には、当社とクロスマージン申請者の間のクロスマージン対象国債先物清算約定に係る履行期が未到来の債権債務が消滅し、当該消滅した債権債務に係る損益は金利スワップ清算制度において処理する。	・ 業務方法書第７３条の１５の４等
（２）その他	
・その他、所要の改正を行う。	
３．ＣＤＳ清算業務に関する業務方法書等	
（１）変動証拠金の利息の決済の日次化	
・変動証拠金の利息について、日次で決済を行う。	・ ＣＤＳ清算業務に関する業務方法書第７８条、第８０条の２等
（２）その他	
・その他、所要の改正を行う。	

Ⅲ．施行日

２０１５年９月２４日から施行する。ただし、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社が設置するシステムの稼働に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、２０１５年９月２４日以後の当社が定める日から施行する。

（注）「金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書」、「証券取引等清算業務に関する業務方法書」及び「ＣＤＳ清算業務に関する業務方法書」の一部改正については、関係当局の認可を受けることを条件とする。

以　上

別紙

外貨建て金利スワップ取引の取扱い開始等に伴う

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

目　　次

(ページ)

＜別紙１＞

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	３
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	６３
３	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	１２７
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	１４５
５	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	１４７
６	金利スワップ破綻管理委員会規則の一部改正新旧対照表	１７８
７	金利スワップ運営委員会に関する規則の一部改正新旧対照表	１８４

＜別紙２＞

１	業務方法書の一部改正新旧対照表	１８５
２	先物・オプション取引に係る取引証拠金等に関する規則の一部改正新旧対照表	１９５
３	清算基金所要額に関する規則の一部改正新旧対照表	１９７
４	業務方法書の取扱いの一部改正新旧対照表	２００

＜別紙３＞

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　２０５

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　２０７

別紙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

新	旧
（目的） 第１条　この金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書（以下「本業務方法書」という。）は、株式会社日本証券クリアリング機構（以下「当社」という。）が行う金融商品債務引受業等及びこれに附帯する業務のうち金利スワップ取引を対象取引とするもの（以下「金利スワップ取引清算業務」という。）に関して必要な事項（次に掲げる事項を含む。）を定めることを目的とする。 （１）～（４）　（略） （４）の２　クロスマージン制度に関して、当社、清算参加者及び清算委託者の間で必要となる事項 （５）　（略）	（目的） 第１条　この金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書（以下「本業務方法書」という。）は、株式会社日本証券クリアリング機構（以下「当社」という。）が行う金融商品債務引受業等及びこれに附帯する業務のうち金利スワップ取引を対象取引とするもの（以下「金利スワップ取引清算業務」という。）に関して必要な事項（次に掲げる事項を含む。）を定めることを目的とする。 （１）～（４）　（略） （新設） （５）　（略）
（定義） 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。 （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（日本円に限る。）又は代用有価証券を第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代用有価証券をいう。 （２）　（略） （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、当社が定める	（定義） 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。 （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代用有価証券を第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代用有価証券をいう。 （２）　（略） （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

方法により、複数の清算参加者の清算約定について一括してコンプレッションを行うことをいう。	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。
（２）の３　「円貨建清算約定」とは、清算約定のうち、想定元本及び決済通貨が日本円建てであるものをいう。	（新設）
（３）・（４）　（略）	（３）・（４）　（略）
（４）の２　「解約手数料」とは、一括コンプレッションにより清算約定がその終了日前に終了した場合において、当社と当該清算約定の当事者である清算参加者との間で授受される金銭をいう。	（新設）
（４）の３　「外貨建清算約定」とは、清算約定のうち、想定元本及び決済通貨が日本円建て以外のものをいう。	（新設）
（４）の４　「外貨本国営業日」とは、豪ドル建清算約定についてはシドニー営業日を、米ドル建清算約定についてはニューヨーク営業日を、ユーロ建清算約定についてはＴａｒｇｅｔ営業日をいう。	（新設）
（４）の５　「外貨本国休業日」とは、外貨本国営業日以外の日をいう。	（新設）
（５）　（略）	（５）　（略）
（６）　「期限前終了」とは、コンプレッション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。	（６）　「期限前終了」とは、任意解約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。
（７）～（９）　（略）	（７）～（９）　（略）
（９）の２　「金銭」とは、日本円、オーストラリア・ドル、米ドル及びユーロをいう。	（新設）
（１０）～（１３）の２　（略）	（１０）～（１３）の２　（略）
（１３）の３　「クロスマージン承諾者」とは、第８４条の４第２項の規定に従い、当社に対して、証券取引等業務方法書に定めるところにより当社に対して行われた国債証券先物取引の建玉をクロスマージン制度の対象とする	（新設）

ための申請（以下「クロスマージンの申請」という。）に対する諾否の通知を行う清算参加者をいう。	
（１３）の４　「クロスマージン申請者」とは、当社に対して、クロスマージンの申請を行う国債先物等清算参加者をいう。	（新設）
（１３）の５　「クロスマージン制度」とは、国債証券先物取引のうち当社が定めるものに係る建玉について、本業務方法書等の定めるところにより、当初証拠金所要額を算出する制度をいう。	（新設）
（１３）の６　「クロスマージン対象国債先物清算約定」とは、国債先物清算約定のうち、第８４条の４第３項の規定により自己取引口座又は委託取引口座に建玉が記録されているものをいう。	（新設）
（１３）の７　「クロスマージンの承諾」とは、第８４条の４第２項の規定に従い、クロスマージンの申請に対して承諾の通知を行うことをいう。	（新設）
（１３）の８　「クロスマージン利用者」とは、清算参加者又は清算委託者（受託清算参加者と同一の企業集団に含まれる者に限る。）のうち、次のａからｄまでのいずれかに該当し、かつ、自らの計算による国債証券先物取引の建玉についてクロスマージン制度を利用する者であって、当社に対して第８４条の２に規定する届出が行われた者　をいう。 ａ　国債先物等清算参加者 ｂ　自らと同一の企業集団に含まれる国債先物等清算参加者に対して国債証券先物取引を委託した顧客 ｃ　国債先物等非清算参加者（有価証券等清算取次ぎの委託をした国債証券先物取引の決済が、自らと同一の企業集団に含まれる国債先物等清算参加者によって行われる者	（新設）

に限る。） ｄ　自らと同一の企業集団に含まれる国債先物等非清算参加者に対して国債証券先物取引を委託した顧客（委託をした国債証券先物取引の決済が、自らと同一の企業集団に含まれる国債先物等清算参加者によって行われる者に限る。）	
（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、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８５条第２項又は第８５条の４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。	（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、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）　（略）	（１５）　（略）
（１５）の２　「豪ドル建清算約定」とは、清算約定のうち、想定元本及び決済通貨がオーストラリア・ドル建てのものをいう。	（新設）
（１５）の３　「国債先物等清算参加者」とは、証券取引等業務方法書第５条第３項に規定する国債先物等清算参加者をいう。	（新設）
（１５）の４　「国債先物等非清算参加者」とは、証券取引等業務方法書第７３条の６第２項に規定する国債先物等非清算参加者をいう。	（新設）
（１５）の５　「国債先物清算約定」とは、国債証券先物取引に係る清算約定（証券取引等業務方法書第７条第１項第３号に規定する清算約定をいう。）をいう。	（新設）
（１５）の６　「国債証券先物取引」とは、証券取引等業務方法書第３条第２項第３号に規定する国債証券先物取引をいう。	（新設）
（１６）・（１７）　（略）	（１６）・（１７）　（略）
（１８）　「固定的損失補填財源」とは、本業務方法書等の規定に従い破綻処理清算約定の	（１８）　「固定的損失補填財源」とは、第一階層金利スワップ決済保証準備金、第二階層

通貨の種類ごとに按分された第一階層金利スワップ決済保証準備金、第二階層金利スワップ決済保証準備金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金利スワップ清算基金（第二階層清算参加者負担限度額を上限とする。）をいう。	金利スワップ決済保証準備金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金利スワップ清算基金（第二階層清算参加者負担限度額を上限とする。）をいう。
（１８）の２　「コンプレッション」とは、清算約定をその終了日前に終了させるとともに、新たな清算約定を成立させることをいう。	（新設）
（１９）～（２３）　（略）	（１９）～（２３）　（略）
（２３）の２　「指定市場開設者」とは、証券取引等業務方法書第３条第２項第１号に規定する指定市場開設者のうち当社が定める者をいう。	（新設）
（２３）の３　「シドニー営業日」とは、シドニーにおいて銀行が営業しており、かつオーストラリア・ドルの資金決済が行われている日をいう。	（新設）
（２４）～（２４）の３　（略）	（２４）～（２４）の３　（略）
（２４）の４　「証券取引等業務方法書」とは、当社が証券取引等清算業務に関して定める業務方法書をいう。	（新設）
（２５）～（４０）　（略）	（２５）～（４０）　（略）
（４１）　「第三階層特別清算料」とは、第１０５条の規定により清算参加者から当社に支払われる金銭（日本円に限る。）をいう。	（４１）　「第三階層特別清算料」とは、第１０５条の規定により清算参加者から当社に支払われる金銭をいう。
（４２）　「第三階層特別清算料担保金」とは、第１０７条第１項第１号に掲げる目的で、当該清算参加者が当社に預託する金銭（日本円に限る。）をいう。	（４２）　「第三階層特別清算料担保金」とは、第１０７条第１項第１号に掲げる目的で、当該清算参加者が当社に預託する金銭をいう。
（４３）～（４５）　（略）	（４３）～（４５）　（略）
（４５）の２　「建玉」とは、証券取引等業務方法書第４５条の２第２項に規定する建玉をいう。	（新設）
（４６）～（４９）　（略）	（４６）～（４９）　（略）
（５０）　「当初証拠金」とは、第６１条第１	（５０）　「当初証拠金」とは、第６１条第１

項第１号に掲げる債務を担保する目的で清算参加者又は清算委託者が当社に預託する金銭（日本円に限る。）又は代用有価証券をいう。	項第１号に掲げる債務を担保する目的で清算参加者又は清算委託者が当社に預託する金銭又は代用有価証券をいう。
（５１）・（５２）　（略）	（５１）・（５２）　（略）
（５２）の２　「取引毎コンプレッション」とは、第５３条の規定に基づき、当社が定める方法により、コンプレッションを行うことをいう。	（新設）
（５３）・（５４）　（略）	（５３）・（５４）　（略）
（５４）の２　「ニューヨーク営業日」とは、ニューヨークにおいて銀行が営業しており、かつ米ドルの資金決済が行われている日をいう。	（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　削除	（５４）の３　「任意解約手数料」とは、清算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　（略）	（５４）の４　（略）
（５５）　「破綻時証拠金」とは、第１０８条第１項に定める債務を担保する目的で清算参加者が当社に預託する金銭（日本円に限る。）又は代用有価証券をいう。	（５５）　「破綻時証拠金」とは、第１０８条第１項に定める債務を担保する目的で清算参加者が当社に預託する金銭又は代用有価証券をいう。
（５６）～（５８）　（略）	（５６）～（５８）　（略）
（５９）　「破綻等」とは、次に掲げるいずれかの事由をいう。	（５９）　「破綻等」とは、次に掲げるいずれかの事由をいう。
ａ～ｆ　（略）	ａ～ｆ　（略）
ｇ　国債証券先物取引の委託に関して指定市場開設者が定める先物・オプション取引口座設定約諾書の定めるところにより、又は有価証券等清算取次ぎの委託に関して証券取引等業務方法書第３９条の規定に従い締結された国債先物等清算受託契約書の定めるところにより、当然に期限の利益を喪失	（新設）

したこと（その清算参加者口座にクロスマージン対象国債先物清算約定が記録されている清算参加者（国債先物等清算参加者である者を除く。）に限る）。	
（６０）・（６０）の２　（略）	（６０）・（６０）の２　（略）
（６１）　削除	（６１）　「反対清算約定」とは、ある清算参加者を当事者とする一の清算約定との関係において、当該清算約定の基となった適格金利スワップ取引の相手方であった他の清算参加者と当社との間の清算約定であって、当該適格金利スワップ取引を基とするもの（本業務方法書等の定めるところにより当社が清算約定を指定した場合には、当該指定に係る清算約定）をいう。
（６２）　（略）	（６２）　（略）
（６２）の２　「米ドル建清算約定」とは、清算約定のうち、想定元本及び決済通貨が米ドル建てのものをいう。	（新設）
（６２）の３　「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。	（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）～（６５）　（略）	（６３）～（６５）　（略）
（６６）　「流動的損失補填財源」とは、本業務方法書等の規定に従い破綻処理清算約定の通貨の種類ごとに按分された第三階層特別清算料及び第四階層特別清算料をいう。	（６６）　「流動的損失補填財源」とは、第三階層特別清算料及び第四階層特別清算料をいう。
（６７）・（６８）　（略）	（６７）・（６８）　（略）
（６８）の２　「ユーロ建清算約定」とは、清算約定のうち、想定元本及び決済通貨がユーロ建てのものをいう。	（新設）
（６９）～（７２）　（略）	（６９）～（７２）　（略）
（７３）　「Ｔａｒｇｅｔ営業日」とは、ユーロの資金決済システムであるｔｈｅ　Ｔｒａｎｓ－Ｅｕｒｏｐｅａｎ　Ａｕｔｏｍａｔｅｄ　Ｒｅａｌ－Ｔｉｍｅ　Ｇｒｏｓｓ　Ｓｅｔｔｌｅｍｅｎｔ　Ｅｘｐｒｅｓｓ　Ｔｒａ	（新設）

ｎｓｆｅｒ　Ｓｙｓｔｅｍが稼働しており、かつユーロの資金決済が行われている日をいう。	
２・３　（略）	２・３　（略）
（金利スワップ清算基金の預託） 第１７条　清算参加者は、当該清算参加者の当社に対する金利スワップ取引清算業務に係る一切の債務（当社が他の清算参加者の破綻等を認定した場合において、当社に生じた損失を補填するために当該清算参加者が負担する債務及び第８４条の５第１項の規定により当社と清算参加者との間に成立した債権債務について生じる損失を含む。）を担保する目的で、当社が定めるところにより、金利スワップ清算基金を当社に預託しなければならない。	（金利スワップ清算基金の預託） 第１７条　清算参加者は、当該清算参加者の当社に対する金利スワップ取引清算業務に係る一切の債務（当社が他の清算参加者の破綻等を認定した場合において、当社に生じた損失を補填するために当該清算参加者が負担する債務を含む。）を担保する目的で、当社が定めるところにより、金利スワップ清算基金を当社に預託しなければならない。
２・３　（略）	２・３　（略）
４　当社は、本業務方法書等の定めるところにより、金利スワップ清算基金（金銭を異なる通貨へ両替した際に要した費用及び代用有価証券の換価処分に要した費用を控除した残額）を第１項に規定する債務の弁済に充当することができる。	４　当社は、本業務方法書等の定めるところにより、金利スワップ清算基金（金利スワップ清算基金が代用有価証券である場合には、その換価処分後の金銭から当該換価処分に要した費用を控除した残額）を第１項に規定する債務の弁済に充当することができる。
５・６　（略）	５・６　（略）
第５節の２　日本円建て以外の通貨の適格金利スワップ取引に関する届出	（新設）
（日本円建て以外の通貨の適格金利スワップ取引に関する届出） 第２７条の６　清算参加者が、想定元本及び決済通貨が日本円建て以外である適格金利スワップ取引について初めて債務負担の申込みを行おうとする場合には、あらかじめ、当該債務負担の申込みを行おうとする適格金利スワップ取引の想定元本及び決済通貨に係る通貨の種類を当社	（新設）

に届け出なければならない。	
（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、当該清算参加者によるクロスマージンの承諾の停止（以下「クロスマージンの停止」という。）、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。	（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）～（４）　（略）	（１）～（４）　（略）
２～７　（略）	２～７　（略）
（個別の取引口座に係るリスクの制限） 第２９条の２　当社は、清算参加者の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が、当該清算参加者の自己資本額（清算参加者が親会社等保証を受けている場合には、親会社等保証を行っている親会社等の自己資本額（当	（個別の取引口座に係るリスクの制限） 第２９条の２　当社は、清算参加者の自己取引口座又は委託取引口座ごとの当初所要金所要額が、当該清算参加者の自己資本額（清算参加者が親会社等保証を受けている場合には、親会社等保証を行っている親会社等の自己資本額（当

該親会社等が金融商品取引業者又は登録金融機関でない場合には、これに相当する額）。以下本条及び次条において同じ。）の５０パーセントを超えた場合には、当該清算参加者に対し、当社が定めるところにより当初証拠金所要額の引上げ措置を行うことができる。	該親会社等が金融商品取引業者又は登録金融機関でない場合には、これに相当する額）。以下本条及び次条において同じ。）の５０パーセントを超えた場合には、当該清算参加者に対し、当社が定めるところにより当初証拠金所要額の引上げ措置を行うことができる。
２　当社は、清算参加者の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が、当該清算参加者の自己資本額の１００パーセントを超えた場合には、当該清算参加者を審問のうえ、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引のうち当該超過した口座に係るもの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とともに、取締役会の決議による当該口座を対象としたポジション保有状況の改善指示の措置を行うことができる。	２　当社は、清算参加者の自己取引口座又は委託取引口座ごとの当初所要金所要額が、当該清算参加者の自己資本額の１００パーセントを超えた場合には、当該清算参加者を審問のうえ、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引のうち当該超過した口座に係るもの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とともに、取締役会の決議による当該口座を対象としたポジション保有状況の改善指示の措置を行うことができる。
３　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、ポジション保有状況を改善することを目的として、資本充実その他具体的な措置（クロスマージン対象国債先物清算約定に係る措置及び清算委託者への必要な限度での措置の要請を含む。）を講じなければならない。	３　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、ポジション保有状況を改善することを目的として、当該清算参加者の清算約定の任意解約又は資本充実その他具体的な措置（清算委託者への必要な限度での措置の要請を含む。）を講じなければならない。
４　（略）	４　（略）
（ポジション保有状況の改善指示）	（ポジション保有状況の改善指示）
第３０条　（略）	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、必要な措置（クロスマージン対象国債先物清算約定に係る措置を含む。）を講じなければならない。	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定の任意解約その他具体的な措置を講じなければならない。
３　（略）	３　（略）
（代用有価証券に係る措置）	（代用有価証券に係る措置）

第３１条　当社は、清算参加者の信用状況に鑑みて、当該清算参加者が当事者である清算約定又は清算委託取引に係る債務及び当社が当該清算参加者の破綻等を認定した場合に当該清算参加者に係るクロスマージン対象国債先物清算約定に関して発生する債務の履行確保の観点から当社が必要と認める場合には、その必要な限度において、代用有価証券の代用価格の計算における時価に乗ずべき率の引下げ措置を行うことができる。	第３１条　当社は、清算参加者の信用状況に鑑みて、当該清算参加者が当事者である清算約定又は清算委託取引に係る債務の履行確保の観点から当社が必要と認める場合には、その必要な限度において、代用有価証券の代用価格の計算における時価に乗ずべき率の引下げ措置を行うことができる。
（債務負担の停止等の措置の解除） 第３４条　当社が第２８条の規定により期間を定めないで新たな債務負担の停止措置又はクロスマージンの停止の措置を行った場合において、当該停止措置の原因となった事由が除去されたときは、当該停止措置を受けた清算参加者は、当社に対して、当社所定の説明のための書面を添付して当該停止措置の解除を申請することができる。	（債務負担の停止等の措置の解除） 第３４条　当社が第２８条の規定により期間を定めないで新たな債務負担の停止措置を行った場合において、当該停止措置の原因となった事由が除去されたときは、当該停止措置を受けた清算参加者は、当社に対して、当社所定の説明のための書面を添付して当該停止措置の解除を申請することができる。
２　（略） ３　第１項の清算参加者が、同項の債務負担の停止措置を受けた日から６か月以内に前項の承認を受けられない場合には、当社は、取締役会の決議により、当該清算参加者の金利スワップ清算資格を取り消すことができる。 ４　（略）	２　（略） ３　第１項の清算参加者が、同項の停止措置を受けた日から６か月以内に前項の承認を受けられない場合には、当社は、取締役会の決議により、当該清算参加者の金利スワップ清算資格を取り消すことができる。 ４　（略）
（異議の申立て等） 第３５条　第１５条第１項ただし書、第２項及び第３項の規定は第２８条及び第２９条の２から第３０条までに規定する審問について、第１５条第４項から第６項までの規定は第２８条から第３２条までの措置について、それぞれ準用する。	（異議の申立て等） 第３５条　第１５条第１項ただし書、第２項及び第３項の規定は第２８条及び第２９条の２から第３０条までに規定する審問について、第１５条第４項から第６項までの規定は第２８条から第３２条までの措置について、それぞれ準用する。

（措置の通知等） 第３７条　当社は、本業務方法書に基づき新たな債務負担の全部若しくは一部の停止を行おうとする場合、クロスマージンの停止を行おうとする場合、金利スワップ清算資格を取り消そうとする場合又はクライアント・クリアリングの取扱いの承認を取り消そうとする場合には、これらの措置を受ける清算参加者に対し、あらかじめその旨を通知する。	（措置の通知等） 第３７条　当社は、本業務方法書に基づき新たな債務負担の全部若しくは一部の停止を行おうとする場合又は金利スワップ清算資格を取り消そうとする場合には、これらの措置を受ける清算参加者に対し、あらかじめその旨を通知する。
２　当社が受託清算参加者に対して新たな債務負担の全部若しくは一部の停止措置を行った場合、クロスマージンの停止を行った場合、受託清算参加者の金利スワップ清算資格を取り消した場合又はクライアント・クリアリングの取扱いの承認を取り消した場合には、当該受託清算参加者は、清算受託契約を締結している清算委託者に対し、直ちにその旨を通知しなければならない。	２　当社が受託清算参加者に対して新たな債務負担の全部若しくは一部の停止措置を行った場合又は受託清算参加者の金利スワップ清算資格を取り消した場合には、当該受託清算参加者は、清算受託契約を締結している清算委託者に対し、直ちにその旨を通知しなければならない。
３　清算参加者は、当社からクロスマージンの停止の措置を受けた場合には、当該清算参加者が第８４条の２の規定によりクロスマージン申請者として当社に届け出た国債先物等清算参加者に対し、直ちにその旨を通知しなければならない。	（新設）
４　当社は、本業務方法書に基づき改善指示、新たな債務負担の全部若しくは一部の停止、クロスマージンの停止、金利スワップ清算資格の取消し、ポジション保有状況の改善指示の措置又はクライアント・クリアリングの取扱いの承認の取消しの措置を清算参加者に対して行った場合には、当該措置を行った日以後速やかに、他の清算参加者に対してその旨を通知し、かつ公表するものとする。ただし、当社は、当該通知及び公表を行った場合における市場への影響度その他の事由を勘案して必要かつ適当と認めるときは、当社が適当と認める日に通知及び公表	３　当社は、本業務方法書に基づき改善指示、新たな債務負担の全部若しくは一部の停止、金利スワップ清算資格の取消し又はポジション保有状況の改善指示の措置を清算参加者に対して行った場合には、当該措置を行った日以後速やかに、他の清算参加者に対してその旨を通知し、かつ公表するものとする。ただし、当社は、当該通知及び公表を行った場合における市場への影響度その他の事由を勘案して必要かつ適当と認めるときは、当社が適当と認める日に通知及び公表を行うことができる。

を行うことができる。	
5　当社は、前項に規定する通知及び公表を行う場合には、当該通知及び公表の対象となる措置の重要性又は当該通知及び公表を行った場合における市場への影響度その他の事由を勘案して、通知及び公表を行う範囲をその都度定めるものとする。	4　当社は、前項に規定する通知及び公表を行う場合には、当該通知及び公表の対象となる措置の重要性又は当該通知及び公表を行った場合における市場への影響度その他の事由を勘案して、通知及び公表を行う範囲をその都度定めるものとする。
（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）	（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）
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（第３３条第１号に掲げる事由に該当し取り消された場合を除く。）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のすべてを解消しなければならない。	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、当該清算参加者の清算約定で未決済のもののすべてを解消しなければならない。
２　（略）	２　（略）
（清算受託契約の締結の届出）	（清算受託契約の締結の届出）
第４４条　（略）	第４４条　（略）
２　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。）には、当該届出に基づき、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。	２　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。）その他当社が適当と認めるときは、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。
（バックアップ受託者の指定等）	（バックアップ受託者の指定等）
第４５条の２　（略）	第４５条の２　（略）
２　（略）	２　（略）
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、当社が定めるところにより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	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

に対して提出することで行うものとする。	うものとする。
４～６　（略）	４～６　（略）
（清算約定の取引毎コンプレッション）	（清算約定の任意解約）
第５３条　清算参加者は、清算約定について取引毎コンプレッション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。	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自己取引口座又は同一の委託取引口座に記録されている複数の清算約定について取引毎コンプレッションの申込みを受けた場合において、当該清算約定及び取引毎コンプレッションにより新たに成立する清算約定について、当社の定める条件（以下「取引毎コンプレッション要件」という。）を当社が定めるところにより確認するものとし、当該清算約定及び取引毎コンプレッションにより新たに成立する清算約定が取引毎コンプレッション要件を充足しているときは、当該確認を行った時点をもって、当社及び当該清算参加者は、当該清算約定を終了させ、当該取引毎コンプレッションの申込みの内容に従い、当社が定めるところにより当該清算約定と当社が定める経済条件を同一とする新たな清算約定を成立させる。	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　前項の規定により終了した清算約定に基づく債権債務（当社が定めるものを除く。）は、将来に向かって消滅する。	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、第２項に規定する取引毎コンプレッション要件の確認を行った時点で、取引毎コンプレッション要件を充足していない取引毎コンプレッションの申込みについては、取引毎コンプレッションを行わないものとする。この場合	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

において、当該取引毎コンプレッションの申込みは、当該取引毎コンプレッション要件の確認を行った日の翌当社営業日の当社が定める時点において、第１項の規定により取引毎コンプレッションの申込みが行われたものとみなす。	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
５　清算参加者は、第１項の規定による取引毎コンプレッションの申込み（前項の規定により取引毎コンプレッションの申込みが行われたとみなされたものを含む。）について、当社が定める方法により、取引毎コンプレッションの申込みを撤回することができる。	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　前各項に規定するほか、清算約定の取引毎コンプレッションに必要な事項は、当社が定める。	６　前各項に規定するほか、清算約定の任意解約に必要な事項は、当社が定める。
（清算約定の一括コンプレッション） 第５３条の２　（略）	（清算約定の一括コンプレッション） 第５３条の２　（略）
２　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ときは、当社が当該確認を行った時点をもって、当社及び当該清算参加者は、当該清算約定を終了させ、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。	２　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

	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　前項の規定により終了した清算約定に基づく債権債務（当社が定めるものを除く。）は、 将来に向かって消滅する。	（新設）
４　当社が、当社が定める時点で第２項に規定する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。	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。
５　（略）	４　（略）
６　第２項の規定により終了した清算約定に係る当事者は、当社が定めるところにより当社との間で解約手数料として金銭を授受するものとする。	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。
７　（略）	６　（略）
（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）	（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　（略）	第５４条　（略）
２　（略）	２　（略）
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。 （１）　第１項の通知が次のいずれかの条件を満たさない場合 ａ　（略） ｂ　当該通知に係る受託清算参加者が、新たな債務負担の全部又は一部の停止措置（当該通知に係る清算委託者の委託に基づき、当該清算委託者の計算で行う清算約定（委託分）をその停止の対象に含むものに限る。）を受けていないこと。 ｃ・ｄ　（略） （２）　（略）	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。 （１）　第１項の通知が次のいずれかの条件を満たさない場合 ａ　（略） ｂ　当該通知に係る受託清算参加者が、新たな債務負担の全部又は一部の停止措置（当該通知に係る清算委託者の委託に基づき、当該清算委託者の計算で行う清算約定（委託）をその停止の対象に含むものに限る。）を受けていないこと。 ｃ・ｄ　（略） （２）　（略）
４・５　（略）	４・５　（略）

（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）	（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　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は、当社が定めるところにより、当該清算委託者の計算において、当該委託を受けた受託清算参加者と指定相手方との間で清算取次原取引と当社が定める条件を同一とする金利スワップ取引が成立する。	第５５条　前条第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は、当社が定めるところにより、当該清算委託者の計算において、当該委託を受けた受託清算参加者と指定相手方との間で清算取次原取引と当社が定める条件を同一とする金利スワップ取引が成立する。
２～４　（略）	２～４　（略）
５　前２条の規定による清算委託者の委託を受けた受託清算参加者と指定相手方が同一法人である場合には、指定相手方としての受託清算参加者を他の清算参加者とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。	５　前条の規定による清算委託者の委託を受けた受託清算参加者と指定相手方が同一法人である場合には、指定相手方としての受託清算参加者を他の清算参加者とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。
６　（略）	６　（略）
（清算委託者が行う清算約定（委託分）に関する取引毎コンプレッションの申込み等）	
第５６条の２　清算委託者は、清算約定（委託分）について取引毎コンプレッションの申込みの指図又は取引毎コンプレッションの申込みの指図の撤回を行おうとする場合には、当該清算委託者とその受託清算参加者との間で定めるところにより、その旨を受託清算参加者に通知するものとする。	（新設）
２　受託清算参加者は、前項に規定する通知を受領した場合には、第５３条第１項の規定に従い、当該通知に係る清算約定（委託分）について当社に対して取引毎コンプレッションの申込み又は取引毎コンプレッションの申込みの撤回を行うものとする。	

（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清算約定（委託分）に関する一括コンプレッションの申込み）	（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）
（削る）	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（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。	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。
２　受託清算参加者及び清算委託者は、前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。	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。
（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）に関する一括コンプレッションの申込み）	（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、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２項中「清算委託者が受託清算参加者に対し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一括コンプレッションの申込みの	第５７条の２　前条各項の規定は、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

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。	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。	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。	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であって、受託清算参加者に対して当該清算委託者のために設定された委託取引口座に記録されている外貨建清算約定に係る変動証拠金等の預託又は支払いが完了している者に限る。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。	（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。
２～４　（略）	２～４　（略）
（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。）の午後４時において、対象清算約定の承継が行われたと仮定して債務負担時所要証拠金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、当該時点までに、当該承継清算	（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

参加者及び承継元清算参加者が当社に対して当該債務負担時所要証拠金の額（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。）を預託又は交付し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。	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　（略）	２　（略）
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とともに、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に基づく債権債務は、当社が定めるものを除き、将来に向かって消滅する。	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）～（３）　（略） （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（承継元清算参加者を代理人として当社に預託されている当初証拠金として取り扱う旨の申請が行われたものを除く。）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。	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）～（３）　（略） （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　（略）	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　清算委託者（受託清算参加者と同	（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

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であって、受託清算参加者に対して当該清算委託者のために設定された委託取引口座に記録されている外貨建清算約定に係る変動証拠金等の預託又は支払いが完了している者に限る。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。	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・３　（略）	２・３　（略）
（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の午後４時において、清算委託取引の移管が行われたと仮定して債務負担時所要証拠金を算出することとし、当該時点までに、当該受託清算参加者が当社に対して当該債務負担時所要証拠金の額（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	（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

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。）を預託又は交付し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。	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　（略）	２　（略）
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（移管元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ている当初証拠金として取り扱う旨の申請が行われたものを除く。）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。	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並びに当該清算委託取引に基づく債権債務は、当社が定めるものを除き、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並びに当該清算委託取引に基づく債権債務は、当社が定めるものを除き、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。	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・６　（略）	５・６　（略）

（清算参加者口座） 第５９条　当社は、清算参加者ごとに、各清算参加者を当事者とする各清算約定に係る当初証拠金、変動証拠金その他本業務方法書等に基づき、当該各清算約定について各清算参加者との間で授受される金銭等を管理するため、当該各清算約定及びクロスマージン制度の対象となった国債証券先物取引の建玉を記録する口座（以下「清算参加者口座」という。）を開設する。	（清算参加者口座） 第５９条　当社は、清算参加者ごとに、各清算参加者を当事者とする各清算約定に係る当初証拠金、変動証拠金その他本業務方法書等に基づき、当該各清算約定について各清算参加者との間で授受される金銭等を管理するため、当該各清算約定を記録する口座（以下「清算参加者口座」という。）を開設する。
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及び当該清算参加者の計算によるクロスマージン制度の対象となった国債証券先物取引の建玉を記録する口座（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及び当該清算委託者の計算によるクロスマージン制度の対象となった国債証券先物取引の建玉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。	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・４　（略）	３・４　（略）
５　前２項の規定により複数に区分する口座（以下「区分口座」という。）が設定された自己取引口座又は委託取引口座について、当社は、清算参加者の指定に従い、各区分口座に清算約定及びクロスマージン制度の対象となった国債証券先物取引の建玉を記録する。	５　前２項の規定により複数に区分する口座（以下「区分口座」という。）が設定された自己取引口座又は委託取引口座について、当社は、清算参加者の指定に従い、各区分口座に清算約定を記録する。
６　各清算約定、クロスマージン制度の対象となった国債証券先物取引の建玉、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。	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。

７　（略）	７　（略）
（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、当該清算委託者の計算によるクロスマージン制度の対象となった国債証券先物取引の建玉、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。	（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、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）	２　（略）
３　各清算委託取引、清算委託者の計算によるクロスマージン制度の対象となった国債証券先物取引の建玉、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。	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。
（証拠金の目的） 第６１条　証拠金は、次の各号に掲げる証拠金の区分に応じて、当該各号に掲げる債務（次項において「被担保債務」という。）を担保する目的で、本業務方法書等並びに清算受託契約の定めるところにより、当社、清算参加者及び清算委託者の間で授受されるものとする。 （１）　当初証拠金 清算参加者が清算約定に関して当社に対して負担する債務（当該清算約定の終了に伴って生じる債務を含む。）及び清算参加者口座に記録されたクロスマージン対象国債先物清算約定に関して当社に対して負担する債務並びに清算委託者が清算委託取引に関して受託清算参加者に対して負担する債務（当該清算委託取引の終了に伴って生じる債務を含む。）	（証拠金の目的） 第６１条　証拠金は、次の各号に掲げる証拠金の区分に応じて、当該各号に掲げる債務（次項において「被担保債務」という。）を担保する目的で、本業務方法書等並びに清算受託契約の定めるところにより、当社、清算参加者及び清算委託者の間で授受されるものとする。 （１）　当初証拠金 清算参加者が清算約定に関して当社に対して負担する債務（当該清算約定の終了に伴って生じる債務を含む。）及び清算委託者が清算委託取引に関して受託清算参加者に対して負担する債務（当該清算委託取引の終了に伴って生じる債務を含む。）

及び当該清算委託者のために設定された委託取引口座に記録されたクロスマージン対象国債先物清算約定に関して受託清算参加者に対して負担する債務	
（２）　委託当初証拠金 清算委託者が清算委託取引に関して受託清算参加者に対して負担する債務（当該清算委託取引の終了に伴って生じる債務を含む。）及び当該清算委託者のために設定された委託取引口座に記録されたクロスマージン対象国債先物清算約定に関して受託清算参加者に対して負担する債務	（２）　委託当初証拠金 清算委託者が清算委託取引に関して受託清算参加者に対して負担する債務（当該清算委託取引の終了に伴って生じる債務を含む。）
（３）～（５）　（略）	（３）～（５）　（略）
２　証拠金の預託を受けた当社、清算参加者及び清算委託者は、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、証拠金（金銭を異なる通貨へ両替した際に要した費用及び代用有価証券の換価処分に要した費用を控除した残額。以下本項において同じ。）を被担保債務の弁済に充当し、又は証拠金の返還請求権と被担保債務に係る債権とを対当額で相殺することができる。	２　証拠金の預託を受けた当社、清算参加者及び清算委託者は、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、証拠金（証拠金が代用有価証券である場合には、その換価処分後の金銭から当該換価処分に要した費用を控除した残額。以下本項において同じ。）を被担保債務の弁済に充当し、又は証拠金の返還請求権と被担保債務に係る債権とを対当額で相殺することができる。
３　（略）	３　（略）
（当初証拠金の預託時限） 第６６条　（略）	（当初証拠金の預託時限） 第６６条　（略）
２　（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当初証拠金所要額とみなす。	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。	（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。以下本号において同じ。）の額及び当該清算参加者が当該清算委託者のために設定された委託取引口座に記録されたクロスマージン対象国債先物清算約定に関して当社に対して負担する未履行債務の額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	（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

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。）の額及び当該清算委託者が当該清算委託者のために設定された委託取引口座に記録されたクロスマージン対象国債先物清算約定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。	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、当該清算参加者が当該清算委託者のために設定された委託取引口座に記録されたクロスマージン対象国債先物清算約定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。	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）　清算約定（自己分）に係る当初証拠金	（２）　清算約定（自己分）に係る当初証拠金

清算参加者は、当該清算参加者が当社に預託した当初証拠金の額から当該清算参加者が清算約定（自己分）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（自己分）の処理に伴って当社に対して負担する債務のうち未履行であるものを含む。）の額及び当該清算参加者が自己取引口座に記録されたクロスマージン対象国債先物清算約定に関して当社に対して負担する未履行債務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。	清算参加者は、当該清算参加者が当社に預託した当初証拠金の額から当該清算参加者が清算約定（自己分）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（自己分）の処理に伴って当社に対して負担す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。
２～５　（略）	２～５　（略）
（変動証拠金の授受） 第７７条　当社及び清算参加者は、次の各号に掲げる通貨の清算約定に応じて、当該各号に掲げる日ごとに変動証拠金を当該清算約定の通貨の金銭により授受する。 （１）　円貨建清算約定　当社営業日 （２）　外貨建清算約定　当社営業日かつ外貨本国営業日である日	（変動証拠金の授受） 第７７条　当社及び清算参加者は、当社営業日ごとに、変動証拠金を授受する。
（クロスマージン更新差金） 第７７条の２　当社及び清算参加者は、第８４条の５第１項の規定により債権債務が成立した場合には、クロスマージン対象国債先物清算約定に係る証券取引等業務方法書第７３条の９に規定する差額に相当する金銭（以下「クロスマージン更新差金」という。）を当該差額が生じた日の翌当社営業日に授受する。 ２　清算参加者は、クロスマージン更新差金の授受において支払方となる場合には、当該クロスマージン更新差金が生じた日の翌当社営業日の午前１１時までに、クロスマージン更新差金を当社に支払わなければならない。	（新設）

３　当社は、クロスマージン更新差金の授受において受領方となる清算参加者に対し、当該クロスマージン更新差金が生じた日の翌当社営業日の午後１時３０分以降遅滞なく、クロスマージン更新差金を当該清算参加者に支払う。	
（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（外貨建清算約定に係る変動証拠金にあっては、当該変動証拠金の算出日の後最初に到来する当社営業日かつ外貨本国営業日である日の午前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。	（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　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（外貨建清算約定に係る変動証拠金にあっては、当該変動証拠金の算出日の後最初に到来する当社営業日かつ外貨本国営業日である日の午後１時）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。	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８３条　当社及び清算参加者は、当社が定める基準金利を利率として、当社が定めるところにより、次の各号に掲げる通貨の清算約定に応じて、当該各号に定める日ごとに変動証拠金に係る利息を当該清算約定の通貨の金銭により授受するものとする。 （１）　円貨建清算約定　当社営業日 （２）　外貨建清算約定　当社営業日かつ外貨本国営業日である日	（変動証拠金に係る利息の取扱い） 第８３条　当社及び清算参加者は、当社が定める基準金利を利率として、当社が定めるところにより、変動証拠金に係る利息を日々授受するものとする。
２　清算参加者は、変動証拠金の利息の授受において支払方となる場合には、当該変動証拠金に	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

係る利息の算出日の翌当社営業日の午前１１時（外貨建清算約定に係る変動証拠金の利息にあっては、当該変動証拠金の利息の算出日の後最初に到来する当社営業日かつ外貨本国営業日である日の午前１１時）までに、当社に支払わなければならない。	なければならない。
３　当社は、変動証拠金の利息の授受において受領方となる清算参加者に対し、当該変動証拠金に係る利息の算出日の翌当社営業日の午後１時３０分（外貨建清算約定に係る変動証拠金の利息にあっては、当該変動証拠金の利息の算出日の後最初に到来する当社営業日かつ外貨本国営業日である日の午後１時）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。	３　当社は、翌当社営業日の午後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。
（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。	（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４節　クロスマージン制度	（新設）
（クロスマージン制度利用の届出） 第８４条の２　清算参加者は、当該清算参加者又は清算委託者（当該清算参加者と同一の企業集団に含まれる者に限る。）がクロスマージン制度を利用しようとする場合には、あらかじめ当社が定めるところにより、当社に届け出なければならない。 ２　清算参加者は、前項の規定により当社に届け出た内容を変更しようとする場合には、あらかじめ当社が定めるところにより、当社に届け出なければならない。	（新設）

（クロスマージン制度利用の取りやめ） 第８４条の３　清算参加者は、当該清算参加者又は清算委託者がクロスマージン制度の利用を取りやめようとするときは、あらかじめ当社が定めるところにより、当社に届け出なければならない。	（新設）	
（クロスマージンの承諾） 第８４条の４　当社は、クロスマージンの申請を受領した場合、当該申請が当社の定める要件を満たすときに、当該申請に係るクロスマージン利用者である清算参加者又はクロスマージン利用者である清算委託者の受託清算参加者に対して、当社の定めるところにより、当該申請の内容を直ちに通知するものとする。 ２　前項に規定する清算参加者は、前項の通知を受領した場合には、当該通知を受領した当社営業日の午後６時３０分までに、当社の定めるところにより、当該申請に対する承諾又は拒否の通知を当社に対して行うものとする。 ３　当社は、前項の規定により承諾の通知が当社に到達した場合、当社が定める要件を満たすときに、当該承諾の通知の対象である国債証券先物取引の建玉を、当該申請に係るクロスマージン利用者が清算参加者である場合にはその自己取引口座に、清算委託者である場合には、当該清算委託者のために設定された委託取引口座にそれぞれ記録する。 ４　当社は、前項の規定により記録された建玉を当社が定めるときに、自己取引口座又は委託取引口座から抹消するものとする。	（新設）	
（クロスマージン対象国債先物清算約定に係る債権債務と同一内容の債権債務の発生） 第８４条の５　証券取引等業務方法書第７３条の１５の４第１項の規定により、クロスマージン	（新設）	

申請者と当社との間のクロスマージン対象国債先物清算約定に係る債権債務が消滅する場合には、当該クロスマージン対象国債先物清算約定の建玉が記録されている清算参加者口座に係る清算参加者と当社との間で、当社の定めるところにより、当該債権債務と同一内容の債権債務が成立する。 ２　前項のクロスマージン対象国債先物清算約定がその建玉が委託取引口座に記録されているものである場合には、前項の規定による債権債務の成立と同時に、当該委託取引口座に係る清算委託者とその受託清算参加者との間で、前項の規定により成立した債権債務が当該清算委託者及びその受託清算参加者間の清算受託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したものと仮定したときに当該委託により成立することとなる清算委託取引と同一の経済的効果を有する法律関係が成立する。 ３　当社が第９３条の２第１項に規定する転売又は買戻しを行った場合は、第１項の規定により成立した債権債務及び前項の規定により成立した法律関係は、当該転売又は買戻しが実施された時点において将来に向かって消滅する。	
（日本円による資金決済の方法） 第８５条　当社及び清算参加者の間の金銭（日本円に限る。以下本条から第８５条の３までにおいて同じ。）の授受のうち当社が定めるものについては、当社が定める方法により行う。 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たうえで授受することができる。	（資金決済の方法） 第８５条　当社及び清算参加者の間の金銭の授受のうち当社が定めるものについては、当社が定める方法により行う。 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	（当初証拠金及び決済金額の差引計算） 第８５条の２　前前条第２項の規定により差引計

した結果、清算参加者が当社に対して決済金額等（円貨建清算約定に係る決済金額、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）・（２）　（略） ２　（略）	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）・（２）　（略） ２　（略）
（外貨による資金決済の方法） 第８５条の４　第８５条の規定にかかわらず、当社及び清算参加者の間の金銭（日本円以外の金銭に限る。以下本条において同じ。）の授受のうち当社が定めるものについては、当社が定める方法により行う。 ２　当社は、前項に規定する清算参加者との間の金銭の授受にあたって、外貨建清算約定の通貨ごとに、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を行う。当社は、これにより算出した額を差引計算した額に相当する金銭を授受することができる。 ３　当社と清算参加者の間の外貨建清算約定に係る決済金額の授受に係る支払日時は、次の各号に掲げる外貨建清算約定ごとに、当該各号に定める時間とする。 （１）　豪ドル建清算約定　金利支払日のシドニーにおける午後６時 （２）　米ドル建清算約定　金利支払日のニューヨークにおける午後５時	（新設）

（３）　ユーロ建清算約定　金利支払日のロンドンにおける午後４時４５分 ４　清算参加者が、日本円以外の一の通貨に係る資金決済の単位として指定する自己取引口座又は委託取引口座（以下本項及び次項において「指定口座」という。）を当社所定の様式により当社に対してあらかじめ届け出た場合には、第２項後段の規定にかかわらず、当社は、外貨建清算約定の通貨ごとに、各指定口座について第２項前段の規定により算出した額並びに指定口座でない自己取引口座及び各委託取引口座に係る第２項前段の規定により算出した額を差引計算した額に相当する金銭をそれぞれ授受することができる。 ５　清算参加者は、前項に規定する届出について、複数の自己取引口座又は委託取引口座を一の指定口座として届け出ることができる。この場合において、当該届出が行われた複数の自己取引口座又は委託取引口座を一の指定口座とみなして、前項の規定を適用する。 ６　清算参加者は、前２項に規定する届出の内容を変更しようとする場合には、その変更後の内容を、あらかじめ当社に対して届け出るものとする。 （外貨建清算約定に係る資金決済等未了の場合の取扱い） 第８５条の５　当社は、外貨建清算約定に係る変動証拠金及び変動証拠金の利息又は決済金額の預託又は支払いについて、清算参加者がその預託時限又は支払時限までに当社に対して預託又は支払いを完了していない場合において、当該清算参加者の信用状況及び当該預託又は支払いを完了していない事由の原因その他の事情を勘案して当社が適当と認めるときは、当該預託又は支払いの金額（以下「決済未了金額」という。）	（新設）

の預託時限又は支払時限を、当該預託又は支払いを完了しなかった日の後最初に到来する当社営業日かつ当該外貨建清算約定に係る外貨本国営業日である日（支払時限にあっては、当該預託又は支払いを完了しなかった日の後最初の当該外貨建清算約定に係る外貨本国営業日）における同一の時間に繰り延べる。 ２　前項の場合において、当社は、当該預託又は支払いを行っていない清算参加者（以下「決済未了清算参加者」という。）に対し、当社の定めるところにより当初証拠金所要額を加算する。 ３　清算参加者は、決済未了金額の預託時限又は支払時限の繰り延べを、みだりに発生させないよう最大限その防止に努めるものとする。 ４　前各項のほか、第１項の規定により決済未了金額の預託時限又は支払時限の繰り延べを行った場合の取扱いに関し必要な事項は、当社が定める。	
（清算約定の強制解約） 第９１条　（略） ２　前項の規定による破綻処理清算約定の終了に伴う期限前終了手数料の額は、当該破綻処理清算約定の終了に伴う当社のポジションの再構築のために生じ得る費用及び損失に相当する額として当社が規則で定めるところにより破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに算出する額とする。 ３・４　（略） ５　第１項の規定にかかわらず、破綻清算参加者の清算参加者口座にクロスマージン対象国債先物清算約定が記録されている場合には、破綻処理清算約定は、当社又は破綻清算参加者から別段の意思表示を要することなく、第８４条の５第１項の規定により当該破綻清算参加者と当社	（清算約定の強制解約） 第９１条　（略） ２　前項の規定による破綻処理清算約定の終了に伴う期限前終了手数料の額は、当該破綻処理清算約定の終了に伴う当社のポジションの再構築のために生じ得る費用及び損失に相当する額として当社が規則で定めるところにより算出する額とする。 ３・４　（略） （新設）

との間に債権債務が成立することをもって、これと同時に当然に終了する。	
（金利スワップ破綻管理委員会） 第９２条　当社は、清算参加者の破綻等を認定した場合又は第８４条の５第１項の規定により債権債務が成立した場合における損失回避のための措置及び破綻処理入札の実施その他の当社が規則で定める事項（次項において「諮問事項」という。）に関し助言を受けることを目的として、金利スワップ破綻管理委員会を設置する。	（金利スワップ破綻管理委員会） 第９２条　当社は、清算参加者の破綻等を認定した場合における損失回避のための措置及び破綻処理入札の実施その他の当社が規則で定める事項（次項において「諮問事項」という。）に関し助言を受けることを目的として、金利スワップ破綻管理委員会を設置する。
２～４　（略）	２～４　（略）
（損失回避のための措置） 第９３条　当社は、破綻処理清算約定及び次条に定めるクロスマージン処分取引の構成、規模、金利スワップ取引の相場の状況その他の事由を勘案して必要と認める場合には、破綻処理清算約定の終了又はクロスマージン処分取引により、当社のポジションを再構築するまでに当社に生じ得る損失（業務方法書第８４条の５第１項の規定により債権債務が成立している場合は、当該債権債務から当社に生じ得る損失を含む。）の全部又は一部を回避するため、金利スワップ破綻管理委員会の助言に基づき、当社が規則で定めるところにより金利スワップ取引（以下「損失回避取引」という。）を行うことができる。	（損失回避のための措置） 第９３条　当社は、破綻処理清算約定の構成、規模、金利スワップ取引の相場の状況その他の事由を勘案して必要と認める場合には、本節の定めによる破綻処理入札が実施されるまでに破綻処理清算約定の反対清算約定から当社に生じ得る損失の全部又は一部を回避するため、金利スワップ破綻管理委員会の助言に基づき、当社が規則で定めるところにより金利スワップ取引（以下「損失回避取引」という。）を行うことができる。
２　損失回避取引については、これを清算約定とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。この場合において、損失回避取引について必要な事項は当社がその都度定める。	２　損失回避取引については、これを清算約定とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。この場合において、反対清算約定の指定その他必要な事項は当社がその都度定める。
（クロスマージン処分取引の実施） 第９３条の２　当社は、第８４条の５第１項の規定により債権債務が成立した場合には、金利ス	（新設）

ワップ破綻管理委員会の助言に基づき、同条に規定するクロスマージン対象国債先物清算約定について、証券取引等業務方法書第７３条の１５の４第２項に規定する転売又は買戻しその他必要と認める整理を任意の国債先物等清算参加者をして行わせるものとする。

２　当社は、前項のクロスマージン対象国債先物清算約定の規模や相場の状況その他の事由を勘案して、当該クロスマージン対象国債先物清算約定の決済により当社に生じ得る損失の全部又は一部を回避するため、金利スワップ破綻管理委員会の助言に基づき、前項の規定によるクロスマージン対象国債先物清算約定の決済に合わせて当社が規則で定めるところにより、金利スワップ取引（以下「クロスマージン処分取引」という。）を行うことができる。

３　クロスマージン処分取引については、これを清算約定とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。この場合において、必要な事項は当社がその都度定める。

４　清算参加者について破綻等が認定された場合以外の事由により第８４条の５第１項の規定により債権債務が成立した場合において、当社がクロスマージン処分取引を行ったときには、当社は、クロスマージン処分取引の成立と同時に、同項に規定する清算参加者との間で、当該クロスマージン処分取引と同一内容であり当社の取引ポジションが反対である金利スワップ取引を成立させる。

５　第３項の規定は、前項の金利スワップ取引について準用する。

６　第４項のクロスマージン処分取引が、清算参加者の委託取引口座に記録されているクロスマージン対象国債先物清算約定を対象として行われた場合であって、当該委託取引口座に係る清算委託者の清算委託取引が終了していないとき

には、第４項の金利スワップ取引は、当該清算委託者の当該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約定（委託分）と、当該金利スワップ取引に係る清算参加者と清算委託者との間の法律関係は、当該清算約定（委託分）に係る清算委託取引と、それぞれみなす。 ７　第４項の規定により成立する金利スワップ取引に関して必要な事項は、当社が規則で定める。	
（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並びに承継日に授受すべき日本円以外の通貨を想定元本及び決済通貨とする対象清算約定に係る固定金額、変動金額及びアップフロントフィーに関する債務を除く。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　当社が前項の規定による承諾を行った場合、	（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　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）～（４）　（略） （５）　破綻清算参加者及び当該承諾に係る清算委託者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（破綻清算参加者の破綻等が認定された時点で弁済期が到来している清算約定に係る破綻清算参加者の債務及び第８５条の５第１項に規定する決済未了金額に係る破綻清算参加者の債務を除く。）及び委託当初証拠金に係る権利義務（前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部分に限る。）は、将来に向かって消滅する。 （６）　（略）	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）～（４）　（略） （５）　破綻清算参加者及び当該承諾に係る清算委託者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（破綻清算参加者の破綻等が認定された時点で弁済期が到来している清算約定に係る破綻清算参加者の債務を除く。）及び委託当初証拠金に係る権利義務（前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部分に限る。）は、将来に向かって消滅する。 （６）　（略）
７・８　（略）	７・８　（略）
（破綻処理入札の実施） 第９５条　当社は、清算参加者の破綻等を認定した場合には、破綻処理清算約定の終了に伴う当社のポジションを再構築するため、破綻処理清算約定（前条の規定により承継清算参加者に承継された清算約定（委託分）を除く。）の終了、損失回避取引及びクロスマージン処分取引により当社に生じ得る損失（業務方法書第８４条の５第１項の規定により債権債務が成立している場合は、当該債権債務から当社に生じ得る損失を含む。）の解消を目的とする金利スワップ取引を行うための入札（以下「破綻処理入札」という。）を実施することができる。	（破綻処理入札の実施） 第９５条　当社は、清算参加者の破綻等を認定した場合には、破綻処理清算約定の終了に伴う当社のポジションを再構築するため、破綻処理清算約定（前条の規定により承継清算参加者に承継された清算約定（委託分）を除く。）の反対清算約定及び損失回避取引により当社に生じ得る損失の解消を目的とする金利スワップ取引を行うための入札（以下「破綻処理入札」という。）を実施することができる。
２　当社は、前項の破綻処理入札を、破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに行うものとする。	（新設）
３　（略）	２　（略）
４　（略）	３　（略）

５　前各項に規定するほか、破綻処理入札の手順、運営方法その他必要な事項は当社が規則で定める。	４　前３項に規定するほか、破綻処理入札の手順、運営方法その他必要な事項は当社が規則で定める。
（破綻処理入札において損失を補填することができないおそれがある場合の対応） 第９５条の２　破綻処理入札が実施された場合において、当該破綻処理入札に係る入札対象取引を成立させたときに破綻清算参加者の破綻等により生じる損失（第１０２条第１項の規定により破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに算出される当社に生じ得る損失をいう。以下本条及び次条において同じ。）を、第１０３条から第１０６条までの規定に定めるところにより補填することができないおそれがあるときは、当社は、金利スワップ破綻管理委員会の助言に基づき、当該損失を補填することができないおそれがある通貨の種類の破綻処理清算約定について、破綻処理入札の再実施又は第９６条の規定に従った協議のいずれかを行うものとする。 ２　前項の規定にかかわらず、破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに行われる破綻処理入札が同一の時間帯に実施された場合又は実施された破綻処理入札が破綻処理清算約定の終了に伴い実施される破綻処理入札のうち最後に行われたものであった場合において、当該破綻処理入札に係る入札対象取引を成立させたときに破綻清算参加者の破綻等により生じる損失を、第１０３条から第１０６条までの規定に定めるところにより補填することができないおそれがあるときには、当社及び清算参加者は、第９６条の規定に従い協議を行うものとする。 ３　前条の規定は、第１項の規定により破綻処理入札の再実施を行う場合に準用する。	（新設）
（損失を補填することができないおそれがある場	（損失を補填することができないおそれがある場

合の協議）	合の協議）
第９６条　前条第１項及び第２項の規定に従い行われる協議は、当社及び破綻処理入札に参加する義務を負うすべての清算参加者が、入札対象取引を成立させた場合に破綻清算参加者の破綻等により生じる損失の処理に関し、規則で定めるところにより行うものとする。	第９６条　破綻処理入札が実施された場合において、入札対象取引を成立させた場合に破綻清算参加者の破綻等により生じる損失（第１０１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に対応する当社の損失をいう。）を、第１０３条から第１０６条までの規定に定めるところにより補填することができないおそれがあるときは、当社及び清算参加者は、当該損失の処理に関し、規則で定めるところにより対応を協議する。
２　前項の規定による協議の結果、同項の損失の処理について当社と当該破綻処理入札に参加する義務を負うすべての清算参加者の間において規則で定めるところにより合意が成立した場合には、当社は、当該合意の定めるところにより当該損失の処理を行う。この場合において、当該処理の内容は、当該損失の全部が補填され、かつ、当社による金利スワップ取引清算業務の継続が可能なものであることを要する。	２　前項の規定による協議の結果、同項の損失の処理について当社とすべての清算参加者（破綻清算参加者を除く。）の間において規則で定めるところにより合意が成立した場合には、当社は、当該合意の定めるところにより当該損失の処理を行う。この場合において、当該処理の内容は、当該損失の全部が補填され、かつ、当社による金利スワップ取引清算業務の継続が可能なものであることを要する。
（協議が不調となった場合における清算約定の強制終了）	（協議が不調となった場合における清算約定の強制終了）
第９７条　前条第１項の規定により協議が行われた場合において、当社が規則で定める期間内に同条第２項の合意が成立しないときは、当該期間が経過する日において存在する当該合意が成立しなかった破綻処理清算約定と同一の種類の通貨を想定元本及び決済通貨とするすべての清算約定は、当社又は清算参加者から別段の意思表示を要することなく、その経過時点において当然に終了する。	第９７条　前条第１項の規定により協議が行われた場合において、当社が規則で定める期間内に同条第２項の合意が成立しないときは、当該期間が経過する日において存在するすべての清算約定は、当社又は清算参加者から別段の意思表示を要することなく、その経過時点において当然に終了する。
２　（略）	２　（略）
（協議に関する通知等）	（協議に関する通知等）
第９８条　当社は、第９６条第２項の合意が成立	第９８条　当社は、第９６条第２項の合意が成立

し、又は前条第１項の規定により同項に規定する清算約定が終了した場合には、直ちにその旨をすべての清算参加者に通知し、かつ公表する。	し、又は前条第１項の規定によりすべての清算約定が終了した場合には、直ちにその旨をすべての清算参加者に通知し、かつ公表する。
（入札対象取引の成立等） 第９９条　（略）	（入札対象取引の成立等） 第９９条　清算参加者が破綻処理入札において入札対象取引を落札した場合には、当社が規則で定めるところにより、当社及び当該清算参加者の間において、当該落札に係る入札対象取引が成立するものとする。
２・３　（略）	２・３　（略）
（削る）	４　当社は、第１項の規定により入札対象取引が成立した場合には、当社が規則で定めるところにより、当該入札対象取引の反対清算約定となる清算約定を指定する。この場合において、清算参加者は、当社が規則で定める手続を行うものとする。
４　前２項に規定するほか、入札対象取引が成立した場合の手続については、当社が規則で定める。	５　前３項に規定するほか、入札対象取引が成立した場合の手続については、当社が規則で定める。
（破綻処理に関する負担） 第１００条　破綻清算参加者は、破綻処理清算約定の終了に伴う期限前終了手数料の支払義務を負うほか、第９５条及び前条の規定による破綻処理入札及び入札対象取引の成立その他破綻処理清算約定及び第８４条の５第１項の規定により成立した債権債務に係る処理に関し、当社が損失を被り、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銭を補償する義務を負うものとする。	（破綻処理に関する負担） 第１００条　破綻清算参加者は、破綻処理清算約定の終了に伴う期限前終了手数料の支払義務を負うほか、第９５条及び前条の規定による破綻処理入札及び入札対象取引の成立その他破綻処理清算約定の処理に関し、当社が損失を被り、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銭を補償する義務を負うものとする。
（破綻処理清算約定等の決済の方法） 第１０１条　本業務方法書の他の規定にかかわらず、破綻処理清算約定の終了に伴って破綻清算参加者が当社に対して負担する第１号の債務	（破綻処理清算約定等の決済の方法） 第１０１条　本業務方法書の他の規定にかかわらず、破綻処理清算約定の終了に伴って破綻清算参加者が当社に対して負担する第１号の債務

（以下「未決済債務」という。）については、未決済債務並びに未決済債務と差引計算すべき当社の債務及び未決済債務に充当すべき担保の額がいずれも確定した日において、第２号に定めるところにより、破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに差引計算及び担保の充当を行う。	（以下「未決済債務」という。）については、未決済債務並びに未決済債務と差引計算すべき当社の債務及び未決済債務に充当すべき担保の額がいずれも確定した日において、第２号に定めるところにより、差引計算及び担保の充当を行う。
（１）　未決済債務	（１）　未決済債務
a　破綻処理清算約定の終了に伴い、当該破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに破綻清算参加者が当社に支払うべき期限前終了手数料の支払債務	a　破綻処理清算約定の終了に伴い、破綻清算参加者が当社に支払うべき期限前終了手数料の支払債務
b　当社が破綻処理清算約定に関し破綻清算参加者に預託済みの変動証拠金の返還債務及び当該変動証拠金に係る利息の支払債務（日本円以外の通貨を想定元本及び決済通貨とする破綻処理清算約定に係る変動証拠金及びその利息にあっては、当社が規則で定めるところにより日本円に換算する。次号において同じ。）	b　当社が破綻処理清算約定に関し破綻清算参加者に預託済みの変動証拠金の返還債務及び変動証拠金に係る利息の支払債務
c　破綻清算参加者の破綻等が認定された時点で弁済期が到来している清算約定に係る破綻清算参加者の当該清算約定に係る通貨の種類ごとの未履行債務（日本円以外の通貨を想定元本及び決済通貨とする破綻処理清算約定に係る未履行債務にあっては、当社が規則で定めるところにより日本円に換算する。次号において同じ。）	c　破綻清算参加者の破綻等が認定された時点で弁済期が到来している清算約定に係る破綻清算参加者の未履行債務
d　前条の規定により破綻清算参加者が負担する破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとの支払債務（日本円を想定元本及び決済通貨とする破綻処理清算約定に係る支払債務にあっては、第８４条の５第１項の規定により成立した債権債務に係る支払債務を含む。）（日本円以外の通貨を想定元本及び決済通貨とする破綻処理清算約定に係る	d　前条の規定により破綻清算参加者が負担する支払債務

支払債務にあっては、当社が規則で定めるところにより日本円に換算する。次号において同じ。）	
（２）　破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに行う差引計算及び担保の充当の方法	（２）　差引計算及び担保の充当の方法
a　破綻処理清算約定の終了に伴って生じる破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとの当社の期限前終了手数料の支払債務（破綻清算参加者の清算参加者口座にクロスマージン国債先物清算約定が記録されている場合にあっては、日本円建ての破綻処理清算約定について生じる当社の期限前終了手数料の支払債務に第８４条の５第１項の規定により成立した債権債務に関する当社の支払債務を含むものとする。）と破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとの未決済債務を差引計算し、前号に掲げる未決済債務を破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに合計した額（以下「破綻清算参加者支払額」という。）から当該期限前終了手数料の額を控除する。	a　破綻処理清算約定の終了に伴って生じる当社の期限前終了手数料の支払債務と未決済債務を差引計算し、前号に掲げる未決済債務の合計額（以下「破綻清算参加者支払額」という。）から当該期限前終了手数料の額を控除する。
b　破綻清算参加者が破綻処理清算約定に関し当社に預託済みの変動証拠金を破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとの未決済債務に充当し、上記ａの控除を行った残額からその充当額を控除する。	b　破綻清算参加者が破綻処理清算約定に関し当社に預託済みの変動証拠金を未決済債務に充当し、上記ａの控除を行った残額からその充当額を控除する。
c　第８９条第２項の規定により破綻清算参加者に対する引渡しを停止した金銭等（有価証券については、当社による換価処分後の金銭から当該換価処分に要した費用を控除した残額とし、日本円以外の通貨の金銭については、当社が規則で定めるところにより日本円に換算した額とする。）を破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとの未決済債務に充当し、上記ｂの控除を行った残額からその充当額を控除する。	c　第８９条第２項の規定により破綻清算参加者に対する引渡しを停止した金銭等（有価証券については、当社による換価処分後の金銭から当該換価処分に要した費用を控除した残額）を未決済債務に充当し、上記ｂの控除を行った残額からその充当額を控除する。

d　破綻処理清算約定に係る当初証拠金（当初証拠金が代用有価証券である場合には、その換価処分後の金銭から当該換価処分に要した費用を控除した残額）（第７６条の規定により清算委託者が返還請求権を有する部分を除く。）について当社が規則で定めるところにより当該通貨の種類ごとに按分した額を当該通貨の種類ごとの未決済債務に充当し、上記ｃの控除を行った残額からその充当額を控除する。	d　破綻処理清算約定に係る当初証拠金（当初証拠金が代用有価証券である場合には、その換価処分後の金銭から当該換価処分に要した費用を控除した残額）（第７６条の規定により清算委託者が返還請求権を有する部分を除く。）を未決済債務に充当し、上記ｃの控除を行った残額からその充当額を控除する。
e　破綻清算参加者から預託を受けた金利スワップ清算基金及び破綻時証拠金（金利スワップ清算基金又は破綻時証拠金が代用有価証券である場合には、その換価処分後の金銭から当該換価処分に要した費用を控除した残額）について当社が規則で定めるところにより破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに按分した額を当該通貨の種類ごとの未決済債務に充当し、上記ｄの控除を行った残額からその充当額を控除する。	e　破綻清算参加者から預託を受けた金利スワップ清算基金及び破綻時証拠金（金利スワップ清算基金又は破綻時証拠金が代用有価証券である場合には、その換価処分後の金銭から当該換価処分に要した費用を控除した残額）を未決済債務に充当し、上記ｄの控除を行った残額からその充当額を控除する。
f　破綻清算参加者から預託を受けた他の清算業務に係る余剰担保（破綻清算参加者が他の清算業務について当社に預託した取引証拠金、清算基金その他の担保（破綻清算参加者が返還請求権を有するものに限る。）のうち、他の清算業務に係る業務方法書の定めるところにより破綻清算参加者の債務の弁済に充当した残額に係るものをいう。）（当該余剰担保が有価証券である場合には、その換価処分後の金銭から当該換価処分に要した費用を控除した残額）について当社が規則で定めるところにより破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに按分した額を当該通貨の種類ごとの未決済債務に充当し、上記ｅの控除を行った残額からその充当額を控除する。	f　破綻清算参加者から預託を受けた他の清算業務に係る余剰担保（破綻清算参加者が他の清算業務について当社に預託した取引証拠金、清算基金その他の担保（破綻清算参加者が返還請求権を有するものに限る。）のうち、他の清算業務に係る業務方法書の定めるところにより破綻清算参加者の債務の弁済に充当した残額に係るものをいう。）（当該余剰担保が有価証券である場合には、その換価処分後の金銭から当該換価処分に要した費用を控除した残額）を未決済債務に充当し、上記ｅの控除を行った残額からその充当額を控除する。

２　前項の規定による破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに行う差引計算及び担保の充当の結果、当該破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとの破綻清算参加者支払額がなお残存する場合には、本業務方法書の他の規定にかかわらず、その残存額を合計した額をもってすべての破綻処理清算約定の終了に伴う当社の破綻清算参加者に対する一の債権とする。	２　前項の規定による差引計算及び担保の充当の結果、破綻清算参加者支払額がなお残存する場合には、本業務方法書の他の規定にかかわらず、その残存額をもってすべての破綻処理清算約定の終了に伴う当社の破綻清算参加者に対する一の債権とする。
（破綻処理損失の算出） 第１０２条　当社は、当社が規則で定める日（以下「当初損失確定日」という。）において、前条第１項第２号の規定による差引計算及び担保の充当の後、再配分当初証拠金等（次条に規定するものをいう。）を当該差引計算等の結果得られた残額から更に控除することで、当社に生じ得る損失の有無及びその額を算出する。	（破綻処理損失の算出） 第１０２条　当社は、当社が規則で定める日（以下「当初損失確定日」という。）において、前条第１項の規定による差引計算及び担保の充当の結果、同条第２項の規定により生じ得る当社の破綻清算参加者に対する債権の有無及びその額を算出する。
２　（略）	２　（略）
（異なる通貨に係る破綻処理清算約定への担保等の配分） 第１０２条の２　破綻処理清算約定に係る通貨の種類が複数ある場合において、一の通貨に係る破綻処理清算約定について前条第１項の規定による損失の算出を行った結果、当該算出結果が負の数になったときは、当該負の数の絶対値を当社が規則で定めるところにより按分した金額を、他の通貨に係る破綻処理清算約定（前条第１項の規定による損失の算出を行っている通貨の破綻処理清算約定及び第９７条第１項の規定により終了した清算約定に係る通貨の破綻処理清算約定を除く。）に関する破綻処理損失と差引計算を行う再配分当初証拠金等として配分する。	（新設）
（金利スワップ決済保証準備金等による損失の補	（金利スワップ決済保証準備金等による損失の補

填） 第１０３条　第１０２条の規定による算出の結果、当社に損失が生じ得る場合には、当社は、当初損失確定日において、当該損失の額に対応する当該破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに算出した当社の損失（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破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとのその他の損失（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、当該各号に定める方法により破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに補填する。	填） 第１０３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、当該各号に定める方法により補填する。
（１）　第一階層金利スワップ決済保証準備金を当社が規則で定めるところにより破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに按分した額の取崩し	（１）　第一階層金利スワップ決済保証準備金の取崩し
（１）の２　次条第１項の規定により破綻処理損失を補填するために配分される再配分第一階層金利スワップ決済保証準備金の取崩し	（新設）
（２）　破綻清算参加者以外の各清算参加者が当社に預託した金利スワップ清算基金（当該各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金利スワップ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。）を当社が規則で定めるところにより破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに按分した額を上限とする。）及び第二階層金利スワップ決済保証準備金を当社が規則で定め	（２）　破綻清算参加者以外の各清算参加者が当社に預託した金利スワップ清算基金（当該各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金利スワップ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。）及び第二階層金利スワップ決済保証準備金の取崩し

るところにより破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに按分した額の取崩し	
（３）　次条第２項の規定により破綻処理損失を補填するために配分される再配分金利スワップ清算基金（当該配分された通貨の種類の破綻処理清算約定に係る破綻処理入札に参加する義務を負う清算参加者が預託した金利スワップ清算基金に限る。）及び再配分第二階層金利スワップ決済保証準備金の取崩し	（新設）
（４）　次条第２項の規定により破綻処理損失を補填するために配分される再配分金利スワップ清算基金（当該配分された通貨の種類の破綻処理清算約定に係る破綻処理入札に参加する義務を負わない清算参加者が預託した金利スワップ清算基金に限る。）の取崩し	（新設）
２　前項第１号及び第１号の２の方法による補填後の破綻処理損失の全部が同項第２号の方法により補填される場合、破綻清算参加者以外の各清算参加者が当社に預託した金利スワップ清算基金及び第二階層金利スワップ決済保証準備金から取崩しをする額は、次に定めるとおりとする。	２　前項第１号の方法による補填後の破綻処理損失の全部が同項第２号の方法により補填される場合、破綻清算参加者以外の各清算参加者が当社に預託した金利スワップ清算基金及び第二階層金利スワップ決済保証準備金から取崩しをする額は、次に定めるとおりとする。
（１）　破綻清算参加者以外の各清算参加者が当社に預託した前項第２号に定めるところにより破綻処理清算約定の通貨の種類ごとに按分された金利スワップ清算基金から取崩しをする額の総額（以下本項において「第二階層清算参加者負担総額」という。）及び同号に定めるところにより破綻処理清算約定の通貨の種類ごとに按分された第二階層金利スワップ決済保証準備金から取崩しをする額は、当該破綻処理損失の額を、破綻清算参加者以外の各清算参加者の当該破綻処理清算約定の通貨に係る第二階層清算参加者負担限度額の総額及び当該按分された第二階層金利スワップ決済保証準備金の額に応じて按分した額とす	（１）　破綻清算参加者以外の各清算参加者が当社に預託した金利スワップ清算基金から取崩しをする額の総額（以下本項において「第二階層清算参加者負担総額」という。）及び第二階層金利スワップ決済保証準備金から取崩しをする額は、当該破綻処理損失の額を、破綻清算参加者以外の各清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額の総額及び第二階層金利スワップ決済保証準備金の額に応じて按分した額とする。

る。

（２）　破綻清算参加者以外の各清算参加者（当該破綻処理入札に参加する義務を負う清算参加者に限る。以下本号において同じ。）が当社に預託した金利スワップ清算基金のうち前項第２号に定めるところにより按分された金利スワップ清算基金から取崩しをする額は、次のａからｄまでに掲げる金利スワップ清算基金の順序に従い、当該ａからｄまでに定める額とする。

ａ　当該破綻処理入札に参加しなかった清算参加者又は当該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中に実施された他の破綻処理入札であって、参加する義務のあるもの（当該破綻処理入札までに実施されたものに限る。）のうちのいずれかに参加しなかった清算参加者（これらの他の破綻処理入札のいずれかにおいて入札対象取引を落札し、かつその後に実施されたすべての破綻処理入札に参加している清算参加者を除く。以下このａにおいて「対象清算参加者」という。）が当社に預託した金利スワップ清算基金　第二階層清算参加者負担総額を各対象清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額に応じて按分した額（第二階層清算参加者負担総額が対象清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額の総額以上である場合には、各対象清算参加者の当該第二階層清算参加者負担限度額）

ｂ　当該破綻処理入札に相場から著しく乖離した価格として当社が規則で定める価格（以下本ｂ及び第４項第２号において「乖離価格」という。）による入札を行った清算参加者又は当該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中に実

（２）　破綻清算参加者以外の各清算参加者が当社に預託した金利スワップ清算基金から取崩しをする額は、次のａからｄまでに掲げる金利スワップ清算基金の順序に従い、当該ａからｄまでに定める額とする。

ａ　当該破綻清算参加者に係る破綻処理入札又は当該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中に実施された他の破綻処理入札（当該破綻清算参加者に係る破綻処理入札までに実施されたものに限る。）のいずれかに参加しなかった清算参加者（これらの破綻処理入札のいずれかにおいて入札対象取引を落札し、かつその後に実施されたすべての破綻処理入札に参加している清算参加者を除く。以下このａにおいて「対象清算参加者」という。）が当社に預託した金利スワップ清算基金　第二階層清算参加者負担総額を各対象清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額に応じて按分した額（第二階層清算参加者負担総額が対象清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額の総額以上である場合には、各対象清算参加者の当該第二階層清算参加者負担限度額）

ｂ　当該破綻清算参加者に係る破綻処理入札又は当該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中に実施された他の破綻処理入札（当該破綻清算参加者に係る破綻処理入札までに実施されたものに限る。）のいずれかにおいて相場から著し

施された他の破綻処理入札であって、参加する義務のあるもの（当該破綻処理入札までに実施されたものに限る。）のうちのいずれかにおいて、乖離価格による入札を行った清算参加者（これらの他の破綻処理入札のいずれかにおいて入札対象取引を落札し、かつその後に実施されたすべての破綻処理入札において乖離価格による入札を行っていない清算参加者及び上記ａに掲げる清算参加者を除く。以下このｂにおいて「対象清算参加者」という。）が当社に預託した金利スワップ清算基金　第二階層清算参加者負担総額から上記ａに定める取崩し額の総額を控除した残額を各対象清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額に応じて按分した額（当該残額が対象清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額の総額以上である場合には、各対象清算参加者の当該第二階層清算参加者負担限度額）	く乖離した価格として当社が規則で定める価格による入札を行った清算参加者（これらの破綻処理入札のいずれかにおいて入札対象取引を落札し、かつその後に実施されたすべての破綻処理入札において相場から著しく乖離した価格として当社が規則で定める価格による入札を行っていない清算参加者及び上記ａに掲げる清算参加者を除く。以下このｂにおいて「対象清算参加者」という。）が当社に預託した金利スワップ清算基金　第二階層清算参加者負担総額から上記ａに定める取崩し額の総額を控除した残額を各対象清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額に応じて按分した額（当該残額が対象清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額の総額以上である場合には、各対象清算参加者の当該第二階層清算参加者負担限度額）
ｃ　当該各清算参加者（ａ、ｂ及びｄに掲げる清算参加者を除く。）が当社に預託した金利スワップ清算基金　第二階層清算参加者負担総額から上記ａ及びｂに定める取崩し額の総額を控除した残額を当該各清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額に応じて按分した額（当該残額が当該各清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額の総額以上である場合には、当該各清算参加者の当該第二階層清算参加者負担限度額）	ｃ　当該各清算参加者（ａ、ｂ及びｄに掲げる清算参加者を除く。）が当社に預託した金利スワップ清算基金　清算参加者負担総額から上記ａ及びｂに定める取崩し額の総額を控除した残額を当該各清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額に応じて按分した額（当該残額が当該各清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額の総額以上である場合には、当該各清算参加者の当該第二階層清算参加者負担限度額）
ｄ　当該破綻処理入札において入札対象取引を落札した清算参加者（当該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中に実施された他の破綻処理入札（当該破綻処理入札までに実施されたものに限る。）のうち、直近に実施された破綻処理入札において、上記ａ又はｂの適用を受け	ｄ　当該破綻清算参加者に係る破綻処理入札において入札対象取引を落札した清算参加者（当該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中に認定された破綻等であって、当該破綻清算参加者に係る破綻処理入札までに破綻処理入札が実施されたもののうち、直近に破綻処理入札が

ていた清算参加者及び金利スワップ清算基金の取崩しを受けていたとすれば上記ａ又はｂの適用を受けていた清算参加者を除く。）が当社に預託した金利スワップ清算基金　第二階層清算参加者負担総額から上記ａからｃまでに定める取崩し額の総額を控除した残額	実施されたものにおいて、上記ａ又はｂの適用を受けていた清算参加者及び金利スワップ清算基金の取崩しを受けていたとすれば上記ａ又はｂの適用を受けていた清算参加者を除く。）が当社に預託した金利スワップ清算基金　清算参加者負担総額から上記ａからｃまでに定める取崩し額の総額を控除した残額
３　第１項第１号から第２号までの方法による補填後の破綻処理損失の残額の全部が同項第３号の方法により補填される場合、同号の規定により再配分金利スワップ清算基金及び再配分第二階層金利スワップ決済保証準備金から取崩しをする額は、次に定めるとおりとする。 （１）　破綻清算参加者以外の各清算参加者が当社に預託した再配分金利スワップ清算基金及び再配分第二階層金利スワップ決済保証準備金から取崩しをする額は、当該破綻処理損失の残額を、第１項第３号及び第４号の再配分金利スワップ清算基金の合計額と再配分第二階層金利スワップ決済保証準備金の額に応じて按分した額とする。 （２）　前項第２号の規定は、破綻清算参加者以外の各清算参加者（当該破綻処理入札に参加する義務を負う清算参加者に限る。以下本号において同じ。）が当社に預託している金利スワップ清算基金のうち、第１項第３号の再配分金利スワップ清算基金から取崩しをする場合に準用する。この場合において、前項第２号中「金利スワップ清算基金」及び「第二階層清算参加者負担限度額」とあるのは「再配分金利スワップ清算基金の額」と、「第二階層清算参加者負担総額」とあるのは「当該破綻処理損失の残額」と読み替えるものとする。	（新設）
４　第１項第１号から第３号までの方法による補	（新設）

填後の破綻処理損失の全部が同項第４号の方法により補填される場合、同号の規定により再配分金利スワップ清算基金から取崩しをする額は、次の各号に掲げる再配分金利スワップ清算基金の順序に従い、当該各号に定める額とする。 （１）　当該破綻処理入札に参加しなかった清算参加者（当該破綻処理入札に参加する義務を負わない清算参加者に限る。以下本号において「対象清算参加者」という。）が当社に預託した再配分金利スワップ清算基金　当該破綻処理損失の残額を各対象清算参加者の再配分金利スワップ清算基金負担限度額（第１項第４号の規定により取り崩される再配分金利スワップ清算基金をいい、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金利スワップ清算基金から取り崩された額があるときは、当該額を控除した後の残額とする。以下本項において同じ。）に応じて按分した額（当該破綻処理損失の総額が各対象清算参加者の再配分金利スワップ清算基金負担限度額以上である場合には、各対象清算参加者の再配分金利スワップ清算基金負担限度額） （２）　当該破綻処理入札に乖離価格による入札を行った清算参加者（当該破綻処理入札に参加する義務を負わない清算参加者に限る。以下本号において「対象清算参加者」という。）が当社に預託した再配分金利スワップ清算基金　当該破綻処理損失の残額から前号に定める取崩し額の総額を控除した残額を各対象清算参加者の再配分金利スワップ清算基金負担限度額に応じて按分した額（当該残額が対象清算参加者の当該再配分金利スワップ清算基金負担限度額の総額以上である場合には、各	

対象清算参加者の再配分金利スワップ清算基金負担限度額） （３）　当該各清算参加者（当該破綻処理入札に参加する義務を負わない清算参加者であって、前２号及び次号に掲げる清算参加者を除く。）が当社に預託した再配分金利スワップ清算基金　当該破綻処理損失の残額から前２号に定める取崩し額の総額を控除した残額を各対象清算参加者の再配分金利スワップ清算基金負担限度額に応じて按分した額（当該残額が当該各清算参加者の再配分金利スワップ清算基金負担限度額の総額以上である場合には、当該各清算参加者の再配分金利スワップ清算基金負担限度額） （４）　当該破綻処理入札において入札対象取引を落札した清算参加者（当該破綻処理入札に参加する義務を負わない清算参加者に限る。）が当社に預託した再配分金利スワップ清算基金　当該破綻処理損失の残額から第１号から前号までに定める取崩し額の総額を控除した残額	
５　各清算参加者（破綻清算参加者を除く。以下本項において同じ。）は、前３項の規定により自己が当社に預託した金利スワップ清算基金（第１項第３号及び第４号の規定により再配分金利スワップ清算基金を含む。以下本項において同じ。）から取り崩されるべき金額を当社に支払う義務を負うものとし、前各項の規定による金利スワップ清算基金の取崩しは、当初損失確定日において、当社及び各清算参加者から別段の意思表示を要することなく、当然に、当該義務に対応する当社の債権と、当該義務を負う清算参加者が当社に対して有する金利スワップ清算基金の返還請求権とを対当額で相殺する方法により行う。	３　各清算参加者（破綻清算参加者を除く。以下本項において同じ。）は、前項の規定により自己が当社に預託した金利スワップ清算基金から取り崩されるべき金額を当社に支払う義務を負うものとし、前２項の規定による金利スワップ清算基金の取崩しは、当初損失確定日において、当社及び各清算参加者から別段の意思表示を要することなく、当然に、当該義務に対応する当社の債権と、当該義務を負う清算参加者が当社に対して有する金利スワップ清算基金の返還請求権とを対当額で相殺する方法により行う。
６　特定承継金融機関等である清算参加者が当社	４　特定承継金融機関等である清算参加者が当社

に預託した金利スワップ清算基金は、第２項第２号ｃに定める金利スワップ清算基金として同号の順序に従って取り崩されるものとする。	に預託した金利スワップ清算基金は、第２項第２号ｃに定める金利スワップ清算基金として同号の順序に従って取り崩されるものとする。
７　第９条第１項第３号ｂの委託を行っている清算参加者に係る第２項第２号及び第４項各号（第３項の規定により準用する場合を含む。）の規定の適用は、次に定めるところによる。	５　第９条第１項第３号ｂの委託を行っている清算参加者に係る第２項第２号の規定の適用は、次に定めるところによる。
（１）・（２）　（略）	（１）・（２）　（略）。
（３）　破綻処理入札において相場から著しく乖離した価格として当社が規則で定める価格による入札 当該清算参加者から委託を受けた者が、破綻処理入札において第２項第２号ｂ又は第４項第２号ｂに規定する価格により当該委託に係る入札を行ったことをいう。	（３）　破綻処理入札において相場から著しく乖離した価格として当社が規則で定める価格による入札 当該清算参加者から委託を受けた者が、破綻処理入札において第２項第２号ｂに規定する価格により当該委託に係る入札を行ったことをいう。
（異なる通貨に係る破綻処理清算約定の金利スワップ決済保証準備金等の配分） 第１０３条の２　破綻処理清算約定に係る通貨の種類が複数ある場合において、一の通貨に係る破綻処理清算約定について前条第１項第１号の規定による第一階層金利スワップ決済保証準備金の取崩しを行った結果、破綻処理損失の残額が生じなかったときは、当該第一階層金利スワップ決済保証準備金の取崩し後の残額を当社が規則で定めるところにより按分した金額を、他の通貨に係る破綻処理清算約定（第１０２条第１項の規定による損失の算出を行っている通貨の破綻処理清算約定及び第９７条第１項の規定により終了した清算約定に係る通貨の破綻処理清算約定を除く。）に関する破綻処理損失のために取崩しをする前条第１項第１号の２に定める再配分第一階層金利スワップ決済保証準備金として配分する。 ２　破綻処理清算約定に係る通貨の種類が複数ある場合において、一の通貨に係る破綻処理清算	（新設）

約定について前条第１項第２号の規定による金利スワップ清算基金及び第二階層金利スワップ決済保証準備金の取り崩しを行った結果、破綻処理損失の残額が生じなかったときは、当該金利スワップ清算基金及び第二階層金利スワップ決済保証準備金の取崩し後の残額を当社が規則で定めるところにより按分した金額を、他の通貨に係る破綻処理清算約定（第１０２条第１項の規定による損失の算出を行っている通貨の破綻処理清算約定及び第９７条第１項の規定により終了した清算約定に係る通貨の破綻処理清算約定を除く。）に関する破綻処理損失のために取崩しをする前条第１項第３号及び第４号に定める再配分金利スワップ清算基金及び再配分第二階層金利スワップ決済保証準備金として配分する。	
（破綻処理単位期間における金利スワップ清算基金に関する特則） 第１０４条　（略） ２　破綻処理単位期間において第１０３条第１項第２号から第４号の規定により金利スワップ清算基金の全部又は一部が取り崩された場合、第１７条第２項の規定にかかわらず、当該破綻処理単位期間が終了するまでの間、清算参加者は、当該取崩しに対応する額の金利スワップ清算基金の追加預託義務を負わない。 ３　（略）	（破綻処理単位期間における金利スワップ清算基金に関する特則） 第１０４条　（略） ２　破綻処理単位期間において前条第１項第２号の規定により金利スワップ清算基金の全部又は一部が取り崩された場合、第１７条第２項の規定にかかわらず、当該破綻処理単位期間が終了するまでの間、清算参加者は、当該取崩しに対応する額の金利スワップ清算基金の追加預託義務を負わない。 ３　（略）
（第三階層特別清算料による損失の補填） 第１０５条　破綻処理損失について、第１０３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（以下「第三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、第三階層特	（第三階層特別清算料による損失の補填） 第１０５条　破綻処理損失について、第１０３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すべての清算参加者（以下本条において「第三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

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、第三階層特別清算料負担参加者から支払いを受けた第三階層特別清算料をもって、当該損失を補填する。	ころにより、第三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、第三階層特別清算料負担参加者から支払いを受けた第三階層特別清算料をもって、当該損失を補填する。
２　前項の第三階層特別清算料の額は、第三階層特別清算料負担参加者ごとに、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第三階層特別清算料負担参加者に係る金利スワップ清算基金所要額を当社が規則で定めるところにより破綻処理清算約定の通貨の種類ごとに按分した額を上限として当社が規則で定める額とする。	２　前項の第三階層特別清算料の額は、第三階層特別清算料負担参加者ごとに、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第三階層特別清算料負担参加者に係る金利スワップ清算基金所要額を上限として当社が規則で定める額とする。
（異なる通貨に係る破綻処理清算約定の第三階層特別清算料の配分） 第１０５条の２　破綻処理清算約定に係る通貨の種類が複数ある場合において、一の通貨に係る破綻処理清算約定について前条第１項の規定による第三階層特別清算料による補填を行ったときに破綻処理損失の残額が生じなかったときは、当該第三階層特別清算料の残額を当社が規則で定めるところにより按分した金額を、他の通貨に係る破綻処理清算約定（第１０２条第１項の規定による損失の算出を行っている通貨の破綻処理清算約定及び第９７条第１項の規定により終了した清算約定に係る通貨の破綻処理清算約定を除く。）に関する破綻処理損失のために取崩しをする再配分第三階層特別清算料として配分する。	（新設）
（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、第１０５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（当社が規則で定めるものを除く。）がある場合には、破綻認定日における破	（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

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当該破綻処理損失に係る破綻処理清算約定と同一の通貨の種類である通貨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、当該破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに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。	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　前項の破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとの第四階層特別清算料の額は、通貨の種類ごとの破綻処理清算約定等に係る損失相当額（破綻認定日（当該破綻認定日に当社と破綻清算参加者との間で当該通貨の破綻処理清算約定に係る決済が終了している場合には、当該破綻認定日の翌当社営業日。以下本項について同じ。）から当初損失確定日までの各当社営業日において、当該通貨の種類ごとの破綻処理清算約定について当社が破綻清算参加者から受領できなかった変動証拠金等の総額並びに第９３条第２項の規定により清算約定とみなされた当該通貨の通貨ごとの損失回避取引及びクロスマージン処分取引について、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を合計した額が正数である場合の当該額をいう。）を、各第四階層特別清算料負担参加者に係る利益相当額（破綻認定日から当初損失確定日までの間に、各第四階層特別清算料負担	２　前項の第四階層特別清算料の額は、破綻処理清算約定等に係る損失相当額（破綻認定日（当該破綻認定日に当社と破綻清算参加者との間で破綻処理清算約定に係る決済が終了している場合には、当該破綻認定日の翌当社営業日。以下本項について同じ。）から当初損失確定日までの各当社営業日において、破綻処理清算約定の反対清算約定及び第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、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。）を、各第四階層特別清算料負担参加者に係る利益相当額（破綻認定日から当初損失確定日までの間に、各第四階層特別清算料負担参加者を当事者とするすべての清算約定に係る変動証拠金等の総受取額から総支払額を控除した額が正数である場合の当該額をいう。）で按分した額を上限として当社が規則で定める額とする。

参加者を当事者とする当該通貨の種類ごとのすべての清算約定に係る変動証拠金等の総受取額から総支払額を控除した額が正数である場合の当該額をいう。）で按分した額を上限として当社が規則で定める額とする。	
３　当社は、第１項に規定する第１０５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から除かれるものを、証券取引等業務方法書が定めるところにより補填する。	（新設）
（破綻時証拠金の預託） 第１０８条　（略）	（破綻時証拠金の預託） 第１０８条　（略）
２　破綻時証拠金の預託を受けた当社は、本業務方法書等の定めるところにより、破綻時証拠金（金銭を異なる通貨へ両替した際に要した費用及び代用有価証券の換価処分に要した費用を控除した残額。以下本項において同じ。）を被担保債務の弁済に充当し、又は破綻時証拠金の返還請求権と被担保債務に係る債権とを対当額で相殺することができる。	２　破綻時証拠金の預託を受けた当社は、本業務方法書等の定めるところにより、破綻時証拠金（破綻時証拠金が代用有価証券である場合には、その換価処分後の金銭から当該換価処分に要した費用を控除した残額。以下本項において同じ。）を被担保債務の弁済に充当し、又は破綻時証拠金の返還請求権と被担保債務に係る債権とを対当額で相殺することができる。
３～７　（略）	３～７　（略）
（最終損失確定時の調整） 第１１０条　第１０１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の合計額を上回るときは、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、当該損失に係る通貨の種類の破綻処理清算約定ごとに、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。	（最終損失確定時の調整） 第１１０条　第１０１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１０３条第１項第１号の規定により通貨の種類ごとに按分された第一階層金利スワップ決済保証準備金の取崩し	（１）　第一階層金利スワップ決済保証準備金の取崩し
（２）　第１０３条第１項第２号の規定により	（２）　破綻清算参加者以外の各清算参加者が

通貨の種類ごとに按分された破綻清算参加者以外の各清算参加者が当社に預託した金利スワップ清算基金（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金利スワップ清算基金所要額から第１０３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。）及び同号の規定により通貨の種類ごとに按分された第二階層金利スワップ決済保証準備金の取崩し	当社に預託した金利スワップ清算基金（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金利スワップ清算基金所要額から第１０３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。）及び第二階層金利スワップ決済保証準備金の取崩し
（３）・（４）　（略）	（３）・（４）　（略）
２　（略）	２　（略）
（最終損失確定後における通貨間の損失補填財源の調整） 第１１０条の２　前条の規定に従い確定した破綻処理損失について補填を行った結果、破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとのいずれかの破綻処理損失を補填するために損失補填財源を費消する場合において、当社は、当社が規則で定めるところにより、損失補填財源を通貨の種類間で調整することができる。	（新設）
（破綻清算参加者からの回収金等の分配） 第１１１条　当社は、破綻清算参加者の破綻処理を行った場合において、次の各号に掲げる場合に応じて、当該各号に掲げる額を、当社が規則で定めるところにより当社が規則で定める者に分配する。	（破綻清算参加者からの回収金等の分配） 第１１１条　当社は、破綻清算参加者の破綻処理を行った場合において、次の各号に掲げる場合に応じて、当該各号に掲げる額を、当社が規則で定めるところにより清算参加者（当社が規則で定める者に限る。）に分配する。
（１）・（２）　（略）	（１）・（２）　（略）
２　当社は、前項各号に掲げる額の分配を受ける者が存在しない場合には、当社が規則で定めるところにより当該額の処理を行う。	２　当社は、前項各号に掲げる額の分配を受ける清算参加者が存在しない場合には、当社が規則で定めるところにより当該額の処理を行う。

付　　則 １　この改正規定は、平成２７年９月２４日から施行する。 ２　前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社が設置するシステムの稼働に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、平成２７年９月２４日以後の当社が定める日から施行する。	

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
（定義） 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。 （１）　（略） （２）　「金利スワップ取引清算業務システム」とは、当社の金利スワップ取引清算業務に関して当社と清算参加者との間で情報を授受するために用いるシステムをいう。 （２）の２～（５）　（略） （６）　「限月取引」とは、証券取引等業務方法書第７３条の６第１項に規定する限月取引をいう。 （７）　「清算値段」とは、証券取引等業務方法書第７３条の７に規定する国債証券先物取引における清算値段をいう。 （８）　「Ｌａｒｇｅ取引」とは、証券取引等業務方法書第７３条の１０第１項に規定するＬａｒｇｅ取引をいう。 （９）　「Ｍｉｎｉ取引」とは、証券取引等業務方法書第７３条の９の２に規定するＭｉｎｉ取引をいう。	（定義） 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。 （１）　（略） （２）　「金利スワップ取引清算業務システム」とは、当社の金利スワップ取引清算業務に関して清算参加者が当社より情報を取得するために用いるシステムをいう。 （２）の２～（５）　（略） （新設） （新設） （新設） （新設）
（保証に関する書面） 第３条　業務方法書第２条第１項第４号及び第８条第４項に規定する当社が定める様式は、別紙様式第１号の様式とする。	（保証に関する書面） 第３条　業務方法書第２条第１項第４号及び第８条第５項に規定する当社が定める様式は、別紙様式第１号の様式とする。
（クロスマージンを行うことができる国債証券先物取引）	

第３条の２　業務方法書第２条第１項第１３号の５に規定する当社が定める国債証券先物取引は、次に掲げるものとする。 （１）　Ｌａｒｇｅ取引のうち最初に取引最終日が到来する限月取引（取引最終日まで３当社営業日以内となったものを除く。）及び当該限月取引の次に取引最終日が到来する限月取引 （２）　Ｍｉｎｉ取引のうち前号に規定するＬａｒｇｅ取引と取引最終日の属する月を同一とする限月取引（取引最終日まで２当社営業日以内となったものを除く。）	（新設）
（指定市場開設者） 第３条の３　業務方法書第２条第１項第２３号の２に規定する当社が定める指定市場開設者は、株式会社大阪取引所とする。	（新設）
（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号を除くすべての要件）とする。 （１）～（４）　（略） （５）　変動金利の決定方法が次のａからｇ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ｇに定める期間であること。 ａ　ＪＰＹ－ＬＩＢＯＲ－ＢＢＡ　１か月、３か月又は６か月 ｂ　ＪＰＹ－ＴＩＢＯＲ－ＺＴＩＢＯＲ　１か月、３か月又は６か月 ｃ　ＪＰＹ－ＴＩＢＯＲ－１７０９７　１か月、３か月又は６か月	（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号を除くすべての要件）とする。 （１）～（４）　（略） （５）　変動金利の決定方法が次の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。 ａ　ＪＰＹ－ＬＩＢＯＲ－ＢＢＡ　３か月又は６か月 ｂ　ＪＰＹ－ＴＩＢＯＲ－ＺＴＩＢＯＲ　３か月又は６か月 ｃ　ＪＰＹ－ＴＩＢＯＲ－１７０９７　３か月又は６か月

ｄ　ＪＰＹ‐ＴＯＮＡ‐ＯＩＳ‐ＣＯＭＰＯＵＮＤ　１日 ｅ　ＵＳＤ－ＬＩＢＯＲ－ＢＢＡ　１か月、３か月又は６か月 ｆ　ＥＵＲ－ＥＵＲＩＢＯＲ－Ｔｅｌｅｒａｔｅ又はＥＵＲ－ＥＵＲＩＢＯＲ－Ｒｅｕｔｅｒｓ　３か月又は６か月 ｇ　ＡＵＤ－ＢＢＲ－ＢＢＳＷ　３か月又は６か月	ｄ　ＪＰＹ‐ＴＯＮＡ‐ＯＩＳ‐ＣＯＭＰＯＵＮＤ　１日
（６）　（略）	（６）　（略）
（７）　想定元本及び決済通貨が次のａからｄ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からｄまでに定める通貨であること。 ａ　ＪＰＹ‐ＬＩＢＯＲ‐ＢＢＡ、ＪＰＹ‐ＴＩＢＯＲ‐ＺＴＩＢＯＲ、ＪＰＹ‐ＴＩＢＯＲ‐１７０９７又はＪＰＹ‐ＴＯＮＡ‐ＯＩＳ‐ＣＯＭＰＯＵＮＤ　日本円 ｂ　ＵＳＤ－ＬＩＢＯＲ－ＢＢＡ　米ドル ｃ　ＥＵＲ－ＥＵＲＩＢＯＲ－Ｔｅｌｅｒａｔｅ又はＥＵＲ－ＥＵＲＩＢＯＲ－Ｒｅｕｔｅｒｓ　ユーロ ｄ　ＡＵＤ－ＢＢＲ－ＢＢＳＷ　オーストラリア・ドル	（７）　想定元本及び決済通貨が日本円であること。
（８）　（略）	（８）　（略）
（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ｄまでに掲げる金利スワップ取引ごとに、当該ａからｄまでに定める期間であること。 ａ　変動金利としてＪＰＹ－ＴＩＢＯＲ－１７０９７又はＡＵＤ－ＢＢＲ－ＢＢＳＷ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、ＥＵＲ－ＥＵＲＩＢＯＲ－Ｔｅｌｅｒａｔｅ又はＥＵＲ－ＥＵＲＩＢＯ	（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

Ｒ－Ｒｅｕｔｅｒｓ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	る取引に該当するものを除く。）　３日以上７，３１８日以内
ｃ　変動金利としてＵＳＤ－ＬＩＢＯＲ－ＢＢＡであるものを対象とする金利スワップ取引　３日以上１０，９７１日以内	
ｄ　上記ａからｃに掲げる金利スワップ取引以外の金利スワップ取引　３日以上１４，６２３日以内	ｃ　上記ａ又はｂに掲げる金利スワップ取引以外の金利スワップ取引　３日以上１４，６２３日以内
（１０）　想定元本の金額が、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及び次の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に定める事項を満たすこと。	（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　変動金利としてＪＰＹ‐ＬＩＢＯＲ‐ＢＢＡ、ＪＰＹ‐ＴＩＢＯＲ‐ＺＴＩＢＯＲ、ＪＰＹ‐ＴＩＢＯＲ‐１７０９７又はＪＰＹ‐ＴＯＮＡ‐ＯＩＳ‐ＣＯＭＰＯＵＮＤであるものを対象とする金利スワップ取引　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。	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　変動金利としてＵＳＤ－ＬＩＢＯＲ－ＢＢＡ、ＥＵＲ－ＥＵＲＩＢＯＲ－Ｔｅｌｅｒａｔｅ、ＥＵＲ－ＥＵＲＩＢＯＲ－Ｒｅｕｔｅｒｓ又はＡＵＤ－ＢＢＲ－ＢＢＳＷであるものを対象とする金利スワップ取引　通貨単位が１００分の１以上４兆未満であり、かつ、小数点第３位以下の桁がすべて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）・（１２）　（略）	（１１）・（１２）　（略）
（１３）　金利支払日に係る営業日として、次のａからｄまでに掲げる変動金利の決定方法	（１３）　金利支払日に係る営業日として東京が指定されていること（東京以外の都市が指

の金利スワップ取引ごとに、当該ａからｄまでに定める都市又は営業日が指定されていること（東京以外の都市が指定されている場合を含む。）。 ａ　変動金利としてＪＰＹ‐ＬＩＢＯＲ‐ＢＢＡ、ＪＰＹ‐ＴＩＢＯＲ‐ＺＴＩＢＯＲ、ＪＰＹ‐ＴＩＢＯＲ‐１７０９７又はＪＰＹ‐ＴＯＮＡ‐ＯＩＳ‐ＣＯＭＰＯＵＮＤであるものを対象とする金利スワップ取引　東京 ｂ　変動金利としてＵＳＤ－ＬＩＢＯＲ－ＢＢＡであるものを対象とする金利スワップ取引　ニューヨーク ｃ　変動金利としてＥＵＲ－ＥＵＲＩＢＯＲ－Ｔｅｌｅｒａｔｅ又はＥＵＲ－ＥＵＲＩＢＯＲ－Ｒｅｕｔｅｒｓであるものを対象とする金利スワップ取引　Ｔａｒｇｅｔ営業日 ｄ　変動金利としてＡＵＤ－ＢＢＲ－ＢＢＳＷであるものを対象とする金利スワップ取引　シドニー	定されている場合を含む。）。
（１４）　金利更改日に係る営業日として、次のａからｄまで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からｄまでに定める都市又は営業日が指定されていること（東京以外の都市が指定されている場合を含む。）。 ａ　変動金利としてＪＰＹ－ＴＩＢＯＲ－ＺＴＩＢＯＲ、ＪＰＹ‐ＴＩＢＯＲ‐１７０９７又はＪＰＹ‐ＴＯＮＡ‐ＯＩＳ‐ＣＯＭＰＯＵＮＤであるものを対象とする金利スワップ取引　東京 ｂ　変動金利としてＥＵＲ－ＥＵＲＩＢＯＲ－Ｔｅｌｅｒａｔｅ又はＥＵＲ－ＥＵＲＩＢＯＲ－Ｒｅｕｔｅｒｓであるものを対象とする金利スワップ取引　Ｔａｒｇｅｔ営	（１４）　金利更改日に係る営業日としてロンドン又は東京が指定されていること。

業日 ｃ　変動金利としてＡＵＤ－ＢＢＲ－ＢＢＳＷであるものを対象とする金利スワップ取引　シドニー ｄ　変動金利としてＪＰＹ‐ＬＩＢＯＲ‐ＢＢＡ又はＵＳＤ－ＬＩＢＯＲ－ＢＢＡであるものを対象とする金利スワップ取引　ロンドン （１５）　（略）	（１５）　（略）
（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）・（２）　（略） （３）　換価処分 当社は、次に掲げる場合には、清算参加者又は清算委託者から預託を受けた代用有価証券を当社が相当と認める方法、時期、価格等により処分（当該処分による取得金の異なる通貨への両替又は異なる通貨での処分を含む。）し、又は代用有価証券に基づく権利を直接行使したうえで、その取得金からこれらの処分等に要した費用を控除した残額を、当該清算参加者の当社に対する債務の弁済に充当し、又は業務方法書第１０３条第１項若しくは第１１０条第１項の規定による損失の補填に充てることができる。 ａ～ｄ　（略） （４）　（略）	（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）・（２）　（略） （３）　換価処分 当社は、次に掲げる場合には、清算参加者又は清算委託者から預託を受けた代用有価証券を当社が相当と認める方法、時期、価格等により処分（外貨建ての代用有価証券にあっては、当該処分による取得金の日本円への両替又は日本円での処分を含む。）し、又は代用有価証券に基づく権利を直接行使したうえで、その取得金からこれらの処分等に要した費用を控除した残額を、当該清算参加者の当社に対する債務の弁済に充当し、又は業務方法書第１０３条第１項若しくは第１１０条第１項の規定による損失の補填に充てることができる。 ａ～ｄ　（略） （４）　（略）
（報告事項） 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	（報告事項） 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）　金融商品取引法（昭和２３年法律第２５号）第２９条の２第２項第２号又は同法第３３条の３第２項第２号に基づく損失の危険の管理方法、業務分掌の方法その他の業務の内容及び方法を定めたとき又は変更したとき（外国銀行にあっては、第１４条第２項に定める金利スワップ清算資格取得申請書の添付書類における同項第４号に掲げる事項を変更したとき）（軽微な変更を除く。）。 （２）～（６）　（略） （６）の２　業務方法書第２条第１項第５９号ｇに規定する清算参加者にあっては、先物・オプション取引口座設定約諾書又は国債先物等清算受託契約書の定めるところにより当然に期限の利益を喪失したとき。 （６）の３　その清算参加者口座にクロスマージン対象国債先物清算約定が記録されている清算参加者であって、かつ、当該クロスマージン対象国債先物清算約定に係るクロスマージン利用者が業務方法書第２条第１項第１３号の８ｄに掲げる者に該当する場合にあっては、当該クロスマージン利用者が国債証券先物取引を委託する国債先物等非清算参加者が先物・オプション取引口座設定約諾書の定めるところにより当然に期限の利益を喪失したとき。 （７）～（３６）　（略）	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）　金融商品取引法（昭和２３年法律第２５号）第２９条の２第２項第２号又は同法第３３条の３第２項第２号に基づく損失の危険の管理方法、業務分掌の方法その他の業務の内容及び方法を定めたとき又は変更したとき（外国銀行にあっては、第１８条第２項に定める金利スワップ清算資格取得申請書の添付書類における同項第４号に掲げる事項を変更したとき）（軽微な変更を除く。）。 （２）～（６）　（略） （新設） （新設） （７）～（３６）　（略）
２～４　（略）	２～４　（略）
（リスク量が大きい場合における当初証拠金所要額の引上げ） 第２３条　業務方法書第２９条第２項に規定する当社が定めるリスク量は、清算参加者の自己取	（リスク量が大きい場合における当初証拠金所要額の引上げ） 第２３条　業務方法書第２９条第２項に規定する当社が定めるリスク量は、清算参加者の自己取

引口座又は委託取引口座に記録されている円貨建清算約定、豪ドル建清算約定、米ドル建清算約定又はユーロ建清算約定ごとに、当社が通知により定める区分に応じて算出したＰＶ０１（金利水準が１ベーシスポイント変動した場合における正味現在価値の変化額として当社が通知により定める方法により算出した額をいう。次項において同じ。）とし、同項に規定する水準は、通知により定める。	引口座又は委託取引口座ごとに、当社が通知により定める区分ごとに算出したＰＶ０１（金利水準が１ベーシスポイント変動した場合における正味現在価値の変化額として当社が通知により定める方法により算出した額をいう。次項において同じ。）とし、同項に規定する水準は、通知により定める。
２　クロスマージン利用者である清算参加者の自己取引口座又はクロスマージン利用者である清算委託者のために設定された委託取引口座に関する前項の規定の適用については、同項中「円貨建清算約定」とあるのは「円貨建清算約定、クロスマージン対象国債先物清算約定」と、「正味現在価値」とあるのは「正味現在価値（クロスマージン対象国債先物清算約定にあってはその現在価値（クロスマージン対象国債先物清算約定に係る国債証券先物取引について当社が通知又は公示により定める方法により、想定される将来キャッシュフローをもとに算出した額をいう。））」とする。	（新設）
３　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２項の規定により算出したＰＶ０１の水準が同項の規定により定める水準を超過した額（外貨建清算約定にあっては、当該超過額に当社が公示により定める為替相場の気配値を乗じた額）に、基準ベーシスポイント（ＰＶ０１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、当社が第１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。	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ＰＶ０１の水準が同項の規定により定める水準を超過した額に、基準ベーシスポイント（ＰＶ０１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。

（信用状況に応じた清算参加者に対する措置） 第２４条　（略） ２　業務方法書第３２条第１項第１号ａに規定する当社の定める水準は、清算参加者の自己資本規制比率（特別金融商品取引業者である場合は自己資本規制比率及び連結自己資本規制比率。以下本条において同じ。）については２５０パーセントと、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に該当するときとする。 ３　業務方法書第３２条第１項第１号ｂに規定する当社の定める水準は、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）・（２）　（略） ４　業務方法書第３２条第１項第１号ｃに規定する当社の定める水準は、清算参加者の単体又は連結ソルベンシー・マージン比率については５００パーセントと、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に該当するときとする。 ５　業務方法書第３２条第１項第２号ａに規定する当社の定める水準は、清算参加者の自己資本規制比率については２５０パーセントと、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に該当するときとする。 ６　業務方法書第３２条第１項第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）・（２）　（略） ７　業務方法書第３２条第１項第２号ｃに規定する当社の定める水準は、清算参加者の単体又は	（信用状況に応じた清算参加者に対する措置） 第２４条　（略） ２　業務方法書第３２条第１号ａに規定する当社の定める水準は、清算参加者の自己資本規制比率（特別金融商品取引業者である場合は自己資本規制比率及び連結自己資本規制比率。以下本条において同じ。）については２５０パーセントと、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に該当するときとする。 ３　業務方法書第３２条第１号ｂに規定する当社の定める水準は、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）・（２）　（略） ４　業務方法書第３２条第１号ｃに規定する当社の定める水準は、清算参加者の単体又は連結ソルベンシー・マージン比率については５００パーセントと、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に該当するときとする。 ５　業務方法書第３２条第２号ａに規定する当社の定める水準は、清算参加者の自己資本規制比率については２５０パーセントと、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に該当するときとする。 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）・（２）　（略） ７　業務方法書第３２条第２号ｃに規定する当社の定める水準は、清算参加者の単体又は連結ソ

連結ソルベンシー・マージン比率については５００パーセントと、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に該当するときとする。	ルベンシー・マージン比率については５００パーセントと、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に該当するときとする。
８　業務方法書第３２条第１項第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。	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）～（５）　（略）	（１）～（５）　（略）
（バックアップ受託者の指定等）	（バックアップ受託者の指定等）
第２６条の２　業務方法書第４５条の２第３項に規定する当社に対する届出は、清算約定の通貨ごとにバックアップ受託者の指定を行っている場合には、その旨を明らかにしたうえで届け出るものとする。	（新設）
２　（略）	第２６条の２　（略）
３　（略）	２　（略）
（債務負担に係る条件等）	（債務負担に係る条件等）
第２８条　業務方法書第４９条第１項に規定する当社が定める条件は、同項の適格金利スワップ取引が次に掲げる要件のすべて（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適格金利スワップ取引にあっては、第１号に掲げる要件に限る。）を満たすこととする。	第２８条　業務方法書第４９条第１項に規定する当社が定める条件は、同項の適格金利スワップ取引が次に掲げる要件のすべて（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適格金利スワップ取引にあっては、第１号に掲げる要件に限る。）を満たすこととする。
（１）　（略）	（１）　（略）
（２）　次項各号に係る債務負担の申込みについて業務方法書第４９条第１項の規定により債務負担要件の確認を行う日からその翌当社営業日までの日が金利支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。	（２）　次項各号に係る債務負担の申込みについて業務方法書第４９条第１項の規定により債務負担要件の確認を行う日又はその翌当社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。
２～７　（略）	２～７　（略）
（清算約定の取引毎コンプレッションの申込みの	（清算約定の任意解約の申込みの方法等）

方法等） 第３０条　業務方法書第５３条第１項及び第５項に規定する当社が定める方法は、取引毎コンプレッションを行おうとする自己取引口座又は委託取引口座に記録されている清算約定を、金利スワップ取引清算業務システムを用いて指定する方法とする。	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　清算参加者が自己取引口座又は委託取引口座（業務方法書第５９条第３項又は第４項の規定により自己取引口座又は委託取引口座を複数に区分する口座が設定されている場合は、当該区分口座。以下本項において同じ。）に記録されることとなる清算約定について取引毎コンプレッションの申込みを行おうとする場合には、当社に対して、あらかじめその旨を届け出るものとする。この場合において、当社が当該届出を受理した日以降新たに当該自己取引口座又は委託取引口座に記録される清算約定は、その記録時点で前項の規定に従い当社に対して取引毎コンプレッションの申込みが行われたものとみなす。	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。
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、次の各号に掲げる清算約定の区分に応じて、当該各号に定めるものとする。 （１）　取引毎コンプレッションの申込みに係る清算約定	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。

ａ　取引毎コンプレッション要件の確認を行う日からその翌当社営業日までの日が金利支払日にあたらないこと。 ｂ　アップフロントフィーの決済日が取引毎コンプレッション要件の確認を行う日以前であること。 ｃ　変動金利の決定方法その他の経済条件のうち、当社が通知又は公示により指定する経済条件が、取引毎コンプレッションの申込みが行われた他の清算約定のいずれかと合致していること。 （２）　取引毎コンプレッションにより新たに成立する清算約定 第９条第１項第１０号に規定する要件を満たすこと。	
４　当社は、当社営業日の午後４時までに行われた業務方法書第５３条第１項に規定する取引毎コンプレッションの申込み（同条第４項の規定により取引毎コンプレッションの申込みが行われたとみなされたものを含む。）について、同条第２項の規定による取引毎コンプレッション要件の確認を、同日の午後４時以降速やかに行うものとする。	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。
５　取引毎コンプレッションにより新たに成立する清算約定について当該取引毎コンプレッションの申込みが行われた清算約定と同一となる経済条件その他新たに成立する清算約定に関する事項は、当社が通知又は公示により定める。	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。）を行った時点とする。
６　業務方法書第５３条第３項に規定する当社が定める債権債務は、同条第２項に規定する取引毎コンプレッション要件の充足を確認することができたときに既に発生している当該取引毎コンプレッションの申込みの対象である外貨建清算約定に係る預託又は支払いが完了していない変動証拠金等に関する債権債務とする。	（新設）
７　業務方法書第５３条第４項に規定する当社が	（新設）

定める時点は、取引毎コンプレッション要件の確認を行った日の翌当社営業日の午前８時３０分とする。	
８　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、取引毎コンプレッション要件の確認を行わないこととし又は取引毎コンプレッション要件の確認を行う時間を変更することができる。この場合において、当社は、当該確認を行わないこと又は当該確認を行う時間を変更すること及びその変更後の時間を、遅滞なく清算参加者に通知するものとする。	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、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。
（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、ＴｒｉＯｐｔｉｍａ　ＡＢの提供するｔｒｉＲｅｄｕｃｅを用いて申込みをするものとする。	（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ＴｒｉＯｐｔｉｍａ　ＡＢの提供するｔｒｉＲｅｄｕｃｅ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　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。 （１）　一括コンプレッション成立要件の確認を行う日からその翌当社営業日までの日が、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金利支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。 （２）　（略）	２　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。 （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ないこと。 （２）　（略）
３　（略）	３　（略）

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債権債務は、同条第２項に規定する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ときに既に発生している当該一括コンプレッションの申込みの対象である外貨建清算約定に係る預託又は支払いが完了していない変動証拠金等に関する債権債務とする。	（新設）
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。	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。
６　業務方法書第５３条の２第５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。	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。
７　業務方法書第５３条の２第６項に規定する解約手数料は、一括コンプレッションが成立した翌々当社営業日に当社と一括コンプレッションにより終了した清算約定の当事者である清算参加者との間で授受するものとする。	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。
８　第３項、第５項及び第６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。	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。
（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ごとのリスクに係る制限とする。	（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　（略）	２　（略）
（清算約定（委託分）に関する一括コンプレッションの申込み）	（清算約定（委託分）に関する任意解約又は一括コンプレッションの申込み）
（削る）	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。
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、当社が通知又は公示により定める。	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。
２　（略）	３　（略）
（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）	（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）
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円貨建清算約定、豪ドル建清算約定、米ドル建清算約定又はユーロ建清算約定ごとに算出するものとする。	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。
（１）・（２）　（略）	（１）・（２）　（略）
２　（略）	２　（略）
（承継又は移管が行われた場合の債権債務に関する事項）	
第３５条の４の２　業務方法書第５８条の３第３項及び第５８条の５第４項に規定する当社が定める債権債務は、次の各号に掲げる区分に応じて、同第５８条の３第１項及び同第５８条の５第１項に規定する債務負担時所要証拠金の額が当社に対して預託又は交付されていることを確認するときに既に発生している当該各号に定める債権債務とする。	（新設）
（１）　外貨建清算約定	
当該清算約定に係る預託又は支払いが完了	

していない変動証拠金等に関する債権債務 （２）　外貨建清算約定に係る清算委託取引 当該清算委託取引に基づく支払いが完了していない決済金額に係る債権債務	
（清算委託取引終了時の当初証拠金の返還） 第３７条　（略） ２　（略） ３　受託清算参加者は、前項の規定により当社から交付を受けた当初証拠金（当初証拠金が金銭である場合には、当該金銭を異なる通貨へ両替した際に要した費用を控除した後の残額を、当初証拠金が代用有価証券である場合には、清算受託契約の定めるところにより、当該代用有価証券の代用価格の計算における時価に相当する金銭又は当該代用有価証券の換価処分に要した費用を控除した後の残額に限る。）を、清算受託契約の定めるところにより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。）及び当該清算委託者が、当該清算委託者の委託取引口座に記録されたクロスマージン対象国債先物清算約定に関して当該受託清算参加者に対して負担する債務に充当し、その残額を当該清算委託者に返還する。	（清算委託取引終了時の当初証拠金の返還） 第３７条　（略） ２　（略） ３　受託清算参加者は、前項の規定により当社から交付を受けた当初証拠金（当初証拠金が代用有価証券である場合には、清算受託契約の定めるところにより、当該代用有価証券の代用価格の計算における時価に相当する金銭又は当該代用有価証券の換価処分後の金銭）を、清算受託契約の定めるところにより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。）に充当し、その残額を当該清算委託者に返還する。
（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、次の各号に掲げる通貨の清算約定ごとに、当該各号に定める方法とする。	（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（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

（１）　円貨建清算約定 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（業務方法書第５３条第２項の規定に従い当社が取引毎コンプレッション要件の充足の確認を行ったときは、当該確認を行った時点をいい、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、当該承諾の時点をいう。以下本号において同じ。）における円貨建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時の時点における円貨建清算約定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 （２）　豪ドル建清算約定 前号に定める方法を準用する。この場合において、「算出日の前当社営業日」とあるのは「算出日の直前の当社営業日かつシドニー営業日である日」と、「円貨建清算約定」とあるのは「豪ドル建清算約定」と読み替えるものとする。 （３）　米ドル建清算約定	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ルド・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。

第１号に定める方法を準用する。この場合において、「算出日の前当社営業日」とあるのは「算出日の直前の当社営業日かつニューヨーク営業日である日」と、「円貨建清算約定」とあるのは「米ドル建清算約定」と読み替えるものとする。 （４）　ユーロ建清算約定 第１号に定める方法を準用する。この場合において、「算出日の前当社営業日」とあるのは「算出日の直前の当社営業日かつＴａｒｇｅｔ営業日である日」と、「午後３時２分における清算イールド・カーブ」とあるのは「午前１１時２分における清算イールド・カーブ」と、「円貨建清算約定」とあるのは「ユーロ建清算約定」と読み替えるものとする。	
２　前項第１号における円貨建清算約定に係る正味現在価値の算出において、当該正味現在価値が固定金額又は変動金額を授受する日の前当社営業日に係るものである場合は、当該正味現在価値から、当該固定金額及び変動金額の受領額を差し引き、かつ支払額を加算するものとする。	２　前項における正味現在価値の算出において、当該正味現在価値が固定金額又は変動金額を授受する日の前当社営業日に係るものである場合は、当該正味現在価値から、当該固定金額及び変動金額の受領額を差し引き、かつ支払額を加算するものとする。
３　前項の規定は、第１項第２号から第４号に定める外貨建清算約定に係る正味現在価値の算出に準用する。この場合において、「円貨建清算約定」とあるのは「外貨建清算約定」と、「固定金額又は変動金額を授受する日の前当社営業日に係るものである場合は」とあるのは「固定金額又は変動金額を授受する日が休業日かつ外貨本国営業日である日である場合であって、当該固定金額又は変動金額を授受する日の前当社営業日に係るものであるときは」と読み替える。	（新設）
（清算参加者の指定等） 第３９条　業務方法書第７９条第２項の指定（以下本条において単に「指定」という。）を受けようとする清算参加者は、当社所定の指定申請	（清算参加者の指定等） 第３９条　業務方法書第７９条第２項の指定（以下本条において単に「指定」という。）を受けようとする清算参加者は、当社所定の指定申請

書を、当該指定を受けようとする金利スワップ取引に係る気配値の範囲を明らかにしたうえで当社に提出して申請するものとする。	書を当社に提出して申請するものとする。
２～４　（略）	２～４　（略）
（清算イールド・カーブの決定方法等） 第４０条　業務方法書第７９条第１項及び第２項に規定する当社が定める時刻は、次の各号に掲げる通貨の金利スワップ取引に係る気配値に応じて、当該各号に定める各時刻とする。 （１）　ユーロ建ての金利スワップ取引に係る気配値　午前１１時２分及び午後５時３０分（ロンドンにおいて夏時間が実施されている期間にあっては、午前１１時２分及び午後４時３０分） （２）　前号に掲げる金利スワップ取引以外の金利スワップ取引に係る気配値　午前１１時２分及び午後３時２分	（清算イールド・カーブの決定方法等） 第４０条　業務方法書第７９条第１項及び第２項に規定する当社が定める時刻は、午前１１時２分及び午後３時２分の各時刻とする。
２～４　（略）	２～４　（略）
（変動証拠金に係る利息の算出） 第４２条　業務方法書第８３条第１項に規定する当社が定める基準金利は、次の各号に掲げる通貨の清算約定に応じて、当該各号に定める金利とする。 （１）　円貨建清算約定　日本銀行が公表する無担保コールオーバーナイト物レートの加重平均値 （２）　豪ドル建清算約定　オーストラリア準備銀行が公表するＡｕｓｔｒａｌｉａｎ Ｏｖｅｒｎｉｇｈｔ Ｉｎｄｅｘ Ａｖｅｒａｇｅ （３）　米ドル建清算約定　米国連邦準備銀行が公表するＦｅｄｅｒａｌ Ｆｕｎｄｓ Ｒａｔｅ （４）　ユーロ建清算約定　欧州中央銀行が公	（変動証拠金に係る利息の算出） 第４２条　業務方法書第８３条第１項に規定する当社が定める基準金利は、日本銀行が公表する無担保コールオーバーナイト物レートの加重平均値とする。

表するＥｕｒｏ Ｏｖｅｒｎｉｇｈｔ Ｉｎｄｅｘ Ａｖｅｒａｇｅ	
２　変動証拠金に係る利息は、次の各号に掲げる通貨の清算約定に応じて、当該各号に定める算式により算出した額を合計した額とする。 （１）　円貨建清算約定　算出日の前当社営業日において当社又は各清算参加者に預託されている円貨建清算約定に係る変動証拠金×基準金利×算出日の前当社営業日から算出日までの日数／３６５日 （２）　豪ドル建清算約定　算出日において当社又は各清算参加者に預託されている豪ドル建清算約定に係る変動証拠金×基準金利×算出日の直前の当社営業日かつシドニー営業日である日から算出日までの日数／３６５日 （３）　米ドル建清算約定　算出日において当社又は各清算参加者に預託されている米ドル建清算約定に係る変動証拠金×基準金利×算出日の直前の当社営業日かつニューヨーク営業日である日から算出日までの日数／３６０日 （４）　ユーロ建清算約定　算出日において当社又は各清算参加者に預託されているユーロ建清算約定に係る変動証拠金×基準金利×算出日の直前の当社営業日かつＴａｒｇｅｔ営業日である日から算出日までの日数／３６０日	２　変動証拠金に係る利息は、次の算式により算出する。 変動証拠金に係る利息＝算出日において当社又は各清算参加者に預託されている変動証拠金の総額×基準金利×１日／３６５日 （注）休業日においては、直近の当社営業日における変動証拠金の総額及び基準金利を用いる。
第５章の２　クロスマージン制度	（新設）
（クロスマージン制度利用の届出） 第４２条の２　業務方法書第８４条の２第１項に規定する当社への届出は、次の各号に掲げる者に関する当該各号に定める事項（第４号に掲げる者に関する同号に定める事項については、同号のクロスマージン利用者となる者が業務方法	（新設）

書第２条第１項第１３号の８ｄに掲げる者に該当する場合に限る。）を記載した当社所定の届出書を当社に提出して行うものとする。この場合において、届出書を提出しようとする清算参加者は、あらかじめ第２号から第４号までに掲げる者との間で第３号に掲げる者のクロスマージン制度の利用に関して合意しなければならない。

（１）　当該清算参加者

ａ　商号又は名称（英文の商号又は名称を含む。）

ｂ　本店又は主たる事務所の所在地

ｃ　代表者の氏名

（２）　クロスマージン申請者となる国債先物等清算参加者

前号ａからｃまでに掲げる事項

（３）　クロスマージン利用者となる者

第１号ａからｃまでに掲げる事項

（４）　クロスマージン利用者となる者が国債証券先物取引を委託する国債先物等非清算参加者

第１号ａからｃまでに掲げる事項

２　清算参加者は、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第８条第３項の規定に従い当社に届け出られている清算委託者について、前項第３号に掲げるクロスマージン利用者となる者として届け出ることができない。

３　清算参加者は、既にクロスマージン利用者である者を、第１項第３号に掲げるクロスマージン利用者となる者として届け出ることができない。

４　第１項の届出書には、当社が必要と認める書類を添付しなければならない。

（クロスマージン制度利用の届出の変更）

第４２条の３　業務方法書第８４条の２第２項に規定する当社への届出は、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行うものとする。当該届出によりクロスマージン利用者に係る次に掲げる者を変更しようとする場合には、届出書を提出しようとする清算参加者は、あらかじめ当該変更後の次の各号に掲げる者及び当該クロスマージン利用者との間で、当該クロスマージン利用者によるクロスマージン制度の利用に関して合意しなければならない。 （１）　クロスマージン申請者 （２）　クロスマージン利用者が国債証券先物取引を委託する国債先物等非清算参加者 （クロスマージン制度利用の取りやめの届出）	（新設）
第４２条の４　業務方法書第８４条の３に規定する当社への届出は、クロスマージン制度の利用を取りやめようとするクロスマージン利用者及び当該利用者に係る前条各号に掲げる者に係る次に掲げる事項を記載した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 （クロスマージンの承諾等に係る通知方法）	（新設）
第４２条の５　業務方法書第８４条の４第１項及び第２項に規定するクロスマージンの申請の内容に係る清算参加者への通知の方法及び清算参加者から当社への当該申請に対する諾否の通知の方法は、金利スワップ清算業務システムを用いる方法とする。 （クロスマージンの承諾を行うための要件）	（新設）

第４２条の６　業務方法書第８４条の４第１項に規定する当社が定める要件は、クロスマージンの申請に係るクロスマージン利用者である清算参加者について、当社が、当該申請時点において、当該クロスマージンの申請の対象となった国債証券先物取引の建玉をクロスマージン制度の対象としたと仮定して算出した清算約定（自己分）の当初証拠金所要額に相当する額（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した額とする。以下本条において同じ。）が、当該建玉を除いて算出した清算約定（自己分）の当初証拠金所要額に相当する額を下回ることを確認できたこととする。 ２　前項の規定は、清算委託者がクロスマージン利用者である場合について準用する。この場合において、前項中「清算参加者」とあるのは「清算委託者」と、「清算約定（自己分）」とあるのは「清算約定（委託分）」とそれぞれ読み替えるものとする。 （国債証券先物取引の建玉の清算参加者口座への記録）	（新設）
第４２条の７　業務方法書第８４条の４第３項に規定する当社が定める要件は、クロスマージンの申請に係るクロスマージン利用者である清算参加者について、当社が、次の各号のいずれかの条件を確認できたこととする。 （１）　清算参加者が、クロスマージンの承諾を行った日（以下本条及び次条において「クロスマージン承諾日」という。）に当該清算参加者の自己取引口座について算出した当初証拠金所要額に変動証拠金所要額（外貨建清算約定に係る変動証拠金所要額にあっては、当社が公示により定める為替相場の気配値を	（新設）

用いて日本円に換算した額）を加減した額に、第４３条の３第１項の規定に従い当該清算参加者に係る決済未了金額を日本円に換算した額及び当該自己取引口座に記録されている外貨建清算約定に係る決済金額（当該クロスマージン承諾日が金利支払日であるものに限る。）の額を当社が公示により定める為替相場の気配値を用いて日本円に換算した額の合計額を加算した額以上の金銭又は代用有価証券を、当社に対して預託していること。 （２）　清算参加者が、クロスマージン承諾日の翌当社営業日において、業務方法書第４８条の規定に従い当社に対して債務負担の申込みを行った場合に、業務方法書第４９条の規定する債務負担要件を充足していること。 ２　前項の規定は、当該クロスマージン利用者が清算委託者である場合について準用する。この場合において、前項第１号中「当該清算参加者のために設定された自己取引口座」とあるのは「当該清算参加者を受託清算参加者とするクロスマージン利用者である清算委託者のために設定された委託取引口座」と、「預託」とあるのは「預託又は交付」と、前項第２号中「当社に対して債務負担の申込みを行った場合に」とあるのは「清算委託者からの有価証券等清算取次ぎの委託に基づき当社に対して債務負担の申込みを行った場合に」とそれぞれ読み替えるものとする。 （クロスマージン対象国債先物清算約定の建玉の清算参加者口座からの抹消） 第４２条の８　業務方法書第８４条の４第４項に規定する抹消は、次の各号のいずれかの条件を当社が確認した場合において、当該確認をした時点において行うものとする。 （１）　クロスマージン承諾日の翌当社営業日	（新設）

における前条第１項第１号（前条第２項において準用する場合を含む。）に規定する条件 （２）　クロスマージン承諾日の翌々当社営業日における前条第１項第１号（前条第２項において準用する場合を含む。）に規定する条件 （３）　クロスマージン承諾日の翌々当社営業日における前条第１項第２号（前条第２項において準用する場合を含む。）に規定する条件 ２　前項の規定にかかわらず、クロスマージン承諾日の翌当社営業日において新たなクロスマージンの申請が行われ承諾された場合には、当社が前条に規定する条件を確認した時点において抹消するものとする。 （発生する債権債務の内容） 第４２条の９　業務方法書第８４条の５第１項の規定により成立する債権債務の内容は、次の各号に掲げる債権債務に応じて、当該各号に定める内容とする。 （１）　清算参加者が当社に対して負担する債権債務 証券取引等業務方法書第７３条の１５の４第１項の規定により消滅する債権のうち、クロスマージン申請者が当社に対して有していた債権と同一内容の債権及び同項の規定により消滅する債務のうち、クロスマージン申請者が当社に対して負担していた債務と同一内容の債務 （２）　当社が清算参加者に対して負担する債権債務 証券取引等業務方法書第７３条の１５の４第１項の規定により消滅する債権のうち、当社がクロスマージン申請者に対して有していた債権と同一内容の債権及び同項の規定によ	（新設）

り消滅する債務のうち、当社がクロスマージン申請者に対して負担していた債務と同一内容の債務	
（日本円による資金決済の方法） 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）　円貨建清算約定に係る変動証拠金 （２）　円貨建清算約定に係る変動証拠金の利息 （３）　円貨建清算約定に係るアップフロントフィー （４）　第四階層特別清算料担保金（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第２４条第１号の規定により日本円により預託するものに限る。） （５）　円貨建清算約定に係る固定金額 （６）　円貨建清算約定に係る変動金額 （７）　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第８条第４項第１号に規定する承継時支払金額及び同項第２号に規定する未払債務（日本円により授受するものに限る。） （８）　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第１４条に規定する落札時支払金額（日本円により授受するものに限る。） （９）　業務方法書第９７条第２項に規定する清算約定の終了に係る期限前終了手数料（円貨建清算約定に係るものに限る。） （１０）　解約手数料（日本円により授受するものに限る。） （１１）　業務方法書第７７条の２の規定により当社と清算参加者の間で授受するクロスマージン更新差金	（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）　変動証拠金 （２）　変動証拠金に係る利息 （３）　アップフロントフィー （４）　第四階層特別清算料担保金（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第２４条第１号の規定により預託するものに限る。） （５）　固定金額 （６）　変動金額 （７）　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第８条第４項第１号に規定する承継時支払金額及び同項第２号に規定する未払債務 （８）　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第１４条に規定する落札時支払金額 （９）　業務方法書第９７条第２項に規定する清算約定の終了に係る期限前終了手数料 （１０）　任意解約手数料 （新設）

２～４　（略）	２～４　（略）
（外貨による資金決済） 第４３条の２　業務方法書第８５条の４第１項に規定する金銭の授受は、外貨建清算約定の通貨に応じて、当社が通知により指定する銀行（以下本条及び次条において「指定銀行」という。）において、次の各号に掲げる方法に区分して、当該各号に定めるものについて行うものとする。 （１）　日本国内において、指定銀行に開設された当社名義の口座を通じて授受する方法 次のａからｇまでに掲げる金銭 ａ　外貨建清算約定に係る変動証拠金 ｂ　外貨建清算約定に係る変動証拠金の利息 ｃ　第四階層特別清算料担保金（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第２４条第１号の規定により日本円以外の通貨により預託するものに限る。） ｄ　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第８条第４項第１号に規定する承継時支払金額及び同項第２号に規定する未払債務（日本円以外の通貨により授受するものに限る。） ｅ　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第１４条に規定する落札時支払金額（日本円以外の通貨により授受するものに限る。） ｆ　業務方法書第９７条第２項に規定する清算約定の終了に係る期限前終了手数料（外貨建清算約定に係るものに限る。） ｇ　解約手数料（日本円以外の通貨により授受するものに限る。） （２）　外貨建清算約定に係る決済都市において、指定銀行に開設された当社名義の口座を	（新設）

通じて授受する方法　次のａからｃまでに掲げる金銭 ａ　外貨建清算約定に係るアップフロントフィー ｂ　外貨建清算約定に係る固定金額 ｃ　外貨建清算約定に係る変動金額 ２　前項第２号に規定する外貨建清算約定に係る決済都市は、次の各号に掲げる外貨建清算約定に応じて、当該各号に定める都市とする。 （１）　豪ドル建清算約定　シドニー （２）　米ドル建清算約定　ニューヨーク （３）　ユーロ建清算約定　ロンドン ３　清算参加者は、前項に規定する金銭の授受のための指定銀行について、あらかじめ当社所定の届出書により当社に対して届け出るものとする。 ４　清算参加者は、前項に規定する届出の内容を変更しようとする場合には、その変更後の内容を、あらかじめ当社所定の届出書により当社に対して届け出るものとする。 ５　業務方法書第８５条の４第２項に規定する差引計算は、第１項各号に掲げる金銭の総受取額と総支払額の差引計算とする。 （外貨建清算約定に係る資金決済等未了の場合の取扱い） 第４３条の３　業務方法書第８５条の５第２項に規定する当初証拠金所要額の加算は、決済未了金額に係る外貨建清算約定が記録されている自己取引口座又は委託取引口座ごとに、当該決済未了金額を当社が公示により定める為替相場を用いて日本円に換算した額を当該自己取引口座又は委託取引口座に係る当初証拠金所要額に加算することで行うものとする。 ２　前項の規定により当初証拠金所要額の加算を行った場合に、決済未了清算参加者が当社に対	（新設）

して決済未了金額の預託又は支払いを完了したことを当社が確認したときは、当社は、前項の規定により自己取引口座又は委託取引口座に係る当初証拠金所要額に加算した額を、当該自己取引口座又は委託取引口座に係る当初証拠金所要額から減額する。 ３　前２項の規定は、日中証拠金所要額について準用する。 ４　決済未了清算参加者は、決済未了金額の額に応じて当社が公示により定める方法により算出する遅延損害金を当社に対して支払わなければならない。ただし、指定銀行のシステム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当社が必要と認める場合には、この限りでない。	
（清算預託金の管理） 第４４条　（略） ２　（略） ３　ＦＣＭ清算参加者（Ｕ．Ｓ．Ｃｏｍｍｏｄｉｔｙ Ｅｘｃｈａｎｇｅ Ａｃｔ に規定されたＦｕｔｕｒｅｓ Ｃｏｍｍｉｓｓｉｏｎ Ｍｅｒｃｈａｎｔ（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、ＣＦＴＣ Ｒｅｇｕｌａｔｉｏｎ １．４９に基づき信託業務を営む銀行への信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。	（清算預託金の管理） 第４４条　（略） ２　（略） ３　ＦＣＭ清算参加者（Ｕ．Ｓ．Ｃｏｍｍｏｄｉｔｙ Ｅｘｃｈａｎｇｅ Ａｃｔ に規定されたＦｕｔｕｒｅｓ Ｃｏｍｍｉｓｓｉｏｎ Ｍｅｒｃｈａｎｔ（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、ＣＦＴＣ Ｒｅｇｕｌａｔｉｏｎ １．４９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。
付　　則	

この改正規定は、平成２７年９月２４日から施行する。	
別表１　（略）	別表１　（略）
別表２　当初証拠金所要額の算出方法	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５３条第２項の規定に従い当社が取引毎コンプレッション要件の充足の確認を行ったときは、当該確認を行った時点をいい、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、当該承諾の時点をいう。以下別表２において同じ。）における円貨建清算約定、豪ドル建清算約定、米ドル建清算約定又はユーロ建清算約定ごとの同日午後３時２分時点（ユーロ建清算約定にあっては、午前１１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及び算出日の午後５時３０分までに当該自己取引口座に係る清算参加者が当該自己取引口座に関してクロスマージンの承諾を行った国債証券先物取引の建玉の同日の清算値段に基づき算出した現在価値（以下「先物清算値段価値」という。）について、次の（ａ）及び（ｂ）に規定する変動額のうち、当該変動額の合計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	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。

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又は想定変動値段により算出した先物清算値段価値の変動額（外貨建清算約定に係る正味現在価値の変動額にあっては、当該正味現在価値の変動額に過去の為替相場の変動を反映した額）	（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イールド・カーブにより算出した正味現在価値又はストレスイベントシナリオ想定変動値段により算出した先物清算値段価値の変動額（外貨建清算約定に係る正味現在価値の変動額にあっては、当該正味現在価値の変動額に過去の為替相場の変動を反映した額）のうち、当社が公示により定める額	（ｂ）　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　（略）	ｂ　（略）
ｃ　上記ａ（ａ）に規定する「想定変動値段」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値段に関する５日間の変動率と同じ率の変動が、算出日の清算値段に生じた場合における当該清算値段をいう。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）
ｄ　（略）	ｃ　（略）
ｅ　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値段」とは、当社が公示により定める期間における日々の清算値段の５日間の変動率と同じ率の変動が、算出日の清算値段に生じた場合における当該清算値段をいう。	（新設）
ｆ　上記ａ（ａ）及び（ｂ）に規定する為替相場の変動は、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午後３時	（新設）

時点における当社が公示により定める為替相場の気配値の５日間の変動率と同じ率の変動が、算出日の為替相場の気配値に生じた場合における当該為替相場の気配値の変動をいう。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。	
ｇ　自己取引口座に外貨建清算約定が記録されている場合において、当該外貨建清算約定に係る外貨本国営業日が休業日と同日となる日の前々当社営業日においては、上記ａからｆまでの規定に従い算出された当初証拠金所要額に、上記ａからｆまでの規定中「５日間の変動率」とあるのを「自己取引口座に記録されている外貨建清算約定に係る外貨本国営業日と休業日が同日となる日数の変動率」と読み替えて上記ａからｆまでの規定に従い算出した額を加算する。	（新設）
ｈ　自己取引口座に外貨建清算約定が記録されている場合において、当該外貨建清算約定に係る外貨本国休業日が当社営業日と同日となる日の前当社営業日においては、上記ａからｆの規定に従い算出された当初証拠金所要額に、当該自己取引口座について、当該外貨本国休業日が当社営業日であると仮定して算出した変動証拠金所要額を当社が公示により定める為替相場を用いて日本円に換算した額を当初証拠金所要額に加減する。	（新設）
（２）　清算約定（委託分）（業務方法書第９４条第１項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」	（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」と読み替えるものとする。	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条第１項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」とあるのは「各委託取引口座」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、本号におけるストレスイベントシナリオ想定変動イールド・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、「想定変動値段」を「特別想定変動値段」と、「ストレスイベントシナリオ想定変動値段」を「ストレスイベントシナリオ特別想定変動値段」という。）。	（３）　清清算約定（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）	（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１１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自己取引口座の円貨建清算約定、豪ドル建清算約定、米ドル建清算約定又はユーロ建清算約定の正味現在価値及び当該算出日に当該自己取引口座に記録されているクロスマージン対象国債先物清算約定の同日の約定値段（当社が行う証券取引等清算業務における先	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１１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。

物・オプション取引に係る取引証拠金等に関する規則第２３条に規定する緊急清算値段として定められる値段をいう。以下本項及び次項において同じ。）に基づき算出した現在価値（以下「先物約定値段価値」という。）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）　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又は前項第１号ｃに規定する国債先物想定変動値段により算出した先物約定値段価値の変動額（外貨建清算約定に係る正味現在価値の変動額にあっては、当該正味現在価値の変動額に過去の為替相場の変動を反映した額）	（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ｄ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正味現在価値又は前項第１号ｅに規定するストレスイベントシナリオ想定変動値段により算出した先物約定値段価値の変動額（外貨建清算約定に係る正味現在価値の変動額にあっては、当該正味現在価値の変動額に過去の為替相場の変動を反映した額）のうち、当社が公示により定める額	（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、清算約定の通貨ごとに、同日の午後３時２分時点（ユーロ建ての金利スワップ取引に係る気配値にあっては、午後５時３０分（ロンドンにおいて夏時間が実施されている期間にあっては、午後４時３０分）時点をいう。以下	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

別表２において同じ。）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、清算約定の通貨ごとに、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（外貨建清算約定にあっては、当社が公示により定める為替相場を用いて日本円に換算した額）を合計した額とする。	当する額とする。
（２）　清算約定（委託分）（業務方法書第９４条第１項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」とあるのは「各委託取引口座」と読み替えるものとする。	（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９４条第１項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」とあるのは「各委託取引口座」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、「想定変動値段」を「前項第３号に定める特別想定変動値段」と、「ストレスイベントシナリオ想定変動値段」を「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値	（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。

段」と読み替えるものとする。 （４）　（略）	（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（以下本項において「申込受領時点」という。）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及び算出日の前当社営業日の午後５時３０分までに当該自己取引口座に係る清算参加者が当該自己取引口座に関してクロスマージンの承諾を行った国債証券先物取引の建玉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（業務方法書第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。）及び申込受領時点において預託又は支払いが完了していない外貨建清算約定に係る変動証拠金等の額（決済未了金額を除く。）を当社が公示により定める為替相場を用いて日本円に換算した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。	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時から正午	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

までの間に債務負担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自己取引口座の円貨建清算約定、豪ドル建清算約定、米ドル建清算約定又はユーロ建清算約定の正味現在価値及び算出日の前当社営業日の午後５時３０分までに当該自己取引口座に係る清算参加者が当該自己取引口座に関してクロスマージンの承諾を行った国債証券先物取引の建玉の算出日の約定値段（午前９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又は第２７条第３項に規定する申込みを受領した場合にあっては、当該申込受領日の前当社営業日の清算値段）に基づき算出した現在価値（以下「先物日中価値」という。）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。	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正味現在価値又は前項第１号ｃに規定する想定変動値段により算出した先物日中価値の変動額（外貨建清算約定に係る正味現在価値の変動額にあっては、当該正味現在価値の変動額に過去の為替相場の変動を反映した額）	（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ｄ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正味現在価値又は前項第１号ｅに規定するストレスイベントシナリオ想定変動値段により算出した先物日中価値の変動額（外貨建清算約定に係る正味現在	（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

価値の変動額にあっては、当該正味現在価値の変動額に過去の為替相場の変動を反映した額）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時時点における清算約定について、清算約定の通貨ごとに、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、清算約定の通貨ごとに、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（外貨建清算約定にあっては、当社が公示により定める為替相場を用いて日本円に換算した額）を合計した額とする。	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）　清算約定（委託分）（業務方法書第９４条第１項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」とあるのは「各委託取引口座」と読み替えるものとする。	（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条第１項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。）	（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」とあるのは「各委託取引口座」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、「第１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、「想定変動値段」を「第１項第３号に定める特別想定変動値段」と、「ストレスイベントシナリオ想定変動値段」を「第１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値段」と読み替えるものとする。	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）	（４）　（略）
様式第１号　保証に関する書面の様式	様式第１号　保証に関する書面の様式
保　証　書	保　証　書
○○○○○○（以下「当法人」といいます。）は、貴社の定めた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」といいます。）第８条第５項の規定に基づき、あらかじめ本業務方法書等の内容を確認及び了承のうえ、○○○○○○（以下「本清算参加者」といいます。）を経由して、この保証書（以下「本保証書」といいます。）を貴社に提出します。 なお、本保証書において使用する用語は、本保証書に別段の定めがある場合を除くほか、業務方法書において使用される用語の例によるものとします。	○○○○○○（以下「当法人」といいます。）は、貴社の定めた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」といいます。）第８条第４項の規定に基づき、あらかじめ本業務方法書等の内容を確認及び了承のうえ、○○○○○○（以下「本清算参加者」といいます。）を経由して、この保証書（以下「本保証書」といいます。）を貴社に提出します。 なお、本保証書において使用する用語は、本保証書に別段の定めがある場合を除くほか、業務方法書において使用される用語の例によるものとします。

１．～５．　（略） 以　上	１．～５．　（略） 以　上
様式第３号　清算受託契約の様式	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	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。	（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）　（略）	（１）　（略）
（１）の２　「円貨建委託清算約定」とは、委託清算約定のうち、想定元本及び決済通貨が日本円建てであるものをいう。	（新設）
（１）の３　「外貨建委託清算約定」とは、委託清算約定のうち、想定元本及び決済通貨が日本円建て以外のものをいう。	（新設）
（２）～（６）　（略）	（２）～（６）　（略）
（６）の２　「豪ドル建委託清算約定」とは、委託清算約定のうち、想定元本及び決済通貨がオーストラリア・ドル建てのものをいう。	（新設）
（７）～（９）　（略）	（７）～（９）　（略）
（９）の２　「米ドル建委託清算約定」とは、委託清算約定のうち、想定元本及び決済通貨が米ドル建てのものをいう。	（新設）
（１０）　（略）	（１０）　（略）
（１１）　「ユーロ建委託清算約定」とは、委託清算約定のうち、想定元本及び決済通貨がユーロ建てのものをいう。	（新設）
（日本円建て以外の通貨の金利スワップ取引の有価証券等清算取次ぎの委託に関する届出）	

第３条の２　乙は、想定元本及び決済通貨が日本円建て以外である金利スワップ取引について、甲に対して初め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、あらかじめ、甲に対して日本円建て以外の通貨の金利スワップ取引について有価証券等清算取次ぎの委託をすることについて、甲の承諾を得るものとする。	（新設）
（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（外貨建清算約定の決済金額に相当する金銭にあっては、当該クリアリング機構への交付時限の翌外貨本国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。この場合において、乙が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に甲に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ときは、当該クリアリング機構への交付時限の属する日の翌ＪＳＣＣ営業日（外貨建清算約定に係る決済金額にあっては、当該クリアリング機構への交付時限の属する日の後最初に到来するＪＳＣＣ営業日かつ外貨本国営業日である日）の同一の時限までに、甲に対して交付するものとする。	（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ＪＳＣＣ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）	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、乙の計算によるクロスマージン制度の対象となった国債証券先物取引の建玉その他本契約並びに業務方法書等に基づいて乙との間	（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。）

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。	を開設する。
２　（略）	２　（略）
（甲に措置が行われた場合の対応） 第１０条の２　業務方法書第２９条の２第２項に規定する措置（乙の有価証券等清算取次ぎの委託に基づく対象取引について実施されたものに限る。）又は同第２９条の３第１項に規定する措置が甲に対して実施された場合であって、甲が乙に対してポジション保有状況を改善するために必要な措置（クロスマージン対象国債先物清算約定に係る措置を含む。）の要請を行ったときは、乙は当該要請に応じることとする。	（甲に措置が行われた場合の対応） 第１０条の２　業務方法書第２９条の２第２項に規定する措置（乙の有価証券等清算取次ぎの委託に基づく対象取引について実施されたものに限る。）又は同第２９条の３第１項に規定する措置が甲に対して実施された場合であって、甲が乙に対してポジション保有状況を改善するために必要な措置の要請を行ったときは、乙は当該要請に応じることとする。
（当初証拠金の預託時限） 第１３条　（略）	（当初証拠金の預託時限） 第１３条　（略）
２　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。	２　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。
（日中証拠金の預託時限） 第１５条　（略）	（日中証拠金の預託時限） 第１５条　（略）
２　当初証拠金等預託額が、クリアリング機構が債務負担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。	２　当初証拠金等預託額が、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。
（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（日本円に限る。）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。	（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）	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。）の額及び甲が本清算取次口座に記録されたクロスマージン対象国債先物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	（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

む。）の額又は未払いの期限前終了金額及び乙が本清算取次口座に記録されたクロスマージン対象国債先物清算約定に関して甲に対して負担する未履行債務の額を控除した額 （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、甲が本清算取次口座に記録されたクロスマージン対象国債先物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）　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）	２～６　（略）
（変動証拠金） 第２０条　甲及び乙は、次の各号に掲げる通貨の委託清算約定に応じて、当該各号に掲げる日ごとに、委託清算約定の通貨の変動証拠金に相当する金銭を授受するものとする。 （１）　円貨建委託清算約定　ＪＳＣＣ営業日 （２）　外貨建委託清算約定　ＪＳＣＣ営業日かつ外貨本国営業日である日	（変動証拠金） 第２０条　甲及び乙は、ＪＳＣＣ営業日ごとに、変動証拠金を授受するものとする。
２　（略）	２　（略）
（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（外貨建清算約定に係る変動証拠金にあっては、当該変動証拠金の算出日の後最初に到来するＪＳＣＣ営業日かつ外貨本国営業日である日）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。この場合において、乙が当該変動証拠金に相当する金銭をクリアリング機構への	（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。

交付時限までに甲に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ときは、当該変動証拠金算出日から起算して翌々ＪＳＣＣ営業日（外貨建清算約定に係る変動証拠金にあっては、当該クリアリング機構への預託時限である日の後最初に到来するＪＳＣＣ営業日かつ外貨本国営業日である日）の同一の時限までに、甲に対して交付するものとする。	
２　（略）	２　（略）
（変動証拠金に係る利息の授受） 第２２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、次の各号に掲げる通貨の委託清算約定に応じて、当該各号に掲げるＪＳＣＣ営業日ごとに、委託清算約定の通貨の変動証拠金に係る利息に相当する金銭を授受するものとする。 （１）　円貨建委託清算約定　ＪＳＣＣ営業日 （２）　外貨建委託清算約定　ＪＳＣＣ営業日かつ外貨本国営業日である日	（変動証拠金に係る利息の授受） 第２２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、変動証拠金に係る利息を授受するものとする。
２　委託清算約定の変動証拠金に係る利息の額は、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、甲は当該額を乙に対して通知するものとする。	（新設）
３　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、当該変動証拠金に係る利息の算出日の翌ＪＳＣＣ営業日（外貨建清算約定の変動証拠金に係る利息にあっては、当該変動証拠金に係る利息の算出日の後最初に到来するＪＳＣＣ営業日かつ外貨本国営業日である日）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。この場合において、乙が当該変動証拠金に係る利息に相当する金銭をクリア	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。

リング機構への交付時限までに甲に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ときは、当該変動証拠金に係る利息の算出日から起算して翌々ＪＳＣＣ営業日（外貨建清算約定の変動証拠金に係る利息にあっては、当該クリアリング機構への預託時限である日の後最初に到来するＪＳＣＣ営業日かつ外貨本国営業日である日）の同一の時限までに、甲に対して交付するものとする。	
４　（略）	３　（略）
（クロスマージン更新差金に相当する金銭） 第２３条の２　第２８条の９の規定により甲乙間で法律関係が成立した場合には、本清算取次口座に記録されたクロスマージン対象国債先物清算約定に係るクロスマージン更新差金の授受について甲がクリアリング機構に対して支払い方となるときは、乙は当該クロスマージン更新差金に相当する金銭を甲に交付し、甲がクリアリング機構に対して受領方となるときは、甲は当該クロスマージン更新差金に相当する金銭を乙に交付するものとする。	（新設）
（クロスマージン更新差金に相当する金銭の授受） 第２３条の３　乙は、甲がクロスマージン更新差金をクリアリング機構に交付すべき場合には、当該クロスマージン更新差金に相当する金銭を、当該クロスマージン更新差金が生じた日の翌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、差金発生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	（新設）

り甲に交付する。 ２　甲は、クリアリング機構からクロスマージン更新差金を受領した場合には、当該クロスマージン更新差金に相当する金銭を、甲乙間で合意する時期までに（甲乙間で合意がない場合には、速やかに）、甲乙間で合意する方法により乙に交付する。	
（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）	（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及び本清算取次口座に記録されたクロスマージン対象国債先物清算約定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。	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）	（１）・（２）　（略）
２　乙は、クリアリング機構が甲の破綻等を認定した場合には、すべての委託清算約定及び本清算取次口座に記録されたクロスマージン対象国債先物清算約定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。	２　乙は、クリアリング機構が甲の破綻等を認定した場合には、すべての委託清算約定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。
３　甲は、クリアリング機構が甲の破綻等を認定した場合には、すべての委託清算約定及び本清算取次口座に記録されたクロスマージン対象国債先物清算約定の決済が完了するまでの間、クリアリング機構及び乙に対し、証拠金の返還請求権を行使することができない。	３　甲は、クリアリング機構が甲の破綻等を認定した場合には、すべての委託清算約定の決済が完了するまでの間、クリアリング機構及び乙に対し、証拠金の返還請求権を行使することができない。
（円貨建清算約定に係る変動証拠金等に相当する金銭の決済の方法）	（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、円貨建委託清算約定に係る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	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。

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、乙が甲に対し円貨建清算約定に係る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円貨建清算約定に係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円貨建清算約定に係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、乙が甲から円貨建清算約定に係る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円貨建清算約定に係る変動証拠金等に相当する金銭の額）－（当初証拠金預託必要額）	（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。 （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）－（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、乙が円貨建清算約定に係る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円貨建清算約定に係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。	（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。
（外貨建清算約定に係る変動証拠金及び決済金額の決済方法） 第２６条の５　甲及び乙は、外貨建委託清算約定の通貨ごとに、外貨建委託清算約定に係る変動証拠金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。 ２　甲及び乙は、外貨建委託清算約定の通貨ごとに、外貨建委託清算約定に係る決済金額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。	（新設）
第４章　委託清算約定の取引毎コンプレッション及び一括コンプレッション	第４章　委託清算約定の任意解約及び一括コンプレッション
（委託清算約定に関する取引毎コンプレッションの申込み） 第２６条の６　乙は、委託清算約定に関する取引毎コンプレッションの申込みの指図又は取引毎コンプレッションの申込みの指図の撤回を行おうとする場合には、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、その旨を甲に通知するものとする。 ２　甲は、前項の通知を受領した場合には、業務方法書等の定めるところにより、クリアリング	（新設）

機構に対して当該通知に係る取引毎コンプレッションの申込み又は取引毎コンプレッションの申込みの撤回を行うものとする。	
（委託清算約定に関する一括コンプレッションの申込み）	（委託清算約定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２７条　乙は、甲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、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。	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。
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。	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。
３　（略）	３　（略）
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て通知するものとする。	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て通知するものとする。
（取引毎コンプレッション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）	（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　取引毎コンプレッション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とともに、当該本清算委託取引に基づく債権債務（業務方法書等の定める	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

ところによりクリアリング機構が取引毎コンプレッション要件又は一括コンプレッション要件の充足を確認することができたときに既に発生している当該本清算委託取引（外貨建清算約定に関するものに限る。）に基づく預託又は支払いが完了していない変動証拠金等に関する債権債務を除く。）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。	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。
（取引毎コンプレッション又は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　取引毎コンプレッション又は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。	（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。
（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　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（業務方法書等の定めるところにより甲を代理人としてクリアリング機構に預託されている当初証拠金として取り扱う旨の申請が行われたものを除く。）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。	（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　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	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債務負担時所要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。	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　（略）	４　（略）
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、当然に終了するとともに、当該対象委託清算約定及び当該対象清算約定に係る本清算委託取引に基づく債権債務（業務方法書等の定めるところにより債務負担時所要証拠金の額がクリアリング機構に対して預託又は交付されていることを確認するときに既に発生している当該本清算委託取引（外貨建委託清算約定に関するものに限る。）に基づく預託又は支払いが完了していない決済金額に関する債権債務を除く。）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。	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　（略） ２・３　（略） ４　甲及び乙は、第１項の規定により甲が承継元	（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　（略） ２・３　（略） 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（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。）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（業務方法書等の定めるところにより承継元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ている当初証拠金として取り扱う旨の申請が行われたものを除く。）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。	清算参加者の承継対象清算約定等を承継した場合（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。）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（本清算委託取引及び当該本清算委託取引に基づく債権債務（業務方法書等の定めるところにより債務負担時所要証拠金の額がクリアリング機構に対して預託又は交付されていることを確認するときに既に発生している当該本清算委託取引（外貨建委託清算約定に関するものに限る。）に基づく預託又は支払いが完了していない決済金額に関する債権債務を除く。以下本項において同じ。）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及び当該本清算委託取引に基づく債権債務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	（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。

ことができる。	
２　（略）	２　（略）
第４章の３　クロスマージン制度	（新設）
（クロスマージン制度の利用） 第２８条の７　乙がクロスマージン制度を利用しようとする場合には、次に掲げる者（第２号に掲げる者については、該当する場合に限る。）に関する事項を甲に明らかにしたうえで、甲の承諾を得るものとする。 （１）　クロスマージン申請者 （２）　乙が国債証券先物取引を委託する国債先物等非清算参加者 ２　甲は、前項の承諾を行った場合は、業務方法書等の定めるところによりクリアリング機構に対して届け出るものとする。 ３　乙は、第１項各号に掲げる者について変更しようとする場合には、あらかじめ甲に対してその旨を通知するものとする。この場合において、甲は、業務方法書等の定めるところによりクリアリング機構に対して届け出るものとする。 ４　乙は、クロスマージン制度の利用を取りやめようとする場合には、あらかじめその旨を甲に通知するものとする。この場合において、甲は、業務方法書等の定めるところによりクリアリング機構に対してその旨を届け出るものとする。	（新設）
（クロスマージン対象国債先物清算約定の建玉の清算取次口座への記録及び抹消） 第２８条の８　甲は、乙がクロスマージン利用者である場合において、クリアリング機構が業務方法書等の定めるところにより、乙の計算による国債証券先物取引について、乙のために設定された甲の委託取引口座に当該国債証券先物取引の建玉を記録し又は当該口座から抹消したと	（新設）

きに、本清算取次口座に当該国債証券先物取引の建玉を記録し又は当該口座から抹消するものとする。		
（クロスマージン対象国債先物清算約定に係る法律関係の成立） 第２８条の９　業務方法書等の定めるところにより、甲とクリアリング機構との間のクロスマージン対象国債先物清算約定に係る債権債務と同一内容の債権債務が成立した場合で、当該クロスマージン対象国債先物清算約定が本清算取次口座に記録されているものであるときは、当該債権債務の成立と同時に、甲乙間で、当該債権債務が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したものと仮定したときに当該委託により成立することとなる本清算委託取引と同一の経済効果を有する法律関係が成立するものとする。 ２　クリアリング機構が第２８条の１０第１項に規定する転売又は買戻しを行った場合は、前項の規定により成立した法律関係は、当該転売又は買戻しが実施された時点において将来に向かって消滅する。	（新設）	
（クロスマージン対象国債先物清算約定の処分） 第２８条の１０　前条に規定する甲乙間の法律関係が成立した場合には、クリアリング機構は、業務方法書等の定めるところにより、本清算取次口座に建玉が記録されているクロスマージン対象国債先物清算約定の転売又は買戻しその他必要と認める整理を任意の国債先物等清算参加者をして行わせることができる。 ２　クロスマージン処分取引が、本清算取次口座に建玉が記録されているクロスマージン対象国債先物清算約定を対象として行われた場合であって、本清算委託取引が終了していないときは、	（新設）	

業務方法書第８４条第４項の規定により成立した金利スワップ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、当該金利スワップ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金利スワップ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。 （アップフロントフィーに相当する金銭の授受）	
第２８条の１１　前条第２項に規定する金利スワップ取引が成立した場合において、甲が当該金利スワップ取引についてクリアリング機構にアップフロントフィーを交付すべきときには、乙は、当該アップフロントフィーに相当する金銭を、当該金利スワップ取引の成立日の翌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、甲乙が合意する方法により甲に交付する。この場合において、乙が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に甲に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ときは、当該クリアリング機構への交付時限の属する日の翌ＪＳＣＣ営業日の同一の時限までに、甲に対して交付するものとする。 ２　前条第２項に規定する金利スワップ取引が成立した場合において、甲が当該金利スワップ取引についてクリアリング機構からアップフロントフィーを受領した場合には、甲は、当該アップフロントフィーに相当する金銭を、甲乙間で合意する時期までに（甲乙間で合意がない場合には、速やかに）、甲乙間で合意する方法により乙に交付する。	（新設）

（期限の利益喪失事由） 第２９条　次に掲げるいずれかの事由が発生した場合、乙についての期限の利益喪失事由を構成するものとする。 （１）～（３）　（略） （４）　先物・オプション取引口座設定約諾書等における期限の利益の喪失 本清算取次口座にクロスマージン対象国債先物清算約定が記録されている場合に、乙が、国債証券先物取引の委託に関して指定市場開設者が定める先物・オプション取引口座設定約諾書の定めるところにより、又は有価証券等清算取次ぎの委託に関して証券取引等業務方法書第３９条の規定に従い締結された国債先物等清算受託契約書の定めるところにより、当然に期限の利益を喪失した場合 ２・３　（略）	（期限の利益喪失事由） 第２９条　次に掲げるいずれかの事由が発生した場合、乙についての期限の利益喪失事由を構成するものとする。 （１）～（３）　（略） （新設） ２・３　（略）
（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　（略） ２　（略） 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又は同項第４号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。 ４～６　（略） ７　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	（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　（略） ２　（略） 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。 ４～６　（略） ７　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。	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）　次のａ及びｂに定めるアップフロントフィーに係る金額の合計額（日本円以外の通貨により授受されるアップフロントフィーにあっては、リスク軽減取引又は第２８条の１０第２項に規定する金利スワップ取引が行われた日における為替相場の気配値を用いて日本円に換算した額の合計額。以下本号において同じ。）	（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
ａ　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	
ｂ　第２８条の１０第２項に規定する金利スワップ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（日本円以外の通貨により算出される正味現在価値にあっては、当該ａ及びｂに定める日における為替相場の気配値を用いて日本円に換算した額の合計額）	（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・ｂ　（略）	ａ・ｂ　（略）
（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	（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（日本円以外の通貨により授受されるべき固定金額、変動金額及びその他支払金額	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、

にあっては、期限前終了日における為替相場の気配値を用いて日本円に換算した額の合計額。以下本号において同じ。）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、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	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・ｃ　（略）	ｂ・ｃ　（略）
（４）　前３号に掲げるもののほか、委託清算約定の処理に関し、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（日本円以外の通貨により授受されるべき金額にあっては、期限前終了日における為替相場の気配値を用いて日本円に換算した額）	（４）　前３号に掲げるもののほか、委託清算約定の処理に関し、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・９　（略）	８・９　（略）
（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）	（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及び本清算取次口座に記録されたクロスマージン対象国債先物清算約定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。	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・３　（略）	２・３　（略）
（本清算委託取引終了時における債権債務の一括清算）	（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	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（日本円以外の通貨により授受されるべき変動証拠金にあっては、期限前終了日における為替相場の気配値を用いて日本円に換算した額とする。以下本号において同じ。）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、日本円以外の通貨により授受されるべき金銭債務にあっては、期限前終了日における為替相場の気配値を用いて日本円に換算した額とする。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）～（５）　（略）	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）～（５）　（略）
（未決済約定の承継） 第３４条　（略） 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	（未決済約定の承継） 第３４条　（略） 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及び業務方法書第８５条の５第１項に規定する決済未了金額に係る甲の債務を除く。）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。	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。
５　第１項の規定にかかわらず、甲が第２８条の７第２項の規定により乙をクロスマージン利用者として当社に届け出ている場合には、乙は、第１項の承継の申込みを行うことはできない。	
（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）	（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。	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）　（略）	（１）　（略）
（１）の２　前号における「変動証拠金等の額」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し、日本円以外の通貨により授受すべき「変動証拠金等の額」又は「正味現在価値」にあっては、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第６条に規定する為替相場の気配値を用いて日本円に換算した額とするする。	（１）の２　前号における「変動証拠金等の額」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　（略） （２）　甲が第１号の規定により算出された期限前終了手数料に相当する額を乙に支払うべき場合には、乙は甲に対し当該額に係る債権を有するものとみなす。 （３）　（略）	（１）の３　（略） （２）　甲が前号の規定により算出された期限前終了手数料に相当する額を乙に支払うべき場合には、乙は甲に対し当該額に係る債権を有するものとみなす。 （３）　（略）
２　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、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２６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及び本清算取次口座に記録されたクロスマージン対象国債先物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。	２　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、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２６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　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、第５項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、すべての委託清算約定及び本清算取次口座に記録されたクロスマージン対象国債先物清算約定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。	３　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、第５項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、すべての委託清算約定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。
４　（略）	４　（略）
５　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、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	５　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、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）　第３３条の規定によるすべての委託清算約定の終了に伴い甲から乙に支払うべき期限前終了手数料相当額、甲から乙に返還すべき変動証拠金の総額（日本円以外の通貨により授受すべき変動証拠金にあっては、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第６条に規定する為替相場の気配値を用いて日本円に換算した額とする。以下本項において同じ。）その他当初損失確定日において存在する甲の乙に対する金銭債務（日本円以外の通貨により授受すべき金銭債務にあっては、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第６条に規定する為替相場の気配値を用いて日本円に換算した額とする。前２項の規定による委託当初証拠金の返還債務を除き、以下「当初損失確定日甲負担債務」という。）と、当該委託清算約定の終了に伴い乙から甲に支払うべき期限前終了手数料相当額、乙から甲に返還すべき変動証拠金の総額その他当初損失確定日において存在する乙の甲に対する金銭債務（以下「当初損失確定日乙負担債務」という。）とを差引計算する。 （２）～（５）　（略）	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）　第３３条の規定によるすべての委託清算約定の終了に伴い甲から乙に支払うべき期限前終了手数料相当額、甲から乙に返還すべき変動証拠金の総額その他当初損失確定日において存在する甲の乙に対する金銭債務（前２項の規定による委託当初証拠金の返還債務を除き、以下「当初損失確定日甲負担債務」という。）と、当該委託清算約定の終了に伴い乙から甲に支払うべき期限前終了手数料相当額、乙から甲に返還すべき変動証拠金の総額その他当初損失確定日において存在する乙の甲に対する金銭債務（以下「当初損失確定日乙負担債務」という。）とを差引計算する。 （２）～（５）　（略）
６・７　（略）	６・７　（略）
（クロスマージン処分取引）	

第３７条の２　甲は、乙の取次ぎの委託に基づき、乙の計算により、クリアリング機構との間で業務方法書第９３条の２第２項に基づきクロスマージン処分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クロスマージン処分取引が成立した場合、当該クロスマージン処分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、当該クロスマージン処分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クロスマージン処分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。	（新設）

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
（目的） 第１条　（略） ２　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。 （１）　（略） （１）の２　「円貨建指定清算参加者」とは、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３９条第２項の規定により指定される清算参加者のうち、日本円貨建ての金利スワップ取引に係る気配値の提出に関して指定された清算参加者をいう。 （１）の３　「外貨建指定清算参加者」とは、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３９条第２項の規定により指定される清算参加者のうち、日本円建て以外の金利スワップ取引に係る気配値の提出に関して指定された清算参加者をいう。 （２）～（４）　（略） （４）の２　「コンプレッション上限額（委託分）」とは、第６条の２第２項に規定するコンプレッション上限額（委託分）をいう。 （４）の３　「コンプレッション上限額（自己分）」とは、第６条の２第１項に規定するコンプレッション上限額（自己分）をいう。 （５）　（略） （削る）	（目的） 第１条　（略） ２　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。 （１）　（略） （新設） （新設） （２）～（４）　（略） （新設） （新設） （５）　（略） （６）　「指定清算参加者」とは、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３９条第２項の規定により指定される清算参加者をいう。

（手数料の種類） 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、円貨建清算約定及び外貨建清算約定に係る清算手数料、コンプレッション手数料、クライアント・クリアリング手数料、口座開設手数料、外貨決済手数料、クロスマージン手数料、ＬＩＢＯＲライセンス手数料並びにコラテラル手数料とする。	（手数料の種類） 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、任意解約手数料、クライアント・クリアリング手数料、口座開設手数料及びコラテラル手数料とする。
（基本料） 第３条　基本料は、１か月あたり５２０万円とする。ただし、清算参加者が月の途中で金利スワップ清算資格を取得し又は喪失した場合には、５２０万円に当該月の全当社営業日の日数に占める当該清算参加者が清算参加者であった当該月の当社営業日の日数の割合を乗じて得た額とする。	（基本料） 第３条　基本料は、１か月あたり５００万円とする。ただし、清算参加者が月の途中で金利スワップ清算資格を取得し又は喪失した場合には、５００万円に当該月の全当社営業日の日数に占める当該清算参加者が清算参加者であった当該月の当社営業日の日数の割合を乗じて得た額とする。
２　前項の規定にかかわらず、円貨建指定清算参加者の基本料は、前項に規定する基本料から２０万円を減じた額とする。ただし、清算参加者が月の途中で円貨建指定清算参加者として指定を受け又は指定の取消しを受けた場合における当該月の基本料から減じる額は、２０万円に当該月の全当社営業日の日数に占める当該清算参加者が円貨建指定清算参加者であった当該月の当社営業日の日数の割合を乗じて得た額とする。	２　前項の規定にかかわらず、指定清算参加者の基本料は、前項に規定する基本料から２０万円を減じた額とする。ただし、清算参加者が月の途中で指定清算参加者として指定を受け又は指定の取消しを受けた場合における当該月の基本料から減じる額は、２０万円に当該月の全当社営業日の日数に占める当該清算参加者が指定清算参加者であった当該月の当社営業日の日数の割合を乗じて得た額とする。
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及び円貨建清算約定に係る清算手数料（清算約定（委託分）に係る清算手数料を除く。）の総額が自己取引上限	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。）及び任意解約手数料（清算約定（委託分）に係

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。	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、当該計算年度における翌月以降の基本料は課さないものとする。
（円貨建清算約定に係る清算手数料）	（清算手数料）
第４条　円貨建清算約定に係る清算手数料は、円貨建清算約定に係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。	第４条　清算手数料は、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　各月の円貨建清算約定に係る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（クライアント・クリアリングに係る委託取引口座を除く。）ごとに算出した金額の総額とする。	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（クライアント・クリアリングに係る委託取引口座を除く。）ごとに算出した金額の総額とする。
（１）　株主清算参加者	（１）　株主清算参加者
ａ　円貨建清算約定に係る新規債務負担手数料	ａ　新規債務負担手数料
当該各月の属する計算年度に成立した円貨建清算約定の累計件数に応じ、各月に成立した円貨建清算約定ごとに、次に掲げる金額の総額	当該各月の属する計算年度に成立した清算約定の累計件数に応じ、各月に成立した清算約定ごとに、次に掲げる金額の総額
（ａ）　当該計算年度に成立した円貨建清算約定の累計件数が２，０００件までの部分　１件あたり５，０００円	（ａ）　当該計算年度に成立した清算約定の累計件数が２，０００件までの部分　１件あたり５，０００円
（ｂ）　当該計算年度に成立した円貨建清算約定の累計件数が２，０００件を超え、１０，０００件までの部分　１件あたり１，０００円	（ｂ）　当該計算年度に成立した清算約定の累計件数が２，０００件を超え、１０，０００件までの部分　１件あたり１，０００円
（ｃ）　当該計算年度に成立した円貨建清算約定の累計件数が１０，０００件を超える部分　１件あたり４００円	（ｃ）　当該計算年度に成立した清算約定の累計件数が１０，０００件を超える部分　１件あたり４００円
ｂ　円貨建清算約定に係る債務負担済残存取引手数料	ｂ　債務負担済残存取引手数料
当該各月末日の経過時点で残存する円貨建	当該各月末日の経過時点で残存する清算約

清算約定の件数に応じ、当該残存する円貨建清算約定ごとに、次に掲げる金額の総額 （ａ）　円貨建清算約定の件数が、８，０００件以下の部分　１件あたり４５０円 （ｂ）　円貨建清算約定の件数が８，０００件を超え、４０，０００件までの部分　１件あたり１００円 （ｃ）　円貨建清算約定の件数が４０，０００件を超える部分　１件あたり３５円 （２）　前号に掲げる清算参加者以外の清算参加者 ａ　円貨建清算約定に係る新規債務負担手数料 当該各月に成立した円貨建清算約定ごとに、１件あたり８，０００円 ｂ　円貨建清算約定に係る債務負担済残存取引手数料 当該各月末日の経過時点で残存する円貨建清算約定ごとに、１件あたり７００円	定の件数に応じ、当該残存する清算約定ごとに、次に掲げる金額の総額 （ａ）　清算約定の件数が、８，０００件以下の部分　１件あたり４５０円 （ｂ）　清算約定の件数が８，０００件を超え、４０，０００件までの部分　１件あたり１００円 （ｃ）　清算約定の件数が４０，０００件を超える部分　１件あたり３５円 （２）　前号に掲げる清算参加者以外の清算参加者 ａ　新規債務負担手数料 当該各月に成立した清算約定ごとに、１件あたり８，０００円 ｂ　債務負担済残存取引手数料 当該各月末日の経過時点で残存する清算約定ごとに、１件あたり７００円
３　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及び円貨建清算約定に係る清算手数料（清算約定（委託分）に係る清算手数料を除く。）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）（円貨建清算約定に限る。）に係る清算手数料は課さないものとする。	３　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	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円貨建清算約定に係る清算手数料（清算約定（委託分）（円貨建清算約定に限り、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。）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。	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条に規定する取引毎コンプレッション又は同第５３条の２に規定する一括コンプレッションにより清算約定が成立する場合の円貨建清算約定に係る清算手数料について準用する。	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。
（外貨建清算約定に係る清算手数料） 第４条の２　外貨建清算約定に係る清算手数料は、外貨建清算約定に係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　各月の外貨建清算約定に係る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（クライアント・クリアリングに係る委託取引口座を除く。）ごとに算出した金額の総額とする。 （１）　株主清算参加者 ａ　外貨建清算約定に係る新規債務負担手数料 当該各月の属する計算年度に成立した外貨建清算約定の累計件数に応じ、各月に成立した外貨建清算約定ごとに、次に掲げる金額の	（新設）

総額

（ａ）　当該計算年度に成立した外貨建清算約定の累計件数が５００件までの部分　１件あたり１０，３００円

（ｂ）　当該計算年度に成立した外貨建清算約定の累計件数が５００件を超え、２，５００件までの部分　１件あたり２，０００円

（ｃ）　当該計算年度に成立した外貨建清算約定の累計件数が２，５００件を超える部分　１件あたり８００円

ｂ　外貨建清算約定に係る債務負担済残存取引手数料

当該各月末日の経過時点で残存する外貨建清算約定の件数に応じ、当該残存する外貨建清算約定ごとに、次に掲げる金額の総額

（ａ）　外貨建清算約定の件数が、２，０００件以下の部分　１件あたり８００円

（ｂ）　外貨建清算約定の件数が２，０００件を超え、１０，０００件までの部分　１件あたり１８０円

（ｃ）　外貨建清算約定の件数が１０，０００件を超える部分　１件あたり６５円

（２）　前号に掲げる清算参加者以外の清算参加者

ａ　外貨建清算約定に係る新規債務負担手数料

当該各月に成立した外貨建清算約定ごとに、１件あたり１６，５００円

ｂ　外貨建清算約定に係る債務負担済残存取引手数料

当該各月末日の経過時点で残存する外貨建清算約定ごとに、１件あたり１，２５０円

３　前各項の規定は、業務方法書第５３条に規定する取引毎コンプレッション又は同第５３条の２に規定する一括コンプレッションにより新た

に清算約定が成立する場合の外貨建清算約定に係る清算手数料について準用する。	
（コンプレッション手数料） 第５条　コンプレッション手数料は、業務方法書第５３条に規定する取引毎コンプレッション又は同第５３条の２に規定する一括コンプレッションの成立により終了した清算約定ごとに、１件あたり１，２００円とする。	（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。
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）において負担するコンプレッション手数料（清算約定（委託分）に係るコンプレッション手数料を除く。）の総額がコンプレッション上限額（自己分）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コンプレッション上限額（自己分）を超えることとなる清算約定（自己分）に係るコンプレッション手数料は課さないものとする。	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コンプレッション手数料（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。）に係るコンプレッション手数料に限る。）の総額がコンプレッション上限額（委託分）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、コンプレッション上限額（委託分）を超えることとなる清算約定（委託	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

分）に係るコンプレッション手数料は課さないものとする。	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。
（削る）	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定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。	（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に関する新規債務負担手数料は、次の各号に掲げる清算約定の区分に応じて、当該各号に定める金額とする。 （１）　円貨建清算約定　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「円貨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を乗じた金額 （２）　外貨建清算約定　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通貨ごとの合計額（以下「外貨建新規取引想定元本合計額」という。）について、１００万通貨単位あたり７．２を乗じた金額に、当社が公示により定める為替相場の気配値を乗じて得た金額を合計した金額	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に関する債務負担済残存取引手数料は、次の各号に掲げる清算約定の区分に応じて、当該各号に定める金額とする。 （１）　円貨建清算約定　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の想定元本の合計額（以下「円貨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を乗じた金額	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。

（２）　外貨建清算約定　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の想定元本の通貨ごとの合計額（以下「外貨建残存取引想定元本合計額」という。）について、１００万通貨単位あたり０．２５を乗じた金額に、当社が公示により定める為替相場の気配値を乗じて得た金額を合計した金額	
４　前２項の規定において、円貨建新規取引想定元本合計額又は円貨建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、円貨建新規取引想定元本合計額又は円貨建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。	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　前項の規定は、外貨建新規取引想定元本合計額又は外貨建残存取引想定元本合計額に１００万通貨単位未満の部分がある場合について準用する。この場合において、前項の規定中「１億円」とあるのは「１００万通貨単位」と、「１円」とあるのは「１００分の１通貨単位」と読み替えるものとする。	（新設）
６　前各項の規定は、業務方法書第５３条に規定する取引毎コンプレッション又は第５３条の２に規定する一括コンプレッションにより清算約定が成立する場合のクライアント・クリアリング手数料について準用する。	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。
（コラテラル手数料） 第５条の４　（略）	（コラテラル手数料） 第５条の４　（略）
２　各清算参加者のコラテラル手数料は、計算期日（３月、６月、９月及び１２月末日（当該日が休業日（臨時休業日を除く。以下本項において同じ。）の場合には、その翌日（休業日を除く。））をいう。以下本項において同じ。）の	２　各清算参加者のコラテラル手数料は、計算期日（３月、６月、９月及び１２月末日（当該日が休業日（臨時休業日を除く。以下本項において同じ。）の場合には、その翌日（休業日を除く。））をいう。以下本項において同じ。）の

翌日から次の計算期日までの期間（以下「計算期間」という。）ごとに当該各清算参加者について次の各号に掲げる費用を合計した額とする。 （１）　国債証券の管理に係る費用　次の算式により算出される額 （各清算参加者が国債証券により当社に預託している清算基金等の額面金額の合計額を、一の計算期間において平均した額）×（当該計算期間の日数）／３６５×０．１６／１０，０００ （２）　米国財務省証券の管理に係る費用　次のａからｃに掲げる算式により算出される額の合計額 ａ　（各清算参加者が米国財務省証券により当社に預託している清算基金等の額面金額（当社が公示により定めるところにより円換算した額をいう。）の合計額を、一の計算期間において平均した額）×（当該計算期間の日数）／３６５×０．１６／１０，０００ ｂ　（各清算参加者が米国財務省証券により当社に預託している清算基金等の額面金額の各月末日の経過時点における時価（当社が公示により定めるところにより算出する額をいう。）の合計額）×（当該各月の日数）／３６５×０．８５／１０，０００ ｃ　（略） （３）　（略）	翌日から次の計算期日までの期間（以下本項において「計算期間」という。）ごとに当該各清算参加者について次の各号に掲げる費用を合計した額とする。 （１）　国債証券の管理に係る費用　次の算式により算出される額 （各清算参加者が国債証券により当社に預託している清算基金等の額面金額の合計額を、一の計算期間において平均した額）×（当該計算期間の日数）／（当該計算期間の属する計算年度の日数）×０．１６／１０，０００ （２）　米国財務省証券の管理に係る費用　次のａからｃに掲げる算式により算出される額の合計額 ａ　（各清算参加者が米国財務省証券により当社に預託している清算基金等の額面金額（当社が公示により定めるところにより円換算した額をいう。）の合計額を、一の計算期間において平均した額）×（当該計算期間の日数）／（当該計算期間の属する計算年度の日数）×０．１６／１０，０００ ｂ　（各清算参加者が米国財務省証券により当社に預託している清算基金等の額面金額の各月末日の経過時点における時価（当社が公示により定めるところにより算出する額をいう。）の合計額）×（当該各月の日数）／（当該計算期間の属する計算年度の日数）×０．８５／１０，０００ ｃ　（略） （３）　（略）
（外貨決済手数料） 第５条の５　外貨決済手数料は、各当社営業日において外貨建清算約定の当事者となっている清算参加者ごとに、次の各号に掲げる外貨建清算	（新設）

約定の通貨の数に応じて、当該各号に定める金額とする。ただし、清算参加者が月の途中で外貨建清算約定の当事者となった場合（すでに当事者となっている通貨以外の通貨に係る外貨建清算約定の当事者となった場合を含む。）又は当事者でなくなった場合（複数の通貨の外貨建清算約定のうちの１通貨について当事者でなくなった場合を含む。）には、次の各号に掲げる外貨建清算約定の通貨の数に応じて、当該各号に定める金額に当該月の全当社営業日の日数に占める当該清算参加者が当該各号に掲げる通貨の数の外貨建清算約定の当事者であった当該月の当社営業日の日数の割合を乗じて得た額（当該月において当該清算参加者が当事者であった外貨建清算約定の通貨の数が次の各号のうち複数に該当するときは、当該額を合計した額）とする。 （１）　１通貨　１か月あたり５４，０００円 （２）　２通貨　１か月あたり１０８，０００円 （３）　３通貨　１か月あたり１６２，０００円 ２　清算参加者が業務方法書第８５条の４第４項に規定する届出を行っている場合において、当該届出に係る通貨の外貨決済手数料は、同項に規定する指定口座（同条第５項の規定により一つの指定口座とみなされたものを含む。以下本項において同じ。）の数に、１か月あたり５４，０００円を乗じた額とし、当該指定口座以外の自己取引口座又は委託取引口座について前項の規定により算出した額を合算した額を当該清算参加者に係る外貨決済手数料とする。	
（外貨建指定清算参加者の手数料に関する特則） 第５条の６　第４条の２及び第５条の５の規定にかかわらず、外貨建指定清算参加者が負担する	（新設）

各月の清算約定（自己分）（外貨建清算約定に限る。以下本項において同じ。）に係る清算手数料及び外貨決済手数料の総額は、次の各号に掲げる通貨に関して指定を受けた外貨建指定清算参加者に応じて、当該各号に定める額を、第４条の２及び第５条の５の規定に基づいて算出した清算約定（自己分）に係る清算手数料及び外貨決済手数料の額を合計した額（以下「外貨手数料総額」という。）から減じた額とする。ただし、清算参加者が月の途中で外貨建指定清算参加者として指定を受け又は指定の取消しを受けた場合における当該月の外貨手数料総額から減じる額は、次の各号に掲げる外貨建指定清算参加者に応じて、当該各号に定める額に当該月の全当社営業日の日数に占める当該清算参加者が外貨建指定清算参加者であった当該月の当社営業日の日数の割合を乗じて得た額（当該月において、当該清算参加者が次の各号のうち複数の外貨建指定清算参加者に該当することとなったときは、当該額を合計した額）とする。

（１）　オーストラリア・ドル、米ドル又はユーロ建ての金利スワップ取引の気配値のうち、いずれか１通貨に係る気配値に関して指定を受けた外貨建指定清算参加者　６万円

（２）　前号に掲げる通貨に係る気配値のうち、いずれか２通貨に係る気配値に関して指定を受けた外貨建指定清算参加者　１２万円

（３）　第１号に掲げる通貨に係る気配値のうち、すべての気配値に関して指定を受けた外貨建指定清算参加者　２０万円

２　前項第１号及び第２号の規定は、同号に規定する外貨建指定清算参加者が指定を受けた通貨に係る外貨建清算約定の当事者である場合には、適用しない。

３　前２項の規定にかかわらず、各月の外貨建指定清算参加者の外貨手数料総額から減じる額

は、当該月の外貨手数料総額を上限とする。	
（ＬＩＢＯＲライセンス手数料）	
第５条の７　各月のＬＩＢＯＲライセンス手数料は、自己取引口座及び委託取引口座ごとに、変動金利としてＪＰＹ－ＬＩＢＯＲ－ＢＢＡ又はＵＳＤ－ＬＩＢＯＲ－ＢＢＡを対象とする清算約定について、当社が公示により定める債務負担の申込みの日における終了日までの期間に応じて、当該各月に成立した清算約定（業務方法書第５３条に規定する取引毎コンプレッション又は第５３条の２に規定する一括コンプレッションにより成立した清算約定を除く。）の想定元本の通貨ごとの合計額（外貨建清算約定に係る合計額にあっては、当社が公示により定める為替相場の気配値を用いて日本円に換算した額の合計額とする。）に、当社が公示により定める値を乗じた金額を１，０００，０００で除した額の総額とする。	（新設）
（株主清算参加者の基本料及び円貨建清算約定に係る清算手数料に関する特則）	（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及び円貨建清算約定に係る清算手数料（清算約定（委託分）に係る清算手数料を除く。）の総額の上限（以下「自己取引上限額」という。）は、１億２４０万円とする。	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。
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	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）（円貨建清算約定に限り、クライアント・クリアリングに係る清算約定を除く。）に係る清算手数料の上限（以下「委託取引上限額」という。）は、当該清算約定（委託分）が記録されている委託取引口座ごとに、４，０００万円（当該計算年度の下半期に当社に開設された委託取引口座については、２，０００万円）を上限とする。	加者であった期間）において負担する清算約定（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。）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。
３　清算参加者が計算年度の下半期に株主清算参加者となった場合において、当該清算参加者が当該計算年度のうち株主清算参加者であった期間において負担する基本料及び円貨建清算約定に係る清算手数料の上限は、前２項の規定にかかわらず、次に定めるとおりとする。 （１）　自己取引上限額　５，１２０万円 （２）　委託取引上限額　清算約定（委託分）（円貨建清算約定に限り、クライアント・クリアリングに係る清算約定を除く。）が記録されている委託取引口座ごとに２，０００万円	３　清算参加者が計算年度の下半期に株主清算参加者となった場合において、当該清算参加者が当該計算年度のうち株主清算参加者であった期間において負担する手数料の上限は、前２項の規定にかかわらず、次に定めるとおりとする。 （１）　自己取引上限額　５，０００万円 （２）　委託取引上限額　清算委託者ごとに２，０００万円
４　株主清算参加者が円貨建指定清算参加者である場合には、前３項の規定にかかわらず、前３項に定める自己取引上限額から２４０万円（当該株主清算参加者が計算年度の途中で円貨建指定清算参加者となった場合には、円貨建指定清算参加者となるまでの計算年度の経過月数（１か月未満の月を除く。）に２０万円を乗じた金額（円貨建指定清算参加者となるまでの計算年度の経過月数に１か月未満の月がある場合には、２０万円から当該月において第３条第２項の規定により減じられた額を控除した金額を加算した額）を、２４０万円から控除した額）を控除した額を自己取引上限額とする。	４　株主清算参加者が指定清算参加者である場合には、前３項の規定にかかわらず、前３項に定める自己取引上限額から２４０万円（当該株主清算参加者が計算年度の途中で指定清算参加者となった場合には、指定清算参加者となるまでの計算年度の経過月数（１か月未満の月を除く。）に２０万円を乗じた金額（指定清算参加者となるまでの計算年度の経過月数に１か月未満の月がある場合には、２０万円から当該月において第３条第２項の規定により減じられた額を控除した金額を加算した額）を、２４０万円から控除した額）を控除した額を自己取引上限額とする。
５　株主清算参加者が円貨建指定清算参加者であった場合において、計算年度の途中で株主清算	５　株主清算参加者が指定清算参加者であった場合において、計算年度の途中で株主清算参加者

参加者が円貨建指定清算参加者でなくなったときは、前各項の規定にかかわらず、その時点で、当該計算年度の残存月数（１か月未満の月を除く。）に２０万円を乗じた金額（残存月数に１か月未満の月がある場合には、２０万円から当該月において第３条第２項ただし書きにより減じられた額を控除した金額を加算した額）を、前項の規定により算出された当該株主清算参加者の自己取引上限額に加えた金額を当該株主清算参加者の自己取引上限額とする。	が指定清算参加者でなくなったときは、前各項の規定にかかわらず、その時点で、当該計算年度の残存月数（１か月未満の月を除く。）に２０万円を乗じた金額（残存月数に１か月未満の月がある場合には、２０万円から当該月において第３条第２項ただし書により減じられた額を控除した金額を加算した額）を、前項の規定により算出された当該株主清算参加者の自己取引上限額に加えた金額を当該株主清算参加者の自己取引上限額とする。
６　（略）	６　（略）
（株主清算参加者のコンプレッション手数料に関する特則）	
第６条の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）において負担するコンプレッション手数料（清算約定（委託分）に係るコンプレッション手数料を除く。）の総額の上限（以下「コンプレッション上限額（自己分）」という。）は、８，０００万円とする。 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）（クライアント・クリアリングに係る清算約定を除く。）に係るコンプレッション手数料の総額の上限（以下「コンプレッション上限額（委託分）」という。）は、当該清算約定（委託分）が記録されている委託取引口座ごとに、８，０００万円（当該計算年度の下半期に当社に開設された委託取引口座については、４，０００万円）を上限とする。	（新設）

３　清算参加者が計算年度の下半期に株主清算参加者となった場合において、当該清算参加者が当該計算年度のうち株主清算参加者であった期間において負担するコンプレッション手数料の総額の上限は、前２項の規定にかかわらず、次に定めるとおりとする。 （１）　コンプレッション上限額（自己分）　４，０００万円 （２）　コンプレッション上限額（委託分）　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。）が記録されている委託取引口座ごとに４，０００万円	
（手数料の支払時期等） 第７条　清算参加者は、毎月分の基本料、円貨建清算約定及び外貨建清算約定に係る清算手数料、コンプレッション手数料、クライアント・クリアリング手数料、口座開設手数料、外貨決済手数料、ＬＩＢＯＲライセンス手数料並びにクロスマージン手数料の合計額を、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。	（手数料の支払時期等） 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。
２　清算参加者は、各計算期間において算出されるコラテラル手数料（第５条の４第２項第２号ｂ及びｃに掲げる費用を除く。）を、当該計算期間の末日の属する月の翌々月（当該計算期間の末日が３月、６月、９月又は１２月の末日ではない場合には、当該計算期間の末日の属する月の翌月）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。	２　清算参加者は、各計算期間において算出されるコラテラル手数料（第５条の４第２項第２号ｂ及びｃに掲げる費用を除く。）を、当該計算期間の末日の属する月の翌々月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。
３　（略）	３　（略）

付　　則 １　この改正規定は、平成２７年９月２４日（以下「施行日」という。）から施行する。 ２　第３条第１項の規定にかかわらず、施行日の属する月の基本料は、５０５万円とする。 ３　第６条第１項及び第３項の規定にかかわらず、施行日の属する計算年度（当該清算参加者が当該期間の途中で株主清算参加者でなくなった場合には、当該期間のうち株主清算参加者であった期間。以下同じ。）における自己取引上限額は、当該計算年度における４月１日から施行日の前当社営業日までの期間において株主清算参加者が負担した基本料、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（改正前の本規則第５条に規定する任意解約手数料をいう。以下同じ。）（清算約定（委託分）に係る任意解約手数料を除く。）の総額に、施行日から当該計算年度の末日までの期間において負担する基本料及び円貨建清算約定に係る清算手数料（清算約定（委託分）に係る清算手数料を除く。）の総額を加算した額とする。この場合において、本規則第６条第４項の規定中「前３項」とあるのは「付則第３項」と、本規則第６条第５項の規定中「前各項」とあるのは「前項及び付則第３項」と、本規則第６条第６項の規定中「前各項」とあるのは「第３項、第４項及び付則第３項」それぞれ読み替えるものとする。 ４　第６条第２項及び第３項の規定にかかわらず、施行日の属する計算年度における委託取引上限額は、当該計算年度における４月１日から施行日の前当社営業日までの期間に株主清算参加者が負担した清算約定（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。）に係る	

清算手数料及び任意解約手数料の総額に、施行日から当該計算年度の末日までの期間において負担する清算約定（委託分）（外貨建清算約定及びクライアント・クリアリングに係る清算約定を除く。）に係る清算手数料の総額を加算した額とする。 ５　第３項及び第４項に規定する施行日の属する計算年度における各上限額は、次の各号に掲げる項目に応じて当該各号に定める額とする。 （１）　自己取引上限額　１億１２５万円 （２）　委託取引上限額　４，０００万円 ６　第６条の２第１項から第３項までの規定にかかわらず、株主清算参加者が施行日の属する計算年度において負担するコンプレッション手数料の総額の上限は、次の各号に掲げる項目に応じて当該各号に定める額とする。 （１）　コンプレッション上限額（自己分）　４，０００万円 （２）　コンプレッション上限額（委託分）　４，０００万円	

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
（金利スワップ清算基金所要額） 第２条　（略） ２　（略） 付　　則 この改正規定は、平成２７年９月２４日から施行する。	（金利スワップ清算基金所要額） 第２条　（略） ２　（略）
別表　金利スワップ清算基金所要額の算出に関する表 １　（略） 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前項の各清算参加者の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（業務方法書第５３条第２項の規定に従い当社が取引毎コンプレッション要件の充足の確認を行ったときは、当該確認を行った時点をいい、業務方法書第５８条の３第１項又は第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、当該承諾の時点をいう。）における自己取引口座及び各委託取引口座に係る清算約定に係るス	別表　金利スワップ清算基金所要額の算出に関する表 １　（略） 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第１項の各清算参加者の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時の時点における自己取引口座及び各委託取引口座に係る清算約定（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り、当該清算約定から当該各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

トレス時リスク相当額（金利スワップ取引に係る清算イールド・カーブ並びにクロスマージン対象国債先物清算約定に係るイールド・カーブの極端な変動により、当該清算約定から当該各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。）から当該各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、当該各清算参加者について合算した額をいう。	る方法により算出するものをいう。）から当該各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、当該各清算参加者について合算した額をいう。

別紙１

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
（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９４条の規定による同条第１項に規定する承継、損失回避取引及びクロスマージン処分取引の実施、破綻処理入札の実施、業務方法書第９５条の２の規定による破綻処理入札の再実施又は協議の実施及び業務方法書第９６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金利スワップ決済保証準備金、第二階層金利スワップ決済保証準備金及び金利スワップ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、かつ、破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに個別に行うものとする。	（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９４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９６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金利スワップ決済保証準備金、第二階層金利スワップ決済保証準備金及び金利スワップ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。
（破綻処理清算約定の期限前終了手数料） 第６条　業務方法書第９１条の規定による破綻処理清算約定の強制解約に伴い、当社及び破綻清算参加者の間で授受すべき破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとの期限前終了手数料の額は、次の各号に掲げる場合に応じて、当該各号に定めるところにより算出した額（外貨建清算	（破綻処理清算約定の期限前終了手数料） 第６条　業務方法書第９１条の規定による破綻処理清算約定の強制解約に伴い、当社及び破綻清算参加者の間で授受すべき期限前終了手数料の額は、次の各号に掲げる場合に応じて、当該各号に定めるところにより算出する。

約定の強制解約に伴い授受すべき期限前終了手数料にあっては、当社が公示により定める為替相場の気配値を用いて日本円に換算した額）とする。	
（１）　破綻処理入札に係る入札対象取引が当社及び落札参加者との間で成立した場合 　次のａ及びｂに掲げるものに係る差引累計額（当社の支払うべき額の総額から受け取るべき額の総額を控除した額をいう。以下本条において同じ。）が正数の場合には当該差引累計額の絶対値に相当する額を当該破綻処理清算約定について破綻清算参加者が当社に支払うべき期限前終了手数料の総額とし、差引累計額が負数の場合には当該差引累計額の絶対値に相当する額を当該破綻処理清算約定について当社が破綻清算参加者に支払うべき期限前終了手数料の総額とする。 ａ　（略） ｂ　破綻認定日から破綻処理入札実施日までの間に、当該破綻処理清算約定が強制解約されなかった場合に当社が破綻清算参加者との間で授受すべきであった固定金額、変動金額その他の金銭（変動証拠金を除く。）並びに損失回避取引及びクロスマージン処分取引について当社及び清算参加者の間で授受された固定金額、変動金額その他の金銭（変動証拠金を除く。）	（１）　破綻処理入札に係る入札対象取引が当社及び落札参加者との間で成立した場合 　次のａ及びｂに掲げるものに係る差引累計額（当社の支払うべき額の総額から受け取るべき額の総額を控除した額をいう。以下本条において同じ。）が正数の場合には当該差引累計額の絶対値に相当する額を当該破綻処理清算約定について破綻清算参加者が当社に支払うべき期限前終了手数料の総額とし、差引累計額が負数の場合には当該差引累計額の絶対値に相当する額を当該破綻処理清算約定について当社が破綻清算参加者に支払うべき期限前終了手数料の総額とする。 ａ　（略） ｂ　破綻認定日から破綻処理入札実施日までの間に、破綻処理清算約定の反対清算約定及び損失回避取引について当社及び清算参加者の間で授受された固定金額、変動金額その他の金銭（変動証拠金を除く。）
（２）　破綻処理入札が実施された場合において、業務方法書第９６条第１項の規定による協議における合意により、又は協議における合意が成立しないことにより、入札対象取引が成立しなかったとき 　次のａ及びｂに掲げるものに係る差引累計額が正数の場合には当該差引累計額の絶対値に相当する額を当該破綻処理清算約定について破綻清算参加者が当社に支払うべき期限前	（２）　破綻処理入札が実施された場合において、業務方法書第９６条第１項の規定による協議における合意により、又は協議における合意が成立しないことにより、入札対象取引が成立しなかったとき 　次のａ及びｂに掲げるものに係る差引累計額が正数の場合には当該差引累計額の絶対値に相当する額を当該破綻処理清算約定について破綻清算参加者が当社に支払うべき期限前

終了手数料の総額とし、差引累計額が負数の場合には当該差引累計額の絶対値に相当する額を当該破綻処理清算約定について当社が破綻清算参加者に支払うべき期限前終了手数料の総額とする。 a　（略） b　破綻認定日から破綻処理入札実施日までの間に、当該破綻処理清算約定が強制解約されなかった場合に当社が破綻清算参加者との間で授受すべきであった固定金額、変動金額その他の金銭（変動証拠金を除く。）並びに損失回避取引及びクロスマージン処分取引について当社及び清算参加者の間で授受された固定金額、変動金額その他の金銭（変動証拠金を除く。）	終了手数料の総額とし、差引累計額が負数の場合には当該差引累計額の絶対値に相当する額を当該破綻処理清算約定について当社が破綻清算参加者に支払うべき期限前終了手数料の総額とする。 a　（略） b　破綻認定日から破綻処理入札実施日までの間に、破綻処理清算約定の反対清算約定及び損失回避取引について当社及び清算参加者の間で授受された固定金額、変動金額その他の金銭（変動証拠金を除く。）
（損失回避取引の実施） 第７条　（略） ２　（略） ３　損失回避取引が成立した場合であってアップフロントフィーの授受に合意したときは、当社及び相手方は、損失回避取引の成立日の翌当社営業日（損失回避取引に係る通貨が日本円以外の通貨である場合は、当該通貨に係る翌外貨本国営業日）に、合意したアップフロントフィーの授受を行う。 ４・５　（略）	（損失回避取引の実施） 第７条　（略） ２　（略） ３　損失回避取引が成立した場合であってアップフロントフィーの授受に合意したときは、当社及び相手方は、損失回避取引の成立日の翌当社営業日に、合意したアップフロントフィーの授受を行う。 ４・５　（略）
（クロスマージン処分取引の実施） 第７条の２　当社は、業務方法書第９３条の２第２項の規定によりクロスマージン処分取引を行う場合には、清算参加者（破綻清算参加者を除く。）を相手方としてクロスマージン処分取引を行う。 ２　当社は、クロスマージン処分取引を、クロスマージン対象国債先物清算約定の転売又は買戻	（新設）

しの相手方となった者又は当該相手方から取次ぎの委託を受けた者を相手方として行うものとする。ただし、当社が、金利スワップ取引の市場の状況その他の事情を勘案し、金利スワップ破綻管理委員会の助言に基づきこれによることが困難であると認めた場合は、この限りでない。

３　クロスマージン処分取引は適格金利スワップ取引であることを要する。

４　クロスマージン処分取引が成立した場合であってアップフロントフィーの授受に合意したときは、当社及び当該クロスマージン処分取引の相手方は、クロスマージン処分取引の成立日の翌当社営業日に、合意したアップフロントフィーの授受を行う。当該クロスマージン処分取引の成立と同時に、業務方法書第９３条の２第４項の規定により金利スワップ取引が成立したときにおける当該金利スワップ取引に係るアップフロントフィーについても、同様に当社及び当該清算参加者との間で授受を行う。

５　前４項に規定するほか、クロスマージン処分取引の相手方及び取引条件の決定方法その他クロスマージン処分取引の実施に関し必要な事項は、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。

６　当社と清算参加者の間にクロスマージン処分取引が成立した場合において、当該清算参加者が清算委託者の計算において当該クロスマージン処分取引を行うものであるときは、当該クロスマージン処分取引は当該清算委託者の当該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約定（委託分）と、当該クロスマージン処分取引に係る清算参加者と清算委託者の間の法律関係は本項の規定により清算約定（委託分）とみなされる当該クロスマージン処分取引に係る清算委託取引と、それぞれみなす。

（清算約定（委託分）の承継） 第８条　（略） ２　（略） ３　業務方法書第９４条第１項に規定する当社が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（自身をクロスマージン利用者とする業務方法書第８４条の２に規定する届出が行われている清算委託者を除く。）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。	（清算約定（委託分）の承継） 第８条　（略） ２　（略） ３　業務方法書第９４条第１項に規定する当社が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１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）
５　業務方法書第９４条第５項に規定する承継時支払金額、未払債務及び変動証拠金は、次に定めるところにより破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに算出し、当該通貨の種類ごとに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破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとの変動証拠金の差引累計額（当該通貨の種類ごとの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、当該通貨の種類ごとに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	４　業務方法書第９４条第５項に規定する承継時支払金額、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

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。	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）　破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとの未払債務は、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（破綻認定日が金利支払日であって、同日に固定金額、変動金額及びアップフロントフィーの授受が完了している場合には、その翌当社営業日又は翌外貨本国営業日）から承継日までに授受されるべき当該通貨の種類ごとの固定金額、変動金額及びアップフロントフィーの合計額とする。	（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計額とする。
（３）　破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとの変動証拠金の額は、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当該通貨の種類ごとの変動証拠金の額とする。	（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。
６　業務方法書第９４条第５項の規定にかかわらず、承継日に授受すべき日本円以外の通貨を想定元本及び決済通貨とする対象清算約定に係る固定金額、変動金額及びアップフロントフィーの授受は、業務方法書第８５条の４第３項各号に規定する日時までに行うものとする。	５　業務方法書第９４条第１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。
７　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項の規定により破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに算出した承継時支払金額、未払債務及び変動証拠金を当該通貨の種類ごとに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	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。）。

たものを除く。）。 ８　業務方法書第９４条第６項第６号に規定する対象清算約定に係る通貨の種類ごと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当該通貨の種類ごとの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当該通貨の種類ごとに支払い、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当該通貨の種類ごとに支払う。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当該通貨の種類ごとに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。	７　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。
（破綻処理入札参加義務） 第９条　破綻清算参加者以外の清算参加者（特定承継金融機関等である清算参加者を除く。以下本項において同じ。）は、当該破綻清算参加者に係る破綻認定日から起算して過去９０日間（当該清算参加者が第１号に該当する場合には、過去３０日間）のうちのいずれかの日に自身が当事者となっている清算約定と想定元本及び決済通貨の種類を同一とする破綻処理清算約定に係る破綻処理入札について、参加する義務を負う。ただし、日本円を想定元本及び決済通貨とする破綻処理清算約定に係る破綻処理入札については、すべての清算参加者（次に掲げるすべての要件を満たす清算参加者を除く。）が参加する義務を負う。 （１）　（略） （２）　自らを当事者とするすべての清算約定が解消されていること。	（破綻処理入札参加義務） 第９条　破綻清算参加者以外の清算参加者（次に掲げるすべての要件を満たす清算参加者及び特定承継金融機関等である清算参加者を除く。）は、破綻処理入札に参加する義務を負う。 （１）　（略） （２）　自らを当事者とする全ての清算約定が解消されていること。

２～４　（略）	２～４　（略）
（破綻処理入札に関する基本的事項） 第１０条　（略） （１）　破綻処理清算約定（破綻処理入札の実施までに業務方法書第９４条の規定により承継清算参加者に承継された清算約定（委託分）に対応するものを除く。）に相当する金利スワップ取引並びに損失回避取引及びクロスマージン処分取引と反対のポジションを形成する金利スワップ取引（当社の取引ポジションを除くほか、損失回避取引及びクロスマージン処分取引とその内容を同一とする金利スワップ取引とする。）を当該金利スワップ取引に係る通貨の種類ごとに一括して入札対象取引とする。ただし、当社は、当該破綻処理清算約定、損失回避取引及びクロスマージン処分取引の規模、清算参加者の状況、金利スワップ取引の市場の状況その他の事情を勘案し、必要があると認めるときは、金利スワップ破綻管理委員会の助言に基づき、これと異なる複数の入札対象取引を設定することができる。	（破綻処理入札に関する基本的事項） 第１０条　（略） （１）　破綻処理清算約定（破綻処理入札の実施までに業務方法書第９４条の規定により承継清算参加者に承継された清算約定（委託分）に対応するものを除く。）に相当する金利スワップ取引及び損失回避取引の反対清算約定となるべき金利スワップ取引（当社の取引ポジションを除くほか、損失回避取引とその内容を同一とする金利スワップ取引とする。）を一括して入札対象取引とする。ただし、当社は、当該破綻処理清算約定及び損失回避取引の規模、清算参加者の状況、金利スワップ取引の市場の状況その他の事情を勘案し、必要があると認めるときは、金利スワップ破綻管理委員会の助言に基づき、これと異なる複数の入札対象取引を設定することができる。
（２）　破綻処理入札における入札は、破綻処理入札参加者が、第１１条第１項に規定する実施時間内に、当該入札対象取引の成立に伴い当社及び落札参加者の間で授受される正数又は負数の落札時支払金額を入札価格として提示することにより行う。	（２）　破綻処理入札における入札は、破綻処理入札参加者が、第１１条第１項に規定する時間内に、当該入札対象取引の成立に伴い当社及び落札参加者の間で授受される正数又は負数の落札時支払金額を入札価格として提示することにより行う。
２・３　（略）	２・３　（略）
（破綻処理入札の実施） （削る）	（破綻処理入札の実施） 第１１条　当社は、破綻処理入札実施日の午前９時から午前９時３０分まで、破綻処理入札を実施する。ただし、当社は、金利スワップ破綻管理委員会の助言に基づき、破綻処理入札の時間

	を変更することができる。
第１１条　破綻処理入札の実施時間、実施条件その他破綻処理入札の実施に関し必要な事項は、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。	２　前項に規定するもののほか、破綻処理入札の実施条件その他破綻処理入札の実施に関し必要な事項は、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。
２　（略）	３　（略）
３　（略）	４　（略）
４　（略）	５　（略）
（破綻処理入札に係る入札対象取引の成立）	（破綻処理入札に係る入札対象取引の成立）
第１２条　（略）	第１２条　（略）
２　（略）	２　（略）
３　当社は、第１項の規定により破綻処理入札に係る落札価格及び落札参加者が確定したときは、落札価格及び自社が落札参加者であるか否かの別（以下「落札結果」という。）を直ちに破綻清算参加者以外の当該破綻処理入札に参加する義務を負う各清算参加者に通知する。	３　当社は、第１項の規定により破綻処理入札に係る落札価格及び落札参加者が確定したときは、落札価格及び自社が落札参加者であるか否かの別（以下「落札結果」という。）を直ちに破綻清算参加者以外の各清算参加者に通知する。
４　前３項の規定にかかわらず、破綻処理入札に係る落札価格及び落札参加者を確定させた場合において、当該破綻処理入札に関していずれかの清算参加者（破綻清算参加者を除く。）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の合計額が、当該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、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えるときは、次の各号に定めるとおり破綻処理入札に係る落札価格及び落札参加者を確定させ、又は破綻処理入札の再実施若しくは協議を行う。	４　前３項の規定にかかわらず、破綻処理入札に係る落札価格及び落札参加者を確定させた場合において、いずれかの清算参加者（破綻清算参加者を除く。）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の合計額が、当該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、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えるときは、次の各号に定めるとおり破綻処理入札に係る落札価格及び落札参加者を確定させ、又は破綻処理入札を再実施する。
（１）　（略）	（１）　（略）
（２）　当社は、破綻処理入札実施日の当社がその都度定める時間までに、当該破綻処理入札に係る落札価格及び落札参加者を確定させたと仮定した場合に各清算参加者が負担する	（２）　当社は、破綻処理入札実施日の午前１０時３０分までに、当該破綻処理入札に係る落札価格及び落札参加者を確定させたと仮定した場合に各清算参加者が負担することとな

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の額並びに第２３条第２号及び第２４条第２号の規定により当社に預託すべき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額を通知する。	る第三階層特別清算料及び第四階層特別清算料の額並びに第２３条第２号及び第２４条第２号の規定により当社に預託すべき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額を通知する。
（３）　破綻処理入札実施日の当社がその都度定める時間までに、全ての清算参加者が当社に預託すべき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全額を当社に預託した場合には、当社は、直ちに当該破綻処理入札に係る落札価格及び落札参加者を確定させる。第２項及び第３項の規定は、本号の規定により当社が当該破綻処理入札に係る落札価格及び落札参加者を確定させた場合について準用する。	（３）　破綻処理入札実施日の午後０時３０分までに、全ての清算参加者が当社に預託すべき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全額を当社に預託した場合には、当社は、直ちに当該破綻処理入札に係る落札価格及び落札参加者を確定させる。第２項及び第３項の規定は、本号の規定により当社が当該破綻処理入札に係る落札価格及び落札参加者を確定させた場合について準用する。
（４）　前号に規定する場合以外の場合には、当該破綻処理入札は不成立とし、第９条から本条までの規定に従い、当社がその都度定める日時に、再度、破綻処理入札を実施する。	（４）　前号に規定する場合以外の場合には、当該破綻処理入札は不成立とし、第９条から本条までの規定に従い、破綻処理入札実施日の翌当社営業日に、再度、破綻処理入札を実施する。
（受託清算参加者の破綻処理入札の参加）	（受託清算参加者の破綻処理入札の参加）
第１３条　（略）	第１３条　（略）
２　（略）	２　（略）
３　前項の場合、当社及び同項の受託清算参加者の間で成立する入札対象取引は同項の清算委託者の当該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約定（委託分）と、当該入札対象取引に係る当該受託清算参加者と当該清算委託者の間の法律関係は本項の規定により清算約定（委託分）とみなされる当該入札対象取引に係る清算委託取引と、それぞれみなす。	３　前項の場合、当社及び同項の受託清算参加者の間で成立する入札対象取引は同項の清算委託者の当該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約定（委託分）と、当該入札対象取引に係る当該受託清算参加者と当該清算委託者の間の法律関係は本項の規定により清算約定（委託）とみなされる当該入札対象取引に係る清算委託取引と、それぞれみなす。
（入札対象取引の成立に伴う落札時支払金額等の授受）	（入札対象取引の成立に伴う落札時支払金額等の授受）

第１４条　（略）	第１４条　（略）
２　（略）	２　（略）
（削る）	３　業務方法書第９９条第４項に規定する入札対象取引の反対清算約定となる清算約定は、入札対象取引に対応する破綻処理清算約定の反対清算約定及び損失回避取引とする。ただし、第１０条第１項第１号の定めるところにより当社が複数の入札対象取引を設定した場合には、業務方法書第９９条第４項に規定する入札対象取引の反対清算約定となる清算約定は、当社がその都度指定する。
（協議の方法等）	（協議の方法等）
第１５条　当社は、破綻処理入札を実施した場合には、その落札価格及び落札参加者を確定させる前に、当該破綻処理入札に係る入札対象取引を成立させることにより当社に生じ得る破綻処理損失の額を試算する。この場合において、当該額が当該破綻処理入札に係る破綻処理清算約定の通貨の種類に関する損失補填財源（再配分金利スワップ清算基金、再配分第一階層金利スワップ決済保証準備金、再配分第二階層金利スワップ決済保証準備金及び再配分第三階層特別清算料がある場合にあっては、それらを含む。）を超過することが判明した場合には、当社及び当該破綻処理入札に参加する義務を負うすべての清算参加者（破綻清算参加者を除く。以下本条及び次条において同じ。）は、直ちに業務方法書第９５条の２の規定により破綻処理入札の再実施又は協議のいずれかを行う。	第１５条　当社は、破綻処理入札を実施した場合には、その落札価格及び落札参加者を確定させる前に、当該破綻処理入札に係る入札対象取引を成立させることにより当社に生じ得る破綻処理損失の額を試算する。この場合において、当該額が損失補填財源を超過することが判明した場合には、当社及び清算参加者（破綻清算参加者を除く。以下本条及び次条において同じ。）は、直ちに業務方法書第９６条の規定により協議を行う。
２～５　（略）	２～５　（略）
（協議期間）	（協議期間）
第１６条　業務方法書第９７条第１項に規定する当社が規則で定める期間は、破綻処理入札実施日から起算して２当社営業日目の日までの間と	第１６条　業務方法書第９７条第１項に規定する当社が規則で定める期間は、破綻処理入札実施日から起算して２当社営業日目の日までの間と

する。ただし、当社及び当該破綻処理入札に参加する義務を負うすべての清算参加者の間で合意した場合には、当該期間を延長することができる。	する。ただし、当社及びすべての清算参加者の間で合意した場合には、当該期間を延長することができる。
（清算約定の強制終了） 第１７条　業務方法書第９７条第１項の規定により同項に規定する清算約定が終了した場合、当社及び清算参加者は、当該終了の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手数料を授受するものとする。この場合において、期限前終了手数料の額は、当該終了した各清算約定について当該終了の日の翌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し、当社及び清算参加者の間で当該各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する。	（すべての清算約定の強制終了） 第１７条　業務方法書第９７条第１項の規定によりすべての清算約定が終了した場合、当社及び清算参加者は、当該終了の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手数料を授受するものとする。この場合において、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翌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し、当社及び清算参加者の間で当該各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する。
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る期限前終了手数料を支払い、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）	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）	３　（略）
第３章の２　破綻清算参加者の預託している当初証拠金の按分等	（新設）
（未決済債務等の日本円への換算） 第１７条の２　業務方法書第１０１条第１項第１	（新設）

号ｂからｄ及び同項第２号ｃに規定する破綻処理清算約定に係る変動証拠金、変動証拠金の利息、未履行債務及び支払債務の日本円への換算は、当社が公示により定める為替相場の気配値を用いて行うものとする。	
（当初証拠金等の破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとの按分） 第１７条の３　業務方法書第１０１条第１項第２号ｄに規定する当初証拠金を破綻処理清算約定の通貨の種類ごとに按分する額は、破綻清算参加者の預託している当初証拠金を、破綻処理入札の前当社営業日における当該破綻処理清算約定の通貨の種類ごとの当初証拠金所要額相当額（業務方法書第２９条、第２９条の２、第３２条及び第６４条の規定に準じて算出する当初証拠金所要額に相当する額をいう。以下同じ。）に応じて按分した額とする。 ２　前項の規定は、業務方法書第１０１条第１項第２号ｅ及びｆの規定により金利スワップ清算基金若しくは破綻時証拠金又は他の清算業務に係る余剰担保を破綻処理清算約定の通貨の種類ごとに按分する場合に準用する。この場合において、前項の規定中「当初証拠金」とあるのは「金利スワップ清算基金又は破綻時証拠金」又は「他の清算業務に係る余剰担保」と読み替えるものとする。	（新設）
（当初損失確定日） 第１８条　業務方法書第１０２条第１項に規定する当初損失確定日は、次の各号に掲げる場合に応じて、当該各号に定める日とする。 （１）・（２）　（略） （３）　業務方法書第９７条第１項の規定により清算約定が終了した場合　当該終了の日の翌当社営業日	（当初損失確定日） 第１８条　業務方法書第１０２条第１項に規定する当初損失確定日は、次の各号に掲げる場合に応じて、当該各号に定める日とする。 （１）・（２）　（略） （３）　業務方法書第９７条第１項の規定により<u>すべての</u>清算約定が終了した場合　当該終了の日の翌当社営業日

（破綻清算参加者の当初証拠金等の異なる通貨への配分） 第１８条の２　業務方法書第１０２条の２に規定する算出結果を按分した額は、当該算出結果の額を、当該破綻処理清算約定に関して行われる破綻処理入札実施日（当該破綻処理清算約定に関して複数の破綻処理入札が行われる場合は、当該破綻処理入札のうち最初に到来する破綻処理入札実施日）の前当社営業日における当該破綻処理清算約定の通貨の種類ごとに算出した当初証拠金所要額相当額に応じて按分した額とする。	（新設）
（破綻処理損失から除くべき損失等） 第１９条　業務方法書第１０３条第１項に規定する当社が規則で定める当社の損失は、業務方法書第９７条第１項の規定により特定の通貨を想定元本及び決済通貨とするすべての清算約定が終了した場合における第６条第１項第２号ａに相当する額に対応する当社の損失とする。 ２　業務方法書第１０３条第１項に規定する当社が規則で定める当社に生じたその他の損失は、業務方法書第９７条第１項の規定により清算約定が終了した場合において、破綻処理入札実施日の翌日から当初損失確定日までの間に、破綻処理清算約定について当社及び破綻清算参加者の間で授受されるべき変動証拠金、固定金額、変動金額その他の金銭に係る当社の総受取額から総支払額を控除した額並びに損失回避取引及びクロスマージン処分取引について当社及び清算参加者の間で授受されるべき変動証拠金、固定金額、変動金額その他の金銭に係る差引累計額（当社の総支払額から総受取額を控除した額をいう。）を合計した額が正数となるときにおける当該差引累計額の絶対値に相当する額に対	（破綻処理損失から除くべき損失等） 第１９条　業務方法書第１０３条第１項に規定する当社が規則で定める当社の損失は、業務方法書第９７条第１項の規定によりすべての清算約定が終了した場合における第６条第１項第２号ａに相当する額に対応する当社の損失とする。 ２　業務方法書第１０３条第１項に規定する当社が規則で定める当社に生じたその他の損失は、業務方法書第９７条第１項の規定によりすべての清算約定が終了した場合において、破綻処理入札実施日の翌日から当初損失確定日までの間に、破綻処理清算約定の反対清算約定及び損失回避取引について当社及び清算参加者の間で授受されるべき変動証拠金、固定金額、変動金額その他の金銭に係る差引累計額（当社の総支払額から総受取額を控除した額をいう。）が正数となるときにおける当該差引累計額の絶対値に相当する額に対応する当社の損失とする。

応する当社の損失とする。	
３　業務方法書第１０３条第１項第１号に規定する第一階層金利スワップ決済保証準備金を通貨の種類ごとに按分した額は、第一階層金利スワップ決済保証準備金の全額（第一階層金利スワップ決済保証準備金が第３条第３項の規定により減じられている場合には、当該減じられた後の残額）を、破綻処理入札実施日（同一の破綻処理清算約定に関して複数の破綻処理入札が行われる場合は、当該破綻処理入札のうち最初に到来する破綻処理入札実施日）の前当社営業日における通貨の種類ごとの破綻処理清算約定について算出した当初証拠金所要額相当額に応じて按分した額とする。	（新設）
４　業務方法書第１０３条第１項第２号に規定する当社が按分する額は、次の各号に掲げる損失補填財源の種類に応じて、当該各号に定めるところにより按分した額とする。 （１）　第二階層金利スワップ決済保証準備金　第二階層金利スワップ決済保証準備金を、破綻認定日から起算して過去３０当社営業日において各清算参加者（破綻清算参加者を除く。次号において同じ。）の通貨の種類ごとの清算約定について算出した当初証拠金所要額相当額を当該通貨の種類ごとに合計した額に応じて按分した額 （２）　各清算参加者が預託している金利スワップ清算基金　各清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額を、破綻認定日から起算して過去３０当社営業日において当該各清算参加者の通貨の種類ごとの清算約定について算出した当初証拠金所要額相当額を平均した額に応じて按分した額	（新設）
５　業務方法書第１０３条第２項第２号ｂ（同条第３項において準用する場合を含む。）に規定する相場から著しく乖離した価格として当社が	３　業務方法書第１０３条第２項第２号ｂに規定する相場から著しく乖離した価格として当社が規則で定める価格は、その価格を落札価格とし

規則で定める価格は、その価格を落札価格として入札対象取引が成立した場合において、当社に生じ得る破綻処理損失の額が固定的損失補填財源（業務方法書第１０２条の２及び第１０３条の２に規定する再配分第一階層金利スワップ決済保証準備金、再配分第二階層金利スワップ決済保証準備金及び再配分金利スワップ清算基金を含む。）を超えることとなるすべての価格とする。	て入札対象取引が成立した場合において、当社に生じ得る破綻処理損失の額が固定的損失補填財源を超えることとなるすべての価格とする。
（金利スワップ決済保証準備金等の異なる通貨への配分） 第１９条の２　第１８条の２の規定は、業務方法書第１０３条の２第１項に規定する第一階層金利スワップ決済保証準備金の取崩し後の残額の按分をする場合並びに同条第２項に規定する金利スワップ清算基金及び第二階層金利スワップ決済保証準備金の取崩し後の残額を按分する場合に準用する。この場合において、「業務方法書１０２条の２に規定する算出結果を按分した額」とあるのは「業務方法書第１０３条の２第１項に規定する第一階層金利スワップ決済保証準備金の取崩し後の残額を按分した額」又は「業務方法書第１０３条の２第２項に規定する金利スワップ清算基金及び第二階層金利スワップ決済保証準備金の取崩し後の残額を按分した額」と、「当該算出結果の額」とあるのは「当該残額」とそれぞれ読み替えるものとする。	（新設）
（第三階層特別清算料の額等） 第２１条　業務方法書第１０５条第２項に規定する当社が規則で定める第三階層特別清算料の額は、次の各号に掲げる場合に応じて、当該各号に定める額とする。 （１）　破綻清算参加者に係る業務方法書第１０３条の規定による補填後の破綻処理損失の	（第三階層特別清算料の額等） 第２１条　業務方法書第１０５条第２項に規定する当社が規則で定める第三階層特別清算料の額は、次の各号に掲げる場合に応じて、当該各号に定める額とする。 （１）　破綻清算参加者に係る業務方法書第１０３条の規定による補填後の破綻処理損失の

残額を補填するために、当該破綻処理損失に係る破綻処理入札に参加する義務を負う各清算参加者（以下本号において同じ。）の当該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金利スワップ清算基金所要額を破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに次項の規定により按分した額（当該破綻清算参加者に係る破綻処理入札までに、当該各清算参加者が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第三階層特別清算料を負担した場合には、その負担額を控除した残額とする。以下本項において「第三階層特別清算料限度額」という。）の合計額の全部又は一部を費消する場合　次のａからｄまでに掲げる順序に従い、当該ａからｄまでに定める額	額が各清算参加者（破綻清算参加者を除く。）の当該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金利スワップ清算基金所要額（当該破綻清算参加者に係る破綻処理入札までに、当該各清算参加者が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第三階層特別清算料を負担した場合には、その負担額を控除した残額とする。以下本項において「第三階層特別清算料限度額」という。）の合計額を下回る場合　次のａからｄまでに掲げる順序に従い、当該ａからｄまでに定める額
ａ　当該破綻処理入札に参加しなかった清算参加者又は当該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中に実施された他の破綻処理入札であって、参加する義務のあるもの（当該破綻処理入札までに実施されたものに限る。）のうちのいずれかに参加しなかった第三階層特別清算料負担参加者（これらの他の破綻処理入札のいずれかにおいて入札対象取引を落札し、かつその後に実施されたすべての破綻処理入札に参加している第三階層特別清算料負担参加者を除く。以下このａにおいて「対象清算参加者」という。）の負担する第三階層特別清算料の額　当該破綻処理損失の額を各対象清算参加者の第三階層特別清算料限度額に応じて按分した額（当該破綻処理損失の額が対象清算参加者の第三階層特別清算料限度額の総額以上である場合には、各対象清算参加者の第三階層特別清算	ａ　当該破綻清算参加者に係る破綻処理入札又は当該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中に実施された他の破綻処理入札（当該破綻清算参加者に係る破綻処理入札までに実施されたものに限る。）のいずれかに参加しなかった第三階層特別清算料負担参加者（これらの破綻処理入札のいずれかにおいて入札対象取引を落札し、かつその後に実施されたすべての破綻処理入札に参加している第三階層特別清算料負担参加者を除く。以下このａにおいて「対象清算参加者」という。）の負担する第三階層特別清算料の額　当該破綻処理損失の額を各対象清算参加者の第三階層特別清算料限度額に応じて按分した額（当該破綻処理損失の額が対象清算参加者の第三階層特別清算料限度額の総額以上である場合には、各対象清算参加者の第三階層特別清算料限度額）

料限度額） b　当該破綻処理入札に相場から著しく乖離した価格による入札を行った清算参加者又は当該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中に実施された他の破綻処理入札であって、参加する義務のあるもの（当該破綻清算参加者に係る破綻処理入札までに実施されたものに限る。）のうちのいずれかにおいて相場から著しく乖離した価格による入札を行った第三階層特別清算料負担参加者（これらの他の破綻処理入札のいずれかにおいて入札対象取引を落札し、かつその後に実施されたすべての破綻処理入札において相場から著しく乖離した価格による入札を行っていない第三階層特別清算料負担参加者及び上記ａに掲げる第三階層特別清算料負担参加者を除く。以下このｂにおいて「対象清算参加者」という。）の負担する第三階層特別清算料の額　当該破綻処理損失の額から上記ａに定める額の総額を控除した残額を各対象清算参加者の第三階層特別清算料限度額に応じて按分した額（当該残額が対象清算参加者の第三階層特別清算料限度額の総額以上である場合には、各対象清算参加者の第三階層特別清算料限度額）	b　当該破綻清算参加者に係る破綻処理入札又は当該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中に実施された他の破綻処理入札（当該破綻清算参加者に係る破綻処理入札までに実施されたものに限る。）のいずれかにおいて相場から著しく乖離した価格による入札を行った第三階層特別清算料負担参加者（これらの破綻処理入札のいずれかにおいて入札対象取引を落札し、かつその後に実施されたすべての破綻処理入札において相場から著しく乖離した価格による入札を行っていない第三階層特別清算料負担参加者及び上記ａに掲げる第三階層特別清算料負担参加者を除く。以下このｂにおいて「対象清算参加者」という。）の負担する第三階層特別清算料の額　当該破綻処理損失の額から上記ａに定める額の総額を控除した残額を各対象清算参加者の第三階層特別清算料限度額に応じて按分した額（当該残額が対象清算参加者の第三階層特別清算料限度額の総額以上である場合には、各対象清算参加者の第三階層特別清算料限度額）
c　（略）	c　（略）
d　当該破綻処理入札において入札対象取引を落札した第三階層特別清算料負担参加者（当該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中に実施された他の破綻処理入札（当該破綻処理入札までに実施されたものに限る。）のうち、直近に実施された破綻処理入札において、上記ａ又はｂの適用を受けていた清算参加者及び第三階層特別清算料を支払う義務を負って	d　当該破綻清算参加者に係る破綻処理入札において入札対象取引を落札した第三階層特別清算料負担参加者（当該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中に認定された破綻等であって、当該破綻清算参加者に係る破綻処理入札までに破綻処理入札が実施されたもののうち、直近に破綻処理入札が実施されたものにおいて、上記ａ又はｂの適用を受けていた清算

いたとすれば上記ａ又はｂの適用を受けていた清算参加者を除く。）の負担する第三階層特別清算料の額　当該破綻処理損失の額から上記ａからｃまでに定める額の総額を控除した残額（当該残額が当該各第三階層特別清算料負担参加者の第三階層特別清算料限度額の総額以上である場合には、当該各第三階層特別清算料負担参加者の第三階層特別清算料限度額）	参加者及び第三階層特別清算料を支払う義務を負っていたとすれば上記ａ又はｂの適用を受けていた清算参加者を除く。）の負担する第三階層特別清算料の額　当該破綻処理損失の額から上記ａからｃまでに定める額の総額を控除した残額
（２）　前号の規定による補填後の破綻処理損失の残額を補填するために、当該破綻処理損失に係る破綻処理入札に参加する義務を負う各清算参加者の業務方法書第１０５条の２の規定により当該破綻処理清算約定に配分された再配分第三階層特別清算料の合計額の全部又は一部を費消する場合　前号ａからｄの規定に準じる。この場合において、前号ａからｄの規定中「第三階層特別清算料負担参加者」とあるのは「再配分第三階層特別清算料負担参加者」と、「第三階層特別清算料」とあるのは「再配分第三階層特別清算料」と、「当該破綻処理損失の額」とあるのは「当該破綻処理損失の残額」と、「第三階層特別清算料負担限度額」とあるのは「再配分第三階層特別清算料の額」と読み替えるものとする。	（２）　前号以外の場合　破綻認定日における各第三階層特別清算料負担参加者に係る第三階層特別清算料限度額
（３）　前２号の規定による補填後の破綻処理損失の残額を補填するために、当該破綻処理損失に係る破綻処理入札に参加する義務を負わない各清算参加者の業務方法書第１０５条の２の規定により当該破綻処理清算約定に配分された再配分第三階層特別清算料の合計額の全部又は一部を費消する場合　次のａからｄまでに掲げる順序に従い、当該ａからｄに定める額 ａ　当該破綻処理入札に参加しなかった清算参加者（当該破綻処理入札に参加する義務	（新設）

を負わない清算参加者に限る。以下本号において「対象清算参加者」という。）の負担する再配分第三階層特別清算料の額　当該破綻処理損失の残額を各対象清算参加者の再配分第三階層特別清算料の額に応じて按分した額（当該破綻処理損失の残額が対象清算参加者の再配分第三階層特別清算料の総額以上である場合には、各対象清算参加者の再配分第三階層特別清算料の額）

ｂ　当該破綻処理入札に相場から著しく乖離した価格による入札を行った清算参加者（当該破綻処理入札に参加する義務を負わない清算参加者に限る。以下本号において「対象清算参加者」という。）の負担する再配分第三階層特別清算料の額　当該破綻処理損失の残額から上記ａに定める額の総額を控除した残額を各対象清算参加者の再配分第三階層特別清算料の額に応じて按分した額（当該残額が対象清算参加者の再配分第三階層特別清算料の額の総額以上である場合には、各対象清算参加者の再配分第三階層特別清算料の額）

ｃ　当該各清算参加者（当該破綻処理入札に参加する義務を負わない清算参加者であって、本号ａ、ｂ及びｄに掲げる清算参加者を除く。）の負担する再配分第三階層特別清算料の額　当該破綻処理損失の残額から上記ａ及びｂに定める額の総額を控除した残額を当該各清算参加者の再配分第三階層特別清算料に応じて按分した額（当該残額が当該各清算参加者の再配分第三階層特別清算料の額の総額以上である場合には、当該各清算参加者の再配分第三階層特別清算料の額）

ｄ　当該破綻処理入札において入札対象取引を落札した清算参加者（当該破綻処理入札

に参加する義務を負わない清算参加者に限る。）の負担する再配分第三階層特別清算料の額　当該破綻処理損失の残額から上記ａからｃまでに定める額の総額を控除した残額	
２　業務方法書第１０５条第２項に規定する金利スワップ清算基金所要額を破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとの按分した額は、各清算参加者の第三階層清算参加者負担限度額を、破綻認定日から起算して過去３０当社営業日において各清算参加者の通貨の種類ごとの清算約定について算出した当初証拠金所要額相当額を平均した額に応じて按分した額とする。	（新設）
３　（略）	２　（略）
４　（略）	３　（略）
５　（略）	４　（略）
（異なる通貨に係る破綻処理清算約定の第三階層特別清算料の配分等）	
第２１条の２　業務方法書第１０５条の２に規定する第三階層特別清算料の残額を按分した額は、当該残額を、通貨の種類ごとの破綻処理清算約定について当該破綻処理清算約定に関して行われる破綻処理入札実施日（当該破綻処理清算約定に関して複数の破綻処理入札が行われる場合は、当該破綻処理入札のうち最初に到来する破綻処理入札実施日）の前当社営業日における当初証拠金所要額相当額に応じて按分した額とする。	（新設）
（損失補填財源等の按分方法の変更）	
第２１条の３　当社は、金利スワップ破綻管理委員会の助言を踏まえ、破綻処理入札を成立させることを目的として、当社が適当と認める場合に限り、第１７条の３、第１８条の２、第１９条第３項及び第４項、第１９条の２、第２１条	（新設）

第２項並びに第２１条の２の規定にかかわらず、破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに按分される破綻清算参加者の当初証拠金、金利スワップ清算基金、破綻時証拠金及び他の清算業務に係る余剰担保並びに損失補填財源（以下これらを併せて「損失補填財源等」という。）の按分方法を変更することができる。この場合において、当該変更後の損失補填財源等の取扱いその他の損失補填財源等の取扱いについて必要な事項は、当社がその都度定める。	
（第四階層特別清算料により補填すべき破綻処理損失から除くべき損失） 第２１条の４　業務方法書第１０６条第１項に規定する同第１０５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から除かれるものは、破綻清算参加者の清算参加者口座にクロスマージン対象国債先物清算約定の建玉が記録されている場合において、業務方法書第１０５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日本円建ての破綻処理清算約定に係る破綻処理損失のうち、同１０１条第１項第１号に規定する破綻清算参加者の日本円建ての破綻処理清算約定に係る未決済債務から、当該破綻処理清算約定に係る当社の期限前終了手数料の支払債務、第８４条の５の規定により成立した債権債務に関する当社の支払債務、当該破綻処理清算約定に関し預託済の変動証拠金及び当該破綻清算参加者に対する引渡しを停止した金銭等を控除した残額に対する、第８４条の５の規定により成立した債権債務に係る処理に関して破綻清算参加者が当社に対して負担する未決済債務の割合に応じた額に対応する当社の損失とする。	（新設）
（第四階層特別清算料の額等）	（第四階層特別清算料の額等）

第２２条　業務方法書第１０６条第２項に規定する当社が規則で定める第四階層特別清算料の額は、破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに算出するものとし、次の各号に掲げる第四階層特別清算料負担参加者（同条第１項に規定する第四階層特別清算料負担参加者をいう。以下同じ。）の区分に応じて、当該各号に定める額とする。	第２２条　業務方法書第１０６条第２項に規定する当社が規則で定める第四階層特別清算料の額は、次の各号に掲げる第四階層特別清算料負担参加者（同条第１項に規定する第四階層特別清算料負担参加者をいう。以下同じ。）の区分に応じて、当該各号に定める額とする。
（１）・（２）　（略）	（１）・（２）　（略）
（第三階層特別清算料担保金の預託義務）	（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。	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（破綻処理清算約定について破綻認定日（破綻清算参加者が当該破綻処理清算約定に関し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。以下本号において同じ。）以降の各当社営業日において当社が当該破綻清算参加者から受け取るべき変動証拠金等の総額から当社が当該破綻清算参加者に支払うべき変動証拠金等の総額を控除した額並びに業務方法書第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及び同第９３条の２第３項の規定により清算約定とみなされたクロスマージン処分取引	（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

について破綻認定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を合計した額が正数である場合の当該額をいう。以下同じ。）が、当該破綻処理清算約定に係る通貨の種類の固定的損失補填財源の合計額（業務方法書第１０３条の２の規定により配分された再配分第一階層金利スワップ決済保証準備金、再配分第二階層金利スワップ決済保証準備金又は金利スワップ清算基金がある場合は、当該合計額に当該配分された額を加算した額）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（同一の破綻処理単位期間中において第三階層特別清算料が必要となる場合は、当該破綻処理清算約定に係る通貨以外の通貨の種類の破綻処理清算約定に係る破綻処理損失を補填するために必要となる第三階層特別清算料の額（第３号の規定により当社に預託された第三階層特別清算料担保金の額を除く。）を控除した後の残額）を超過したとき	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・ｂ　（略）	ａ・ｂ　（略）
（２）　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	（２）　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の合計額（同一の破綻処理単位期間中において第三階層特別清算料が必要となる場合は、当該破綻処理清算約定に係る通貨以外の通貨の種類の破綻処理清算約定に係る破綻処理損失を補填するために必要となる第三階層特別清算料の額（第３号の規定により当社に預託された第三階層特別清算料担保金の額を除く。）を控除した後の残額）を超過したとき	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当社がその都度定める時間	a　日時　当該通知の行われた破綻処理入札実施日の午後０時３０分
b　（略）	b　（略）
（３）　（略）	（３）　（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。	（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（業務方法書第１０３条の２又は第１０５条の２の規定により配分された再配分第一階層金利スワップ決済保証準備金、再配分第二階層金利スワップ決済保証準備金、金利スワップ清算基金又は再配分第三階層特別清算料がある場合は、当該合計額に当該配分された額を加算した額）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	（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

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（同一の破綻処理単位期間中において第三階層特別清算料及び第四階層特別清算料が必要となる場合は、当該破綻処理清算約定に係る通貨以外の通貨の種類の破綻処理清算約定に係る破綻処理損失を補填するために必要となる第三階層特別清算料の額（前条第３号の規定により当社に預託された第三階層特別清算料担保金の額を除く。）及び第四階層特別清算料の額（第３号の規定により当社に預託された第四階層特別清算料担保金の額を除く。）を控除した後の残額）を超過したとき	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・ｂ　（略）	ａ・ｂ　（略）
（２）　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清算約定（自己分）に係る当初証拠金、破綻時証拠金、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（同一の破綻処理単位期間中において第三階層特別清算料及び第四階層特別清算料が必要となる場合は、当	（２）　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清算約定（自己分）に係る当初証拠金、破綻時証拠金、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

該破綻処理清算約定に係る通貨以外の通貨の種類の破綻処理清算約定に係る破綻処理損失を補填するために必要となる第三階層特別清算料の額（前条第３号の規定により当社に預託された第三階層特別清算料担保金の額を除く。）及び第四階層特別清算料の額（第３号の規定により当社に預託された第四階層特別清算料担保金の額を除く。）を控除した後の残額）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当社がその都度定める時間 b　（略） （３）　（略）	a　日時　当該通知の行われた破綻処理入札実施日の午後０時３０分 b　（略） （３）　（略）
第５章の２　最終損失確定後における通貨間の損失補填財源の調整	（新設）
（最終損失確定後における通貨間の損失補填財源の調整等） 第２７条の２　業務方法書第１１０条の２に規定する損失補填財源の調整は、次の各号の順序に従い、当該各号に定める方法により現に損失補填財源が取崩し又は費消された額を限度として行うものとする。 （１）　第四階層特別清算料を負担した清算参加者への分配 （２）　再配分第三階層特別清算料を負担した清算参加者への分配 （３）　第三階層特別清算料を負担した清算参加者への分配 （４）　第二階層金利スワップ決済保証準備金又は当該金利スワップ清算基金への積立て（再配分第二階層金利スワップ決済保証準備金又は再配分金利スワップ清算基金として費消された額に限る。） （５）　第二階層金利スワップ決済保証準備金	（新設）

又は当該金利スワップ清算基金への積立て（前号に定めるものを除く。）

（６）　第一階層金利スワップ決済保証準備金への積立て（再配分第一階層金利スワップ決済保証準備金として費消された額に限る。）

（７）　第一階層金利スワップ決済保証準備金への積立て（前号に定めるものを除く。）

２　前項各号に定める分配又は積立てには、次の各号の順序に従い、当該各号に定める損失補填財源等を用いて行うものとする。

（１）　最終損失確定後に残存する破綻清算参加者の当初証拠金等（最終損失確定日において行う業務方法書第１０１条第１項第２号に規定する差引計算及び担保の充当の結果負の数となった額をいう。）

（２）　再配分第一階層金利スワップ決済保証準備金（業務方法書第１０３条第１項第１号の２及び同第１１０条第１項第１号の規定により取り崩された額を除く。）

（３）　再配分第二階層金利スワップ決済保証準備金及び破綻清算参加者以外が預託した金利スワップ清算基金（業務方法書第１０３条第１項第３号及び第４号並びに同第１１０条第１項第２号の規定により取り崩された額を除く。）

（４）　再配分第三階層特別清算料（第２１条第１項第２号及び第３号並びに業務方法書第１１０条第１項第３号の規定により費消された額を除く。）

３　前２項の規定による損失補償財源の調整は、次の各号に定める場合に応じて、当該各号に定めるところにより行う。

（１）　次のａからｄまでのいずれかに掲げる損失補填財源等を用いて、当該ａからｄまでに定める全額について分配又は積立てを行うことができる場合　当該ａからｄまでに掲げ

る損失補填財源等を用いた当該ａからｄまでに定める額の分配又は積立て

ａ　前項第１号に掲げる損失補填財源等　第１項各号に定める額の合計額

ｂ　前項第１号及び第２号に掲げる損失補填財源等　第１項第１号から第５号に定める額の合計額

ｃ　前項第１号から第３号までに掲げる損失補填財源等　第１項第１号から第３号に定める額の合計額

ｄ　前項各号に掲げる損失補填財源等　第１項第１号に定める額

（２）　前号以外の場合　次のａからｄに掲げる損失補填財源等の順序に従い、当該ａからｄまでに定める額の分配又は積立て

ａ　前項第１号に掲げる損失補填財源等　当該損失補填財源等の全額

ｂ　前項第２号に掲げる損失補填財源等　第１項第１号から第５号に定める額の合計額から前ａの規定により分配又は積立てが行われた額を控除した額（当該損失補填財源等の額が当該合計額から当該控除した後の額に満たない場合には、当該損失補填財源等の全額）

ｃ　前項第３号に掲げる損失補填財源等　第１項第１号から第３号に定める額の合計額から前ａ及びｂの規定により分配又は積立てが行われた額を控除した額（当該損失補填財源等の額が当該合計額から当該控除した後の額に満たない場合には、当該損失補填財源等の全額）

ｄ　前項第４号に掲げる損失補填財源等　第１項第１号に定める額から前ａからｃの規定により分配又は積立てが行われた額を控除した額（当該損失補填財源等の額が当該合計額から当該控除した後の額に満たない

場合には、当該損失補填財源等の全額） ４　前各項の規定のほか、損失補填財源の調整に関して必要な事項は、当社が通知により定める。	
（回収金の分配を受ける清算参加者） 第２８条　業務方法書第１１１条第１項に規定する当社が規則で定める者は、次に掲げる者とする。 （１）　（略） （２）　証券取引等業務方法書第７９条の２に規定するクロスマージン特別清算料を当社に支払った国債先物等清算参加者 （３）　（略） （４）　（略） （５）　（略）	（回収金の分配を受ける清算参加者） 第２８条　業務方法書第１１１条第１項に規定する当社が規則で定める者は、次に掲げる清算参加者とする。 （１）　（略） （新設） （２）　（略） （３）　（略） （４）　（略）
（分配手続） 第２９条　当社は、業務方法書第１１１条第１項各号に掲げる場合には、当該各号に掲げる額からその回収等に要した諸費用を控除した残額を、清算参加者又は国債先物等清算参加者に対し次の各号に掲げる順序に従い、当該各号に定める額に満つるまで各清算参加者又は各国債先物等清算参加者に係る当該額に応じて按分して分配する。 （１）　次のａ及びｂに掲げる者　ａ及びｂに定める額 ａ　前条第１号の清算参加者 当社に支払った第四階層特別清算料に相当する額 ｂ　前条第２号の国債先物等清算参加者 当社に支払ったクロスマージン特別清算料に相当する額 （２）　前条第３号の清算参加者　当社に支払った第三階層特別清算料に相当する額 （３）　前条第４号の清算参加者　破綻処理損	（分配手続） 第２９条　当社は、業務方法書第１１１条第１項各号に掲げる場合には、当該各号に掲げる額からその回収等に要した諸費用を控除した残額を、清算参加者に対し、次の各号に掲げる順序に従い、当該各号に定める額に満つるまで各清算参加者に係る当該額に応じて按分して分配する。 （１）　前条第１号の清算参加者　当社に支払った第四階層特別清算料に相当する額 （２）　前条第２号の清算参加者　当社に支払った第三階層特別清算料に相当する額 （３）　前条第３号の清算参加者　破綻処理損

失又は清算参加者の破綻等により当社に生じた損失の補填に充てられた金利スワップ清算基金の額 （４）　前条第５号の清算参加者　同号に規定する損失の額 ２～４　（略） 付　則 この改正規定は、平成２７年９月２４日から施行する。	失又は清算参加者の破綻等により当社に生じた損失の補填に充てられた金利スワップ清算基金の額 （４）　前条第４号の清算参加者　同号に規定する損失の額 ２～４　（略）

別紙１

金利スワップ破綻管理委員会規則の一部改正新旧対照表

新	旧
（金利スワップ破綻管理委員会の設置） 第３条　（略） ２　委員会は、第６条から第６条の４までの規定により選任される５社以下の委員により構成される。	（金利スワップ破綻管理委員会の設置） 第３条　（略） ２　委員会は、第６条の規定により選任される５社以下の委員により構成される。
（諮問事項） 第４条　（略） （１）・（２）　（略） （３）　クロスマージン対象国債先物清算約定の転売（証券取引等業務方法書第４５条の２第２項に規定する転売をいう。）又は買戻し（証券取引等業務方法書第４５条の２第２項に規定する買戻しをいう。）の実施、取引条件及び取引の相手方に関する事項 （４）　クロスマージン処分取引の実施、取引条件及び取引の相手方に関する事項 （５）　上記のほか、破綻処理清算約定及びクロスマージン対象国債先物清算約定の決済等に関し、当社が個別に諮問する事項 ２　（略）	（諮問事項） 第４条　（略） （１）・（２）　（略） （新設） （新設） （３）　上記のほか、破綻処理清算約定の決済等に関し、当社が個別に諮問する事項 ２　（略）
（清算参加者リスト） 第５条　（略） ２　（略） ３　当社は、次条から第６条の４までの規定により清算参加者を委員に選任した場合には、当該清算参加者を、清算参加者リストから抹消する。 ４　（略）	（清算参加者リスト） 第５条　（略） ２　（略） ３　当社は、次条の規定により清算参加者を委員に選任した場合には、当該清算参加者を、清算参加者リストから抹消する。 ４　（略）
（委員の選任等） 第６条　（略）	（委員の選任等） 第６条　（略）

２　前項の規定による委員の選任後に、委員が金利スワップ清算資格を喪失した場合又は当社が委員の破綻等を認定した場合には、当社は、当該喪失又は認定と同時に当該委員の選任を取り消すものとする。この場合、当社は、清算参加者リストの順序に従い、補充の委員を選任する。	２　前項の規定による委員の選任後に、清算参加者が金利スワップ清算資格を喪失した場合又は当社が委員の破綻等を認定した場合には、当社は、当該喪失又は認定と同時に当該委員の選任を取り消すものとする。この場合、当社は、清算参加者リストの順序に従い、補充の委員を選任する。
３～５　（略）	３～５　（略）
（クロスマージン利用者の破綻処理に係る助言を行う委員に関する特則） 第６条の２　前条の規定にかかわらず、クロスマージン利用者である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が委員である場合において、委員会が当該清算委託者の計算により成立しているクロスマージン対象国債先物清算約定に関して助言を行うときは、当該委員の選任を取り消すものとする。この場合、当社は、清算参加者リストの順序に従い、補充の委員を選任する。 ２　当社は、前項の規定に従い補充の委員を選任した場合には、前項の規定により委員の選任を取り消した清算参加者を、現に存する清算参加者リストの最上位に記載する。	（新設）
（外貨建清算約定の破綻処理に係る助言を行う委に関する特則） 第６条の３　当社は、外貨建清算約定の当事者である清算参加者の破綻等を認定した場合に第４条第１項各号に掲げる事項のうち、特に当該外貨建清算約定である破綻処理清算約定（以下本条及び次条において「外貨建破綻処理清算約定」という。）に関する第４条第１項第１号、第２号及び第５号に掲げる事項を諮問する委員（以下本条及び次条において「外貨建破綻処理清算約定に係る委員」という。）として、あらかじ	（新設）

め、委員に選任された日から起算して過去３０日の間において外貨建清算約定の当事者であった委員のうち２社を指定する。 ２　前項に規定する外貨建破綻処理清算約定に係る委員は、現に委員に選任されている５社の清算参加者が第６条第１項の規定により委員に選任される際の清算参加者リストの順序に従い、指定するものとする。 ３　当社は、第１項の規定に従い指定した外貨建破綻処理清算約定に係る委員に関して、当該委員の日本円建て以外の金利スワップ取引に関する業務執行体制等を踏まえ、当該委員又はその委員代表者が外貨建破綻処理清算約定に係る委員としての職務の遂行に堪えないと認めるときその他やむを得ない事情があると当社が認める場合に限り、当該委員について、外貨建破綻処理清算約定に係る委員の指定を取り消すことができる。この場合、当社は、前２項の規定に従い、補充の外貨建破綻処理清算約定に係る委員を指定する。 ４　前項後段の規定は、第１項の規定による外貨建破綻処理清算約定に係る委員の指定後に、外貨建破綻処理清算約定に係る委員が第６条第２項の規定により委員の選任を取り消された場合に準用する。	
（外貨建破綻処理清算約定に係る委員の候補の指名等） 第６条の４　当社は、委員を選任する時点又は前条第３項（前条第４項において準用する場合を含む。）の規定により補充の外貨建破綻処理清算約定に係る委員を指定する時点において、外貨建破綻処理清算約定に係る委員を２社指定することができない場合には、当該時点で、清算参加者リスト（第５条第４項の規定により新たな清算参加者リストが作成されている場合に	（新設）

は、当該新たな清算参加者リストを含む。）の順序に従い、外貨建破綻処理清算約定に係る委員の候補を、外貨建破綻処理清算約定に係る委員と合わせて２社に満つるまで指名するものとする。この場合において、現に存する清算参加者リストの末尾に記載された清算参加者までで、外貨建破綻処理清算約定に係る委員の候補を、外貨建破綻処理清算約定に係る委員と合わせて２社に満つるまで指名できないときは、第５条第１項に定めるところにより、清算参加者リストを新規に作成し、当該清算参加者リストの順序に従い外貨建破綻処理清算約定に係る委員と合わせて２社に満つるまで指名するものとする。

２　前項に規定する外貨建破綻処理清算約定に係る委員の候補の指名は、清算参加者リスト（前項後段又は第５条第４項の規定により新たな清算参加者リストが作成されている場合は、当該新たな清算参加者リストを含む。）に記載されている清算参加者のうち、指名をする日から起算して過去３０日の間において外貨建清算約定の当事者となっている清算参加者のうちから行うものとする。

３　清算参加者が外貨建破綻処理清算約定に係る委員の候補に指名されている場合において、当社が外貨建清算約定の当事者である清算参加者について破綻等を認定したときは、当社は、当該外貨建破綻処理清算約定に係る委員の候補を委員に選任するとともに、外貨建破綻処理清算約定に係る委員に指定する。この場合において、当該新たに委員に選任した清算参加者は、清算参加者リストから抹消する。

４　前項の規定に従い外貨建破綻処理清算約定に係る委員の候補を委員に選任した場合には、現に委員に選任されている委員５社が清算参加者リストに記載されていた時点における当該清算

参加者リスト（第５条第４項の規定により新たな清算参加者リストが作成されている場合には、当該新たな清算参加者リストを含む。）の末尾側に記載されていた清算参加者から順に、当該新たに委員に選任した数に応じて、委員の選任を取り消すとともに、当該委員の選任を取り消した清算参加者を現に存する清算参加者リストの最上位に記載する。 ５　前各項の規定により委員に選任された清算参加者の任期その他必要な事項は、当社がその都度定める。	
（委員代表者の届出等） 第７条　委員は、その選任後直ちに、当該委員又は当該委員を含む企業集団に含まれる他の法人等の役職員のうち金利スワップ取引の実務に精通し、委員としての職務（外貨建破綻処理清算約定に係る委員に指定された委員にあっては、外貨建破綻処理清算約定に係る委員としての職務を含む。）に関し当該委員を代表又は代理する者として少なくとも１名を、委員の代表者又は代理人（以下「委員代表者」という。）として当社所定の書面により当社に届け出るものとする。	（委員代表者の届出等） 第７条　委員は、その選任後直ちに、当該委員又は当該委員を含む企業集団に含まれる他の法人等の役職員のうち金利スワップ取引の実務に精通し、委員としての職務に関し当該委員を代表又は代理する者として少なくとも１名を、委員の代表者又は代理人（以下「委員代表者」という。）として当社所定の書面により当社に届け出るものとする。
２　（略）	２　（略）
付　　則 １　この改正規定は、平成２７年９月２４日（以下「施行日」という。）から施行する。 ２　改正後の第６条の３及び第６条の４の規定にかかわらず、当社は、施行日以降最初に行う外貨建破綻処理清算約定に係る委員の指定又は外貨建破綻処理清算約定に係る委員の候補の指名	

を、日本円以外の通貨の金利スワップ取引の債務負担の状況を踏まえ、当社が定めるところにより行うものとする。	

金利スワップ運営委員会に関する規則の一部改正新旧対照表

新	旧
（諮問事項） 第４条　当社は、業務方法書第１２２条第１項の規定によるもののほか、次に掲げる事項について決定を行おうとする場合には、委員会に諮問を行い、その意見を尊重するものとする。ただし、当該決定の内容が軽微なものである場合には、この限りでない。 （１）　（略） （１）の２　クロスマージン制度の対象とする取引の追加及び変更に関する事項 （２）～（１９）　（略） ２～５　（略） 付　則 この改正規定は、平成２７年９月２４日から施行する。	（諮問事項） 第４条　当社は、業務方法書第１２２条第１項の規定によるもののほか、次に掲げる事項について決定を行おうとする場合には、委員会に諮問を行い、その意見を尊重するものとする。ただし、当該決定の内容が軽微なものである場合には、この限りでない。 （１）　（略） （新設） （２）～（１９）　（略） ２～５　（略）

業務方法書の一部改正新旧対照表

新	旧
（清算参加者に対する措置） 第２９条　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認める場合には、当該清算参加者を審問のうえ、理由を示して、クロスマージンの申請（第７３条の１５の２第１項に規定するクロスマージンの申請をいう。第３４条において同じ。）の禁止、改善指示（当社の証券取引等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基づく債務の引受けの全部若しくは一部の停止又は当該清算参加者の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、清算資格の取消しについては、取締役会の決議を要するものとする。 （１）～（４）　（略） ２～６　（略）	（清算参加者に対する措置） 第２９条　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認める場合には、当該清算参加者を審問のうえ、理由を示して、改善指示（当社の証券取引等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基づく債務の引受けの全部若しくは一部の停止又は当該清算参加者の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、清算資格の取消しについては、取締役会の決議を要するものとする。 （１）～（４）　（略） ２～６　（略）
（措置の通知等） 第３４条　（略） ２・３　（略） ４　当社が、第２９条第１項の規定に基づきクロスマージンの申請を禁止したときは、その対象清算参加者は、自らが行うクロスマージンの申請に係るクロスマージン利用者（金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書（以下「金利スワップ取引業務方法書」という。）第２条第１項第１３号の８に規定するクロスマージン利用者をいう。以下同じ。）及びクロスマージン承諾者（クロスマージンの申請に対して、金利スワップ取引業務方法書の規定に基づき承諾の	（措置の通知等） 第３４条　（略） ２・３　（略） （新設）

通知を行う者をいう。以下同じ。）に対し、直ちにその旨を通知しなければならない。	
５　（略）	４　（略）
６　当社は、この業務方法書に基づきクロスマージンの申請の禁止、改善指示、債務の引受けの全部若しくは一部の停止、清算資格の取消し又はポジション保有状況の改善指示の措置を清算参加者に対して行ったときは、当該措置を行った日から６か月以内に、各清算参加者に対してその旨を通知し、又は公表するものとする。ただし、当社は、当該通知又は公表を行った場合における市場への影響度を勘案して必要かつ適当と認めるときは、当該措置を行った日から６か月を超える日に通知又は公表を行うことができる。	５　当社は、この業務方法書に基づき改善指示、債務の引受けの全部若しくは一部の停止、清算資格の取消し又はポジション保有状況の改善指示の措置を清算参加者に対して行ったときは、当該措置を行った日から６か月以内に、各清算参加者に対してその旨を通知し、又は公表するものとする。ただし、当社は、当該通知又は公表を行った場合における市場への影響度を勘案して必要かつ適当と認めるときは、当該措置を行った日から６か月を超える日に通知又は公表を行うことができる。
７　（略）	６　（略）
８　（略）	７　（略）
第５章　清算約定の決済	第５章　清算約定の決済
第１節～第４節　（略）	第１節～第４節　（略）
第４節の２　クロスマージン制度	（新設）
（国債先物等清算参加者によるクロスマージンの申請）	
第７３条の１５の２　国債先物等清算参加者は、次の各号のいずれかに該当する場合には、クロスマージン利用者の計算による国債証券先物取引に係る建玉について、当社が定めるところにより、当社に対してクロスマージン制度（金利スワップ取引業務方法書第２条第１項第１３号の５に規定するクロスマージン制度をいう。以下同じ。）の対象とするための申請（以下「クロスマージンの申請」という。）を行うことができる。	（新設）

（１）　当該国債先物等清算参加者がクロスマージン利用者である場合で、当該国債先物等清算参加者が、自己の計算による国債証券先物取引に係る建玉の全部又は一部についてクロスマージン制度の対象としようとするとき。 （２）　当該国債先物等清算参加者の顧客又は当該国債先物等清算参加者に有価証券等清算取次ぎの委託を行う国債先物等非清算参加者がクロスマージン利用者である場合で、当該国債先物等清算参加者が、当該クロスマージン利用者からクロスマージンの申請に係る申込みを受領したとき。 （３）　当該国債先物等清算参加者に有価証券等清算取次ぎの委託を行う国債先物等非清算参加者の顧客がクロスマージン利用者である場合で、当該国債先物等清算参加者が、当該国債先物等非清算参加者から、当該国債先物等非清算参加者が取り次いだクロスマージンの申請に係る申込みを受領したとき。 ２　前項の申請は、当社が定める要件を満たした場合に限り行うことができる。 （クロスマージンの申請に係る制限） 第７３条の１５の３　前条の規定に基づきクロスマージンの申請を行う国債先物等清算参加者（以下「クロスマージン申請者」という。）は、次の各号に掲げる場合には、当該各号に定める日の２日前の日及び前日において、当該各号のクロスマージン利用者のためにクロスマージンの申請を行うことができないものとする。 （１）　クロスマージン利用者について、そのクロスマージン承諾者が、金利スワップ取引業務方法書第８４条の２第２項の規定によりクロスマージン申請者又は当該クロスマージン利用者が国債証券先物取引を委託する国債	（新設）

先物等非清算参加者（当該クロスマージン利用者が国債先物等非清算参加者の顧客である場合に限る。）を変更するための届出を行った場合 当該届出に基づく内容の変更の効力が生じる日 （２）　クロスマージン利用者について、そのクロスマージン承諾者が、金利スワップ取引業務方法書第８４条の３の規定により当該クロスマージン利用者によるクロスマージン制度の利用を取りやめるための届出を行った場合 当該クロスマージン制度の利用を取りやめる日 （クロスマージン対象国債先物清算約定に係る債権債務の消滅） 第７３条の１５の４　クロスマージン申請者と当社との間のクロスマージン対象国債先物清算約定（金利スワップ取引業務方法書第２条第１項第１３号の６に規定するクロスマージン対象国債先物清算約定をいう。以下同じ。）に係る債権債務（第４項に規定する債権債務を除く。）は、次の各号に掲げる者が、クロスマージン対象国債先物清算約定に係るクロスマージン利用者である場合で、当該各号に定める事由のいずれかに該当することとなったときに、将来に向かって消滅する。 （１）　クロスマージン申請者 ａ　当該クロスマージン利用者が、当社から第７６条第５項の規定によりすべての債務の引受けの停止の措置を受けたとき又は当該クロスマージン利用者に対して、破産手続開始、再生手続開始、更生手続開始、特別清算開始若しくは外国倒産処理手続の承認の申立て（外国の法令上これらに相当す	（新設）

る申立てを含む。）がなされたとき。

ｂ　当該クロスマージン利用者が、当社から債務の引受けの全部又は一部の停止の措置を受けた場合、当社から国債先物等清算資格の取消しを受けた場合又は第３３条の規定により清算資格を喪失した場合で、第３０条第３項、第３５条第３項又は第３６条第２項の規定より、その者の清算約定で未決済のものの整理を当社が他の清算参加者をして行わせることとしたとき。

ｃ　当該クロスマージン利用者が、指定市場開設者から支払不能又は支払不能となるおそれがあると認められたことにより市場デリバティブ取引の停止の処置を受けたとき。

ｄ　当該クロスマージン利用者が、金利スワップ取引業務方法書の定めるところにより、当社により破綻等を認定されたとき。

ｅ　当該クロスマージン利用者が、金利スワップ取引業務方法書第４３条の規定に従い締結した金利スワップ清算受託契約書の定めるところにより、期限前終了日において当該金利スワップ清算受託契約書に基づく清算委託取引が終了したとき。

ｆ　当該クロスマージン利用者に係るクロスマージン承諾者が、金利スワップ取引業務方法書の定めるところにより、当社により破綻等を認定されたとき、金利スワップ取引業務方法書第３８条第２項に規定する事由に該当したとき又は当該クロスマージン承諾者に対して、破産手続開始、再生手続開始、更生手続開始、特別清算開始若しくは外国倒産処理手続の承認の申立て（外国の法令上これらに相当する申立てを含む。）がなされたとき。

（２）　クロスマージン申請者の顧客

ａ　当該クロスマージン利用者が、クロスマージン対象国債先物清算約定に係る国債証券先物取引の委託につき、指定市場開設者が定める先物・オプション取引口座設定約諾書の定めるところにより、当然に期限の利益を喪失したとき。

ｂ　当該クロスマージン利用者に係るクロスマージン申請者が、前号ａからｃまでに定める事由に該当することとなったとき。この場合において、同号ａからｃまで中「当該クロスマージン利用者」とあるのは「クロスマージン申請者」と読み替えるものとする。

ｃ　当該クロスマージン利用者に係るクロスマージン承諾者が、前号ｆに定める事由に該当することとなったとき。

（３）　国債先物等非清算参加者

ａ　当該クロスマージン利用者が、当該クロスマージン対象国債先物清算約定に係る国債証券先物取引の有価証券等清算取次ぎの委託につき、第３９条の規定に従いクロスマージン申請者との間で締結した国債先物等清算受託契約書の定めるところにより、当然に期限の利益を喪失したとき。

ｂ　当該クロスマージン利用者が、指定市場開設者から支払不能又は支払不能となるおそれがあると認められたことにより市場デリバティブ取引の有価証券等清算取次ぎの委託の停止の処置を受けたとき。

ｃ　当該クロスマージン利用者に係るクロスマージン申請者が、第１号ａからｃまでに定める事由に該当することとなったとき。この場合において、同号ａからｃまで中「当該クロスマージン利用者」とあるのは「クロスマージン申請者」と読み替えるものとする。

d　当該クロスマージン利用者に係るクロスマージン承諾者が、第１号ｆに定める事由に該当することとなったとき。

（４）　国債先物等非清算参加者の顧客

a　当該クロスマージン利用者に係るクロスマージン申請者が、第１号ａからｃまでに定める事由に該当することとなったとき。この場合において、同号ａからｃまで中「当該クロスマージン利用者」とあるのは「クロスマージン申請者」と読み替えるものとする。

b　当該クロスマージン利用者に係るクロスマージン承諾者が、第１号ｆに定める事由に該当することとなったとき。

c　当該クロスマージン利用者が、第２号ａに定める事由に該当することとなったとき。

d　当該クロスマージン利用者から国債証券先物取引の委託を受ける国債先物等非清算参加者が、前号ａ又はｂに定める事由に該当することとなったとき。この場合において、同号ａ又はｂ中「当該クロスマージン利用者」とあるのは「当該クロスマージン利用者から国債証券先物取引の委託を受ける国債先物等非清算参加者」と読み替えるものとする。

２　前項の規定に従い債権債務が消滅した場合には、当社は、金利スワップ取引業務方法書の定めるところに従い、同項のクロスマージン申請者のクロスマージン対象国債先物清算約定について転売又は買戻しその他必要と認める整理を行わせることができる。

３　当社は、必要があると認めるときは、前項に定める整理を、他の清算参加者をして行わせることができる。この場合において、当該清算参加者と第１項のクロスマージン申請者との間に

委任契約が成立していたものとする。 ４　第１項に規定する消滅する債権債務から除く債権債務は、クロスマージン対象国債先物清算約定に関して第７３条の８又は第７３条の９の規定に従い当社と第１項のクロスマージン申請者との間で授受すべき金銭に係る債権債務であって、同項のクロスマージン申請者、クロスマージン承諾者、クロスマージン利用者又はクロスマージン利用者が国債証券先物取引の委託を行う国債先物等非清算参加者のいずれかの者が同項各号に定める事由のいずれかに該当することとなった時に既に履行期が到来しているものとする。	
（建玉の移管） 第７３条の４４　この業務方法書に別に定める場合のほか、清算参加者は、当社の承認を受けて、他の清算参加者に先物・オプション取引の未決済約定（取引最終日（指定市場開設者（第３条第２項第２号から第６号までの指定金融商品市場を開設する指定市場開設者をいう。以下この章において同じ。）が先物・オプション取引に関し定める取引最終日をいう。）が到来した限月取引（指定市場開設者が定める限月取引をいう。以下この章において同じ。）の当該取引最終日後における当該限月取引の未決済約定及びクロスマージン対象国債先物清算約定を除く。以下この章において同じ。）を引き継ぐことができる。 ２～５　（略）	（建玉の移管） 第７３条の４４　この業務方法書に別に定める場合のほか、清算参加者は、当社の承認を受けて、他の清算参加者に先物・オプション取引の未決済約定（取引最終日（指定市場開設者（第３条第２項第２号から第６号までの指定金融商品市場を開設する指定市場開設者をいう。以下この章において同じ。）が先物・オプション取引に関し定める取引最終日をいう。）が到来した限月取引（指定市場開設者が定める限月取引をいう。以下この章において同じ。）の当該取引最終日後における当該限月取引の未決済約定を除く。以下この章において同じ。）を引き継ぐことができる。 ２～５　（略）
第７章　清算参加者の決済不履行時の措置等	第７章　清算参加者の決済不履行時の措置
第１節　通則	（新設）

第７６条～第７９条　（略）	第７６条～第７９条　（略）
第２節　クロスマージン特別清算料	（新設）
（クロスマージン特別清算料） 第７９条の２　第７３条の１５の４の規定によりクロスマージン申請者と当社との間のクロスマージン対象国債先物清算約定に係る債権債務が消滅した場合で、金利スワップ取引業務方法書第８４条の５の規定によりクロスマージン承諾者と当社との間に成立した債権債務について当社が受けた損失のうち、第四階層特別清算料（金利スワップ取引業務方法書第１０６条第１項に規定する第四階層特別清算料をいう。次項において同じ。）により補填し得なかった損失がある場合には、当該クロスマージン申請者は、当社が定めるところにより、当該補填し得なかった損失額に相当する金額のクロスマージン特別清算料を納入するものとする。この場合において、当社は、当該クロスマージン特別清算料をもって、当該損失額を補填する。 ２　前項のクロスマージン申請者が同項に定めるクロスマージン特別清算料の納入を行わないときには、当該未納入額について、同項の損失を第四階層特別清算料により補填し得ないこととなった日に当該クロスマージン申請者が清算約定の決済の履行を行わなかったものとみなし、第７６条から前条までの規定を適用する。 ３　当社は、第１項のクロスマージン特別清算料を算出することが相当期間困難であると認める場合には、当該補填し得ない損失額と見込まれる金額として当社が暫定的に算定した額を当該補填し得ない損失額とみなして、当社が定める日にクロスマージン特別清算料の納入を求めることができる。この場合において、当社は、同項の当該補填し得ない損失額が確定した場合に	（新設）

は、当該確定した補填し得ない損失額と当社が暫定的に算定した額との差に相当する額を、同項に規定するクロスマージン申請者との間で授受するものとする。 ４　当社は、第１項に規定するクロスマージン承諾者から、同項の規定により補填した損失に係る債権を回収できたときは、同項に規定するクロスマージン申請者に対して、金利スワップ取引業務方法書の定めるところにより、その回収額を返付するものとする。	
（有価証券オプション取引における建玉の調整） 第７９条の３　（略） ２　（略）	（有価証券オプション取引における建玉の調整） 第７９条の２　（略） ２　（略）
付　則 １　この改正規定は、平成２７年９月２４日から施行する。 ２　前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社が設置するシステムの稼働に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、平成２７年９月２４日以後の当社が定める日から施行する。	

別紙２

先物・オプション取引に係る取引証拠金等に関する規則の一部改正新旧対照表

新	旧
（取引参加者の自己分の取引証拠金所要額） 第４条　自己分の取引証拠金所要額は、自己分のＳＰＡＮ証拠金額から自己分のネット・オプション価値の総額を差し引いて得た額とする。この場合において、これらの用語の意義は、次の各号に定めるところによる。 （１）　自己分のＳＰＡＮ証拠金額 先物・オプション取引に係る取引参加者の自己の計算による建玉（その取引日にクロスマージンの申請の対象となった建玉を除く。）について、ＳＰＡＮにより計算した証拠金額をいう。 （２）　（略）	（取引参加者の自己分の取引証拠金所要額） 第４条　自己分の取引証拠金所要額は、自己分のＳＰＡＮ証拠金額から自己分のネット・オプション価値の総額を差し引いて得た額とする。この場合において、これらの用語の意義は、次の各号に定めるところによる。 （１）　自己分のＳＰＡＮ証拠金額 先物・オプション取引に係る取引参加者の自己の計算による建玉について、ＳＰＡＮにより計算した証拠金額をいう。 （２）　（略）
（緊急取引証拠金所要額） 第２２条　緊急取引証拠金所要額は、リスク再計算額に先物取引差金相当額及びオプション取引代金相当額を、当該額が支払いとなる場合は加え、受領となる場合は減じて得た額とする。この場合において、これらの用語の意義は、次の各号に定めるところによる。 （１）　リスク再計算額 第４条の規定中「取引参加者の自己の計算による」とあるのは「国債証券先物及び国債証券先物オプション取引についてはその取引日の終了する日の午前立会終了時点、有価証券オプション取引、指数先物取引及び指数オプション取引についてはその日（指数先物取引又は指数オプション取引にあっては、その取引日）の午前１１時時点における取引参加者の自己の計算による」と、「その取引日」とあるのは「その前取引日」と、「清算価格」	（緊急取引証拠金所要額） 第２２条　緊急取引証拠金所要額は、リスク再計算額に先物取引差金相当額及びオプション取引代金相当額を、当該額が支払いとなる場合は加え、受領となる場合は減じて得た額とする。この場合において、これらの用語の意義は、次の各号に定めるところによる。 （１）　リスク再計算額 第４条の規定中「取引参加者の自己の計算による」とあるのは「国債証券先物及び国債証券先物オプション取引についてはその取引日の終了する日の午前立会終了時点、有価証券オプション取引、指数先物取引及び指数オプション取引についてはその日（指数先物取引又は指数オプション取引にあっては、その取引日）の午前１１時時点における取引参加者の自己の計算による」と、「清算価格」とあるのは「緊急清算価格」と読み替えて同条

とあるのは「緊急清算価格」と読み替えて同条の規定により計算した自己分の取引証拠金所要額に相当する額 （２）・（３）　（略） 付　則 １　この改正規定は、平成２７年９月２４日から施行する。 ２　前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社が設置するシステムの稼働に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、平成２７年９月２４日以後の当社が定める日から施行する。	の規定により計算した自己分の取引証拠金所要額に相当する額 （２）・（３）　（略）

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
（清算基金所要額） 第２条　（略） ２～７　（略） ８　当社は、別表１「清算基金所要額の算出に関する表」２．に定める計算式に規定する総受渡決済清算基金基準額を、指定市場開設者が定める国債証券先物取引に係るＬａｒｇｅ取引（以下「Ｌａｒｇｅ取引」という。）の各限月取引の取引最終日を算出基準日として算出し、当該総受渡決済清算基金基準額に第６項の規定により算出した各清算参加者の清算基金所要額を加算した額を当該取引最終日に各清算参加者に通知する。 ９　第７項の規定にかかわらず、Ｌａｒｇｅ取引の各限月取引の取引最終日から受渡決済期日の前日までの間に適用される国債先物等清算資格に係る各清算参加者の清算基金所要額は、前項の規定により各清算参加者に通知された額とする。 付　　則 この改正規定は、平成２７年９月２４日から施行する。 別表１ 清算基金所要額の算出に関する表 １．　（略） ２．国債先物等清算資格に係る清算基金所要額（以下「国債先物等清算基金所要額」という。）	（清算基金所要額） 第２条　（略） ２～７　（略） ８　当社は、別表１「清算基金所要額の算出に関する表」２．に定める計算式に規定する総受渡決済清算基金基準額を、指定市場開設者が定める国債証券先物取引に係るラージ取引(以下「ラージ取引」という。）の各限月取引の取引最終日を算出基準日として算出し、当該総受渡決済清算基金基準額に第６項の規定により算出した各清算参加者の清算基金所要額を加算した額を当該取引最終日に各清算参加者に通知する。 ９　第７項の規定にかかわらず、ラージ取引の各限月取引の取引最終日から受渡決済期日の前日までの間に適用される国債先物等清算資格に係る各清算参加者の清算基金所要額は、前項の規定により各清算参加者に通知された額とする。 別表１ 清算基金所要額の算出に関する表 １．　（略） ２．国債先物等清算資格に係る清算基金所要額（以下「国債先物等清算基金所要額」という。）

国債先物等清算基金所要額は、次に定める計算式により算出される額とする。ただし、当該額が１，０００万円を下回る場合は、１，０００万円とする。なお、計算式における用語の意義は、次のａからｃまでに定めるとおりとする。 国債先物等清算基金所要額 ＝期間最大基準ＰＭＬ額$_{JGB}$×個社按分基礎ＩＭ額$_{JGB}$／按分基礎ＩＭ総額$_{JGB}$＋総受渡決済清算基金基準額 ａ　期間最大基準ＰＭＬ額$_{JGB}$とは、日次最大基準ＰＭＬ額$_{JGB}$の算出対象期間（清算基金所要額算出基準日からさかのぼって６か月間をいう。以下この別表において同じ。）における最大値をいう。 （注１）～（注１－１－１）　（略） （注１－１－２）基準ＰＭＬ額$_{JGB}$とは、次に定める計算式により算出される額をいう。なお、計算式における用語の意義は、次の（ａ）から（ｃ）までに定めるとおりとする。 基準ＰＭＬ額$_{JGB}$ ＝ＰＭＬ額$_{JGB}$－ＩＭ額×ＰＭＬ額$_{JGB}$／ＰＭＬ額 （ａ）・（ｂ）　（略） （ｃ）　ＰＭＬ額とは、ストレスシナリオの下で各清算参加者の未決済約定（算出時にクロスマージン対象国債先物清算約定となっているものを除く。）から生じる損失額に、当該各清算参加者の先物・オプション取引に係る差金代金の授受予定額を加味した額をいう。以下この別表において同じ。 ｂ～ｄ　（略） ３．・４．　（略）	国債先物等清算基金所要額は、次に定める計算式により算出される額とする。ただし、当該額が１，０００万円を下回る場合は、１，０００万円とする。なお、計算式における用語の意義は、次のａからｃまでに定めるとおりとする。 国債先物等清算基金所要額 ＝期間最大基準ＰＭＬ額$_{JGB}$×個社按分基礎ＩＭ額$_{JGB}$／按分基礎ＩＭ総額$_{JGB}$＋総受渡決済清算基金基準額 ａ　期間最大基準ＰＭＬ額$_{JGB}$とは、日次最大基準ＰＭＬ額$_{JGB}$の算出対象期間（清算基金所要額算出基準日からさかのぼって６か月間をいう。以下この別表において同じ。）における最大値をいう。 （注１）～（注１－１－１）　（略） （注１－１－２）基準ＰＭＬ額$_{JGB}$とは、次に定める計算式により算出される額をいう。なお、計算式における用語の意義は、次の（ａ）から（ｃ）までに定めるとおりとする。 基準ＰＭＬ額$_{JGB}$ ＝ＰＭＬ額$_{JGB}$－ＩＭ額×ＰＭＬ額$_{JGB}$／ＰＭＬ額 （ａ）・（ｂ）　（略） （ｃ）　ＰＭＬ額とは、ストレスシナリオの下で各清算参加者の未決済約定から生じる損失額に、当該各清算参加者の先物・オプション取引に係る差金代金の授受予定額を加味した額をいう。以下この別表において同じ。 ｂ～ｄ　（略） ３．・４．　（略）

別紙２

業務方法書の取扱いの一部改正新旧対照表

新	旧
（金銭の受払い） 第１２条　業務方法書第５１条第３項、第５６条第１項、第６７条第１項、第６８条第１項及び第７３条の４０第２項に規定する金銭の受払いは、次の各号に定めるところにより行うものとする。 （１）・（２）　（略）	（金銭の受払い） 第１２条　業務方法書第５１条第３項、第５６条第１項、第６７条第１項、第６８条第１項及び第７３条の３９第２項に規定する金銭の受払いは、次の各号に定めるところにより行うものとする。 （１）・（２）　（略）
（国債先物等清算参加者によるクロスマージンの申請） 第２０条の７の２　業務方法書第７３条の１５の２第１項に規定するクロスマージンの申請は、金利スワップ取引清算業務システム（当社の金利スワップ取引清算業務に関して当社と清算参加者との間で情報を授受するために用いるシステムをいう。）を用いて、申請を行おうとする日の午後６時２０分までに行うものとする。	（新設）
（クロスマージンの申請に係る要件） 第２０条の７の３　業務方法書第７３条の１５の２第２項に規定するクロスマージンの申請に係る要件は、次の各号に定めるものとする。 （１）　クロスマージンの申請時点において、クロスマージン利用者ごとに、当社が当該クロスマージン利用者に係るクロスマージンの申請が行われたと仮定して、国債証券先物取引の建玉をクロスマージン制度の対象として算出した当初証拠金所要額（金利スワップ取引業務方法書第６４条に規定する当初証拠金所要額をいう。以下同じ。）に相当する額が、当該建玉を除いて算出した当初証拠金所要額に相当する額を下回ること。	（新設）

（２）　クロスマージンの申請を行う国債証券先物取引の建玉が、当該クロスマージンの申請に係るクロスマージン利用者の計算による国債証券先物取引の建玉を超えないことをクロスマージン申請者が確認できたこと。	
付　　則 この改正規定は、平成２７年９月２４日から施行する。	
別紙様式２ 国債先物等清算受託契約書	別紙様式２ 国債先物等清算受託契約書
（クロスマージンの申請） 第６条の２　乙は、乙が金利スワップ取引業務方法書に定めるクロスマージン利用者である場合には、その計算による国債証券先物取引に係る建玉について、甲に対してクロスマージンの申請に係る申込みを行うことができる。 ２　乙は、その顧客がクロスマージン利用者である場合で、当該顧客からクロスマージンの申請に係る申込みを受領したときは、当該申込みに係る建玉の数量が当該顧客の計算による国債証券先物取引に係る建玉を超えないことを確認したうえで、甲に対してクロスマージンの申請に係る申込みを取り次ぐことができる。 ３　第１項の規定に基づき、乙がクロスマージンの申請に係る申込み又はその取次ぎを甲に対して行ったときは、甲は当該クロスマージンの申請をクリアリング機構に対して行う。 ４　第１項及び第２項の規定にかかわらず、クリアリング機構が定めるところにより、甲がクロスマージンの申請を行うことができない場合には、乙はクロスマージンの申請に係る申込み又はその取次ぎを甲に対して行うことができな	（新設）

い。	
（期限の利益の喪失）	（期限の利益の喪失）
第７条　乙について次の各号の事由のいずれかが生じた場合には、乙は、甲から通知、催告等がなくても甲に対する対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引に係る債務について当然期限の利益を失い、直ちに債務を弁済しなければならない。	第７条　乙について次の各号の事由のいずれかが生じた場合には、乙は、甲から通知、催告等がなくても甲に対する対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引に係る債務について当然期限の利益を失い、直ちに債務を弁済しなければならない。
（１）～（５）　（略）	（１）～（５）　（略）
（６）　乙がクロスマージン利用者である場合で、乙がクリアリング機構の金利スワップ取引業務方法書の定めにより、クリアリング機構から破綻等の認定を受けたとき。	（新設）
（７）　乙がクロスマージン利用者である場合で、クリアリング機構が定める金利スワップ取引業務方法書に従い締結した金利スワップ清算受託契約書の定めるところにより、期限前終了日において当該金利スワップ清算受託契約書に基づく清算委託取引が終了したとき。	（新設）
２　（略）	２　（略）
（クロスマージン対象国債先物清算約定に係る権利義務関係の消滅）	
第７条の２　乙がクロスマージン利用者である場合において、クリアリング機構の業務方法書第７３条の１５の４第１項の規定により甲とクリアリング機構との間でクロスマージン対象国債先物清算約定に係る債権債務が消滅する時に、乙のクロスマージン対象国債先物清算約定に係る有価証券等清算取次ぎの委託に係る権利義務関係であって、当該債権債務に基づき生じる甲乙間の権利義務関係は、将来に向かって消滅する。	（新設）
２　前項の規定にかかわらず、クリアリング機構	

の業務方法書第７３条の１５の４第４項に規定する甲とクリアリング機構との間のクロスマージン対象国債先物清算約定に係る履行期が到来した債権債務に基づき生じる甲乙間の権利義務関係については、消滅しないものとする。	
（支払の停止があった場合等における取扱い） 第８条　乙が第７条第１項各号のいずれかに該当したときは、甲は任意に、乙のすべての対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引（クロスマージン対象国債先物清算約定に係るものを除く。）につき、それらを決済するために必要な国債証券の売付け若しくは買付け、国債証券先物取引に係る転売若しくは買戻し又は国債証券先物オプション取引に係る転売、買戻し若しくは権利行使（これらの委託を含む。）を、乙の計算において行うことができる。	（支払の停止があった場合等における取扱い） 第８条　乙が前条第１項各号のいずれかに該当したときは、甲は任意に、乙のすべての対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引につき、それらを決済するために必要な国債証券の売付け若しくは買付け、国債証券先物取引に係る転売若しくは買戻し又は国債証券先物オプション取引に係る転売、買戻し若しくは権利行使（これらの委託を含む。）を、乙の計算において行うことができる。
２　乙が第７条第２項第１号に該当したときは、甲は任意に、当該遅滞に係る対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引を決済するために必要な国債証券の売付け若しくは買付け、国債証券先物取引に係る転売若しくは買戻し又は国債証券先物オプション取引に係る転売、買戻し若しくは権利行使（これらの委託を含む。）を、乙の計算において行うことができる。	２　乙が前条第２項第１号に該当したときは、甲は任意に、当該遅滞に係る対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引を決済するために必要な国債証券の売付け若しくは買付け、国債証券先物取引に係る転売若しくは買戻し又は国債証券先物オプション取引に係る転売、買戻し若しくは権利行使（これらの委託を含む。）を、乙の計算において行うことができる。
３　乙が第７条第２項各号のいずれかに該当したときは、甲の請求により、乙は甲の指定する日時までに、乙のすべての対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引を決済するために必要な国債証券の売付け若しくは買付けに係る有価証券等清算取次ぎの委託、国債証券先物取引に係る転売若しくは買戻しに係る有価証券等清算取次ぎの委託又は国債証券先物オプション取引に係る転売若しくは買戻しに係る有	３　乙が前条第２項各号のいずれかに該当したときは、甲の請求により、乙は甲の指定する日時までに、乙のすべての対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引を決済するために必要な国債証券の売付け若しくは買付けに係る有価証券等清算取次ぎの委託、国債証券先物取引に係る転売若しくは買戻しに係る有価証券等清算取次ぎの委託又は国債証券先物オプション取引に係る転売若しくは買戻しに係る有価

価証券等清算取次ぎの委託又は権利行使の申告を行うものとする。	証券等清算取次ぎの委託又は権利行使の申告を行うものとする。
４～６　（略）	４～６　（略）
７　第１項又は第５項の規定にかかわらず、乙がクロスマージン利用者である場合で、前条の規定により、乙のクロスマージン対象国債先物清算約定に係る国債証券先物取引の有価証券等清算取次ぎの委託に係る権利義務関係が消滅するときには、当該清算約定に係る国債証券先物取引の整理について、甲及び乙は、クリアリング機構の業務方法書に定めるところに従うものとする。	（新設）
（報告）	（報告）
第１６条　乙は、甲が請求したときは、対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引又はクロスマージン制度の利用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。	第１６条　乙は、甲が請求したときは、対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく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）	２　（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	旧
（変動証拠金に係る利息の取扱い） 第７８条　当社及び清算参加者は、当社が定める基準金利を利率として、当社が定めるところにより、変動証拠金に係る利息を日々授受するものとする。 ２　清算参加者は、変動証拠金の利息の授受において支払方となる場合には、当該変動証拠金に係る利息の算出日の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　当社は、変動証拠金の利息の授受において受領方となる清算参加者に対し、当該変動証拠金に係る利息の算出日の翌当社営業日の午後１時３０分以降遅滞なく、変動証拠金に係る利息を清算参加者に支払う。	（変動証拠金に係る利息の取扱い） 第７８条　当社及び清算参加者は、当社が定める基準金利を利率として、当社が定めるところにより、変動証拠金に係る利息を月次で授受するものとする。 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。
（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）・（２）　（略） ２　（略）	（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）・（２）　（略） ２　（略）
付　則	

１　この改正規定は、平成２７年９月２４日から施行する。 ２　改正後の第７８条の規定は、この改正規定施行の日（以下「施行日」という。）を算出日とする変動証拠金に係る利息から適用する。 ３　施行日の属する月の初日から施行日の前当社営業日までを算出日とする変動証拠金に係る利息の取扱いについては、なお従前の例による。 ４　第１項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社が設置するシステムの稼働に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、平成２７年９月２４日以後の当社が定める日から施行する。	

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
（変動証拠金に係る利息の算出） 第５１条　（略） ２　変動証拠金に係る利息は、次の算式により算出した額を合計した額とする。 　算出日の前当社営業日において当社又は各清算参加者に預託されている変動証拠金×基準金利×算出日の前当社営業日から算出日までの日数／３６５日	（変動証拠金に係る利息の算出） 第５１条　（略） ２　変動証拠金に係る利息は、次の算式により算出する。 　変動証拠金に係る利息＝算出日において当社又は各清算参加者に預託されている変動証拠金の総額×基準金利×１日／３６５日 （注）休業日においては、直近の当社営業日における変動証拠金の総額及び基準金利を用いる。
（削る）	３　変動証拠金に係る利息は日々付利し、月次で授受する。
（資金決済の方法） 第５２条　業務方法書第８０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）～（３）　（略） （４）　第四階層特別清算料担保金（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第３０条第１号の規定により預託するものに限る。） （５）～（８）　（略） ２　業務方法書第８０条第１項に規定する当社が定める方法は、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方法とする。 ３　（略） ４　業務方法書第８０条第２項に規定する差引計算は、第１項各号に掲げる金銭の総受取額と総支払額の差引計算とする。	（資金決済の方法） 第５２条　業務方法書第８０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）～（３）　（略） （４）　第四階層特別清算料担保金（清算参加者の破綻処理に関する規則第３０条第１号の規定により預託するものに限る。） （５）～（８）　（略） ２　業務方法書第８０条第１項に規定する当社が定める方法は、日本銀行金融ネットワークシステムを利用して、当社の日本銀行当座勘定と清算参加者の日本銀行当座勘定の間の振替により行う方法とする。 ３　（略） ４　業務方法書第８０条第２項に規定する差引計算は、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。 （１）　第１項第２号に掲げる金銭 （２）　第１項各号に掲げる金銭から、前号に掲げ

付　　則 1　この改正規定は、平成２７年９月２４日から施行する。 2　改正後の第５１条の規定は、この改正規定施行の日（以下「施行日」という。）を算出日とする変動証拠金に係る利息から適用する。 3　施行日の属する月の初日から施行日の前当社営業日までを算出日とする変動証拠金に係る利息の取扱いについては、なお従前の例による。	る金銭を除いた金銭