

**金利スワップ取引に係る清算基金制度の見直しに伴う
金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の取扱い等の一部改正について**

I. 改正趣旨

当社は、金利スワップ清算基金の所要額について、現在、親子関係でつながる連結ベースの上位2社の破綻を想定して算出しているが、海外の主要清算機関においては、清算参加者の関連会社を含む連結ベース（以下「連結ベース（広義）」という。）の上位2先の破綻を想定した算出方法としており、また、CPMI/IOSCOが公表した「清算機関のための定量的な情報開示基準」においても、連結ベース（広義）の上位2先の破綻を想定した信用リスクの開示が求められている。これらを踏まえ、金利スワップ清算基金所要額の算出方法を見直すべく、金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の取扱い等について、別紙のとおり所要の改正を行う。

II. 改正概要

（備考）

○金利スワップ清算基金所要額の算出方法

- ・金利スワップ清算基金所要額は、担保超過リスク額の上位2先の清算参加者（連結ベース（広義）の範囲に他の清算参加者が存在する場合は、当該他の清算参加者を含む。）の担保超過リスク額を合計した額に基づいて算出することとする。

- ・金利スワップ清算基金所要額に関する規則別表

○その他

- ・連結ベース（広義）の範囲の特定のため、「関係会社に関する報告書」を金利スワップ取引清算業務における報告事項に追加する。

- ・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第20条第1項第18号の2

III. 施行日

2016年10月11日から施行する。

以上

金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の取扱い等の一部改正新旧対照表

目 次

1. 金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の取扱いの一部改正新旧対照表
2. 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

金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の取扱いの一部改正新旧対照表

新	旧
<p>(報告事項)</p> <p>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。</p> <p>(1)～(18) (略)</p> <p><u>(18)の2 金融商品取引業者にあつては、金融商品取引法第46条の3第2項の規定に基づく関係会社に関する報告書を作成したとき、登録金融機関にあつては、金融商品取引法第48条の2第2項の規定に基づく関係会社に関する報告書を作成したとき、外国法人である金融商品取引業者にあつては、金融商品取引法第49条の3第2項の規定に基づく関係会社に関する報告書を作成したとき。</u></p> <p>(19)～(36) (略)</p> <p>2～4 (略)</p> <p style="text-align: center;">付 則</p> <p>この改正規定は、平成28年10月11日から施行する。</p>	<p>(報告事項)</p> <p>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。。</p> <p>(1)～(18) (略)</p> <p>(新設)</p> <p>(19)～(36) (略)</p> <p>2～4 (略)</p>

金利スワップ清算基金所要額に関する規則の一部改正新旧対照表

新	旧
<p>別表 金利スワップ清算基金所要額の算出に関する表</p> <p>1 (略)</p> <p>2 前項に規定するストレス時想定損失負担額は、対応する金利スワップ清算基金算出日における清算参加者の担保超過リスク額（<u>清算参加者に関係会社等（ある会社の子会社及び関連会社並びに当該ある会社の親会社、当該親会社の子会社及び当該親会社の関連会社をいう。）に該当する他の清算参加者が存在する場合には、当該他の清算参加者の担保超過リスク額を合計した額</u>）が上位である清算参加者2社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7時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。</p>	<p>別表 金利スワップ清算基金所要額の算出に関する表</p> <p>1 (略)</p> <p>2 前項に規定するストレス時想定損失負担額は、対応する金利スワップ清算基金算出日における担保超過リスク額が上位である清算参加者2社（<u>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。</u>）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7時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。</p>

付 則

この改正規定は、平成28年10月11日から
施行する。