

**金利スワップ取引清算業務における未決済ポジションの移管に係る手続きのシステム化等に伴う
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おける未決済ポジションの移管（承継を含む。）に係る手続きの負荷軽減を目的として当該手続きをシステム化するほか、新規債務負担申込みの棄却抑制を目的とする対応のため、金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書等について別紙のとおり、所要の改正を行う。

II. 改正概要

1. 金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書等

(1) ポジション移管のシステム化

- ・ 当社に対する申込書の提出を必要としているポジション移管の手続きを、金利スワップ取引清算業務システムを用いて当社に申し込む方法に変更する。

(2) 債務負担要件におけるアップフロントフィー決済日に係る対応

- ・ 債務負担申込みの棄却を抑制する観点から、債務負担要件の確認を行う日の翌当社営業日がアップフロントフィーの決済日に当たる取引についても債務負担を行う。
- ・ ただし、翌当社営業日がアップフロントフィーの決済日に当たる金利スワップ取引のうち、午後4時を過ぎて債務負担申込みが行われたものについては、本対応後も当該申込みを棄却する。

2. その他

- ・ その他、所要の改正を行う。

(備 考)

- ・ 金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書第2条等
- ・ 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2条の2等
- ・ IRS業務方法書の取扱い第28条第1項第3号

III. 施行日

2025年10月6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、2025年10月6日以後の当社が定める日から施行する。

以 上

金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書等の一部改正新旧対照表

目 次

| | (ページ) |
|--|-------|
| 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 | 1 |
| 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 | 2 4 |

金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の一部改正新旧対照表

| 新 | 旧 |
|---|--|
| <p>(定義)</p> <p>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。</p> <p><u>(1) 「移管」とは、次に掲げるいずれかのことをいう。</u></p> <p>a <u>第58条の3第4項第2号又は第3号の規定により、移管先清算委託者及び当該移管先清算委託者の受託清算参加者の間に当社及び移管元清算参加者の間の清算約定(自己分)と同一の経済的効果を有する法律関係を新たに成立させるとともに、それに伴う金銭の授受及び権利義務の処理を行うこと。</u></p> <p>b <u>第58条の5第4項第2号又は第4号の規定により、移管元清算委託者及び当該移管元清算委託者の受託清算参加者の間の清算委託取引を終了させ、これに基づく債権債務を将来に向かって消滅させるとともに、それに伴う金銭の授受及び権利義務の処理を行うこと。</u></p> <p>c <u>第58条の5第4項第3号又は第5号の規定により、移管元清算委託者及び当該移管元清算委託者の受託清算参加者の間の清算委託取引を終了させこれに基づく債権債務を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移管先清算委託者の受託清算参加者の間に当該清算委託取引と同一内容の法律関係を新たに成立させ、それに伴う金銭の授受及び権利義務の処理を行うこと。</u></p> <p>d <u>第59条の2第3項の規定により、清算約定(自己分)が記録される区分口座を、当該区分口座が設定された自己取引口座</u></p> | <p>(定義)</p> <p>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。</p> <p><u>(1) 「移管」とは、次に掲げるいずれかのことをいう。</u></p> <p>a <u>第58条の5第4項の規定により、移管元清算委託者(第58条の4第1項に規定する移管元清算委託者をいう。以下本号において同じ。)及び当該移管元清算委託者の受託清算参加者の間の清算委託取引を終了させこれに基づく債権債務を将来に向かって消滅させること。</u></p> <p>b <u>第58条の5第6項の規定により、移管元清算委託者及び当該移管元清算委託者の受託清算参加者の間の清算委託取引を終了させこれに基づく債権債務を将来に向かって消滅させると同時に、移管先清算委託者(第58条の4第1項に規定する移管先清算委託者をいう。)及び当該移管先清算委託者の受託清算参加者の間に当該清算委託取引と同一内容の法律関係を新たに成立させること。</u></p> <p>c <u>第58条の7第4項の規定により、移管先清算委託者(第58条の6第1項に規定する移管先清算委託者をいう。)及び当該移管先清算委託者の受託清算参加者の間に当社及び移管元清算参加者(同項に規定する移管元清算参加者をいう。)の間の清算約定(自己分)と同一の経済的効果を有する法律関係を新たに成立させること。</u></p> |

における他の区分口座に変更すること。

e 第59条の3第3項の規定により、清算
約定（委託分）が記録される区分口座を、
当該区分口座が設定された委託取引口座
における他の区分口座に変更すること。

(1)の2 「移管先清算委託者」とは、移管
により成立する法律関係の当事者となる清
算委託者をいう。

(新設)

(1)の3 「移管先清算参加者」とは、移管
により成立する法律関係の当事者となる清
算参加者をいう。

(新設)

(1)の4 「移管元清算委託者」とは、移管
の対象となる清算委託取引の当事者である
清算委託者をいう。

(新設)

(1)の5 「移管元清算参加者」とは、移管
の対象となる清算約定（自己分）の当事者で
ある清算参加者をいう。

(新設)

(1)の6 (略)

(1)の2 (略)

(2)～(24) (略)

(2)～(24) (略)

(24)の2 「承継」とは、第58条の3第
4項第1号の規定により、当社及び清算参加
者の間で清算約定（自己分）に係る権利義務
を新たに発生させるとともに、それに伴う金
銭の授受及び権利義務の処理を行うこと又は
第58条の5第4項第1号、第94条第6
項若しくは第94条の2第2項の規定により、
当社、清算参加者及び清算委託者の間で
清算約定（委託分）及び清算委託取引に係る
権利義務を新たに発生させるとともに、それ
に伴う金銭の授受及び権利義務の処理を行
うことをいう。

(24)の2 「承継」とは、第53条の4第
4項の規定により、当社及び清算参加者の間
で清算約定（自己分）に係る権利義務を新た
に発生させるとともに、それに伴う金銭の授
受及び権利義務の処理を行うこと又は第5
8条の3第4項、第94条第6項若しくは第
94条の2第2項の規定により、当社、清算
参加者及び清算委託者の間で清算約定（委託
分）及び清算委託取引に係る権利義務を新た
に発生させるとともに、それに伴う金銭の授
受及び権利義務の処理を行うことをいう。

(24)の3 (略)

(24)の3 (略)

(24)の4 「承継日」とは、当社が承継の
申込みを承諾する日をいう。

(新設)

(24)の5 「承継申込清算約定」とは、承
継の対象となる清算約定をいう。

(新設)

(24)の6 「承継元清算参加者」とは、承
継の対象となる清算約定の当事者である清
算参加者をいう。

(新設)

(24) の 7 (略)

(25) ～ (46) (略)

(46) の 2 「担保移管」とは、清算参加者又は清算委託者が預託する当初証拠金について、第58条の2第2項又は第58条の4第2項の規定により、第58条の3第3項各号及び第58条の5第3項各号に規定する当初証拠金とみなすことをいう。

(47) ～ (73) (略)

2・3 (略)

(削る)

(削る)

(24) の 4 (略)

(25) ～ (46) (略)

(新設)

(47) ～ (73) (略)

2・3 (略)

(清算参加者の清算約定(自己分)の承継の申込み)

第53条の3 清算参加者は、当該清算参加者と当社の間で成立している清算約定(自己分)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、承継清算参加者に承継させることができる。

2 清算参加者は、前項の規定により当社に対して清算約定(自己分)の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、当該承継清算参加者の承諾を得るものとする。

3 承継清算参加者は、前項に規定する清算約定(自己分)の承継の承諾をし、かつ当該清算約定(自己分)の当事者である清算参加者(以下本条及び次条において「申込清算参加者」という。)から当該承継に係る申込書の交付を受けた場合には、承継を希望する日の午後1時まで、当社に対して、当該承継申込書(申込清算参加者及び承継清算参加者が承継に合意することが記載されていることを要する。)を提出しなければならない。

(清算約定(自己分)の承継の成立)

第53条の4 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、申込清算参加者

が承継清算参加者への承継を希望する清算約定（自己分）（以下「承継申込清算約定」という。）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、申込清算参加者及び承継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を預託していることを確認し、承継後の当該申込清算参加者及び当該承継清算参加者のポジション保有状況に問題がないと認められるときは、当社は当該承継の申込みを承諾することとする。

2 前条第1項に規定する承継申込清算約定の承継は、前項に規定する当社が承諾を行った時点において、申込清算参加者及び当社の間の承継申込清算約定に係る権利義務（次項の規定により当該清算約定（自己分）が終了する直前のもの）と当社が定める条件が同一となる権利義務を一括して承継清算参加者に承継させることとする。

3 前2項の規定により承継申込清算約定の承継が行われた場合には、承継申込清算約定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、承継申込清算約定に係る債権債務は、当社が定めるものを除き、将来に向かって消滅する。

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承継申込清算約定の決済及び承継が行われるものとする。

（1） 当該承諾の日（以下当社が承継の申込みを承諾する日を「承継日」という。）に、当社及び承継清算参加者の間において、第2項に定める権利義務が発生する。

（2） 前号の規定により発生する権利義務は、承継清算参加者の債務負担の申込みにより成立した承継清算参加者と当社の間の清算約定（担保型）の清算約定（自己分）に係

第4節 清算約定の承継等

(清算約定（自己分）の承継等の申込み)

第58条の2 清算参加者は、当社との間で成立している清算約定（自己分）の全部又は一部について、次の各号に掲げる承継又は移管を行うことができる。

(1) 承継清算参加者への清算約定（自己分）の承継

(2) 移管元清算参加者を受託清算参加者とする清算委託者への清算約定（自己分）の移管

(3) 移管元清算参加者以外の清算参加者を受託清算参加者とする清算委託者への清算約定（自己分）の移管

2 清算参加者は、清算約定（自己分）の全部について承継又は移管する場合に限り、第76条の規定により当該清算参加者が返還請求権を有する清算約定（自己分）に係る当初証拠金の全部又は一部を、次の各号に掲げる承継又は移管の区分に応じて、当該各号に掲げる者に対して、担保移管することができる。

(1) 前項第1号に規定する清算約定（自己分）の承継 承継清算参加者

(2) 前項第2号及び第3号に規定する清算約定（自己分）の移管 移管先清算委託者

る権利義務とみなす。

(3) 当社、承継清算参加者及び申込清算参加者は、前項の承継申込清算約定の終了及び第1号の規定による権利義務の発生に伴い、当社が定めるところにより、承継時支払金額、期限前終了手数料及び変動証拠金の授受を行う。

5 前項の規定により成立した承継清算参加者及び当社との間の権利義務については、これを承継清算参加者と当社との間の清算約定（担保型）の清算約定（自己分）とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。

第4節 清算約定（委託分）の承継等

(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つて、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。

2 承継清算参加者は、承継の当事者となる清算委託者と清算受託契約を締結していることを要する。

3 清算委託者は、第1項の規定により当社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、当該承継清算参加者の承諾を得るとともに、当該清算委託者が承継清算参加者への承継を希望する清算約定（委託分）（以下本節において「対象清算約定」という。）の当事者となっている受託清算参加者（以下「承継元清算参加

3 清算参加者は、第1項の規定により、清算約定（自己分）を承継又は移管（前項の規定により担保移管する場合は当該担保移管を含む。以下本条及び次条において同じ。）する場合には、あらかじめ、次の各号に掲げる承継又は移管の区分に応じて、当該各号に掲げる者に対して当該承継又は移管の申込みをし、承諾を得るものとする。

（1） 第1項第1号に規定する清算約定（自己分）の承継 承継清算参加者

（2） 第1項第2号に規定する清算約定（自己分）の移管 移管先清算委託者

（3） 第1項第3号に規定する清算約定（自己分）の移管 移管先清算委託者及び当該移管先清算委託者の受託清算参加者

4 前項の規定により清算約定（自己分）の承継又は移管の申込みが行われ、かつ承諾された場合には、次の各号に掲げる承継又は移管の区分に応じて、当該各号に掲げる清算参加者は、当社に対して、当社が定める方法により、当該承継又は移管の申込みを行わなければならない。

（1） 第1項第1号に規定する清算約定（自己分）の承継 承継清算参加者

（2） 第1項第2号に規定する清算約定（自己分）の移管 移管元清算参加者

（3） 第1項第3号に規定する清算約定（自己分）の移管 移管先清算委託者の受託清算参加者

5 当社は、前項に規定する申込みを受領した場合（第1項第2号に規定する清算約定（自己分）の移管の場合を除く。）には、当社が定める方法により、次の各号に掲げる承継又は移管の区分に応じて、当該各号に掲げる清算参加者に対して、当該申込みの内容を直ちに通知する。

（1） 第1項第1号に規定する清算約定（自己分）の承継 承継元清算参加者

（2） 第1項第3号に規定する清算約定（自己分）の移管 移管元清算参加者

6 前項各号に掲げる清算参加者は、同項に規定

者」という。）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。

4 承継清算参加者は、前項に規定する承継の承諾をし、かつ当該承継に係る清算委託者から承継申込書の交付を受けた場合には、承継を希望する日の午後1時まで、当社に対して、当該承継申込書（承継清算参加者が当該承継の申込みを受けた旨及び当該承諾をした旨、当該清算委託者が承継元清算参加者に対して当該承継の申込みを行う旨を通知した旨及び当社に当該承継の申込みをする旨並びに承継清算参加者が当社に当該承継の申込みをする旨が記載されていることを要する。）を提出しなければならない。

する申込みの内容に係る通知を受領した場合には、その内容を確認し、当社の定めるところにより、当社に対して承諾の通知を行うものとする。

7 清算参加者及び第3項各号に掲げる者は、第4項に規定する承継又は移管の申込み（当社が第5項に規定する通知を行った場合にあっては、前項に規定する承諾の通知）が行われたことをもって、当該申込みの対象となる承継又は移管を行うことに合意しているとみなされることに、あらかじめ同意する。

8 第4項から第6項までの規定により行われた承継又は移管の申込みを撤回する場合には、第4項各号に掲げる清算参加者が、当社の定めるところにより、当社に対して申告するものとする。

（清算約定（自己分）の承継等の成立）

第58条の3 当社は、前条の規定により行われた承継又は移管の申込みを受領した場合（当社が同条第5項に規定する通知を行った場合にあっては、同条第6項に規定する承諾の通知を受領した場合）には、当該承継又は移管を希望する日の当社が定める時点において、次の各号に掲げる承継又は移管の区分に応じて、当該各号に掲げる清算参加者について、当該承継又は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、当社の定めるところにより、当社に対して当該債務負担時所要証拠金の額（担保移管の申込みがあった場合は、当該担保移管が行われたと仮定した額とする。）が預託又は交付されていることを確認し、承継又は移管後のポジション保有状況に問題が無いと認められるときは、当社は当該承継又は移管の申込みを承諾することとする。

（1） 前条第1項第1号に規定する清算約定（自己分）の承継 承継元清算参加者及び承継清算参加者

（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、承継後の当該承継元清算参加者及び当該承継清算参加者のポジション保有状況に問題がないと認められるときは、当社は当該承継の申込みを承諾することとする。

2 前条第1項に規定する承継は、前項に規定する当社が承諾を行った時点において、対象清算約定に対応する次に掲げる権利義務を一括して承継清算参加者に承継させることとする。

（1） 承継元清算参加者及び当社の間の対象

- (2) 前条第1項第2号に規定する清算約定
(自己分)の移管 移管元清算参加者
- (3) 前条第1項第3号に規定する清算約定
(自己分)の移管 移管元清算参加者及び移
管先清算委託者の受託清算参加者
- 2 前条第1項各号に規定する清算約定(自己
分)の承継又は移管は、当社が前項に規定する
承諾を行った時点で成立するものとする。
- 3 前項の規定により清算約定(自己分)の承継
又は移管が成立した場合には、担保移管の申込
みがあった当初証拠金は、次の各号に掲げる承
継又は移管の区分に応じて、当該各号に規定す
る当初証拠金とみなす。
- (1) 前条第1項第1号に規定する清算約定
(自己分)の承継 承継清算参加者が当社に
預託した当初証拠金
- (2) 前条第1項第2号及び第3号に規定す
る清算約定(自己分)の移管 移管先清算委
託者が当該移管先清算委託者の受託清算参
加者を代理人として当社に預託した当初証
拠金
- 4 第1項の規定により、清算約定(自己分)の
承継又は移管の申込みを当社が承諾した場合
には、次の各号に掲げる承継又は移管の区分に
応じて、当該各号に定めるところにより、承継
又は移管が行われるものとする。
- (1) 前条第1項第1号に規定する清算約定
(自己分)の承継
- a 権利義務の発生及び法律関係の成立
当社及び承継清算参加者の間において、
承継元清算参加者及び当社との間の承継申
込清算約定に係る権利義務(次のbの規定
により当該清算約定が終了する直前のもの)
と当社が定める条件が同一となる権利
義務が発生するものとする。この場合にお
いて、当該権利義務については、これを承
継清算参加者と当社との間の清算約定(担保
型)の清算約定(自己分)とみなして、本
業務方法書等の規定を適用する。

- 清算約定に係る権利義務(次項の規定により
対象清算約定が終了する直前のもの)と当社
が定める条件が同一となる権利義務
- (2) 承継元清算参加者及び当該清算委託者
の間の清算委託取引に係る権利義務(次項の
規定により対象清算約定に係る清算委託取
引が終了する直前のもの)と当社が定める条
件が同一となる権利義務
- 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。
- 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し
る。
- (1) 承継日に、当社、承継清算参加者及び
当該承諾に係る清算委託者の間において、第
2項各号の権利義務が発生する。
- (2) 前号の規定により発生する権利義務
は、当該承諾に係る清算委託者の承継清算参
加者に対する有価証券等清算取次ぎの委託
に基づき、承継清算参加者が当該清算委託者
の計算により対象清算約定の終了時に成立
させた清算約定(担保型)の清算約定(委託
分)及びその清算委託取引に係る権利義務と
みなす。
- (3) 当社、承継清算参加者、承継元清算参
加者及び当該承諾に係る清算委託者は、第3
項の対象清算約定及び当該対象清算約定に
係る清算委託取引の終了並びに第1号の規
定による権利義務の発生に伴い、当社が定め
るところにより、承継時支払金額、期限前終
了手数料及び変動証拠金の授受を行う。

b 債権債務の消滅

承継申込清算約定は、前 a の規定による権利義務の成立と同時に当然に終了するとともに、当該承継申込清算約定に係る債権債務は、当社が定めるものを除き、将来に向かって消滅する。

c 金銭の授受

当社は、当社が定めるところにより、承継時等支払金額及び期限前終了手数料を算出することとし、当社、承継清算参加者及び承継元清算参加者は、a の規定による権利義務の発生及び前 b の規定による承継申込清算約定の終了に伴い、当社が定めるところにより、承継時等支払金額、期限前終了手数料及び変動証拠金の授受を行う。

(2) 前条第1項第2号に規定する清算約定(自己分)の移管

移管先清算委託者及び移管元清算参加者の間において、移管対象の清算約定(自己分)(当社が定める債権債務を除く。)と同一の経済的効果を有する法律関係が新たに成立するものとする。この場合において、当該法律関係については、移管元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委託取引(担保型)とみなし、移管対象の清算約定(自己分)は、当該清算委託取引に係る清算約定(担保型)の清算約定(委託分)とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。

(3) 前条第1項第3号に規定する清算約定(自己分)の移管

a 権利義務の発生及び法律関係の成立

(a) 移管先清算委託者及び当該移管先清算委託者の受託清算参加者の間において、移管対象の清算約定(自己分)(当社が定める債権債務を除く。)と同一の経済的効果を有する法律関係が新たに成立するものとする。この場合におい

(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 a 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。

5 前項の規定により成立した当社及び承継清算参加者間の権利義務については、これを清算約定(担保型)の清算約定(委託分)とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。

て、当該法律関係については、移管先清算委託者の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委託取引（担保型）とみなす。

（b） 移管先清算委託者の受託清算参加者及び当社の間において、移管対象の清算約定（自己分）に係る権利義務と当社が定める条件が同一となる権利義務が新たに発生するものとする。この場合において、当該権利義務については、前（a）で成立した清算委託取引に係る清算約定（担保型）の清算約定（委託分）とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。

b 債権債務の消滅

前 a（a）の法律関係の成立と同時に、移管対象の清算約定（自己分）は当然に終了するとともに、当該清算約定（自己分）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。

c 金銭の授受

当社は、当社が定めるところにより、承継時等支払金額及び期限前終了手数料を算出することとし、a（b）の規定による権利義務の発生及び前 b の規定による清算約定（自己分）の終了に伴い、当社、移管元清算参加者及び移管先清算委託者の受託清算参加者は、当社が定めるところにより、承継時等支払金額、期限前終了手数料及び変動証拠金の授受を行う。

5 清算約定（自己分）の移管に伴う移管元清算参加者及び移管先清算委託者（前条第1項第3号に規定する清算約定（自己分）の移管の場合には、当該移管先清算委託者の受託清算参加者を含む。）の間の債権債務の清算は、これらの者の間において、その合意に従って行う。

（清算約定（委託分）の承継等の申込み）

第58条の4 清算委託者（清算受託契約に規定

（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（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同じ。)は、自らの計算により成立している清算約定(委託分)及び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、次の各号に掲げる承継又は移管を行うことができる。

(1) 承継清算参加者(承継の当事者となる清算委託者と清算受託契約を締結している者に限る。以下本条及び次条において同じ。)への清算約定(委託分)の承継

(2) 移管元清算委託者の受託清算参加者である清算参加者への清算委託取引の移管

(3) 受託清算参加者を同一とする他の清算委託者への清算委託取引の移管

(4) 移管元清算委託者の受託清算参加者以外の清算参加者への清算委託取引の移管

(5) 移管元清算委託者の受託清算参加者以外の清算参加者を受託清算参加者とする他の清算委託者への清算委託取引の移管

2 清算委託者は、同一の委託取引口座における清算約定(委託分)又は同一の清算取次口座における清算委託取引の全部について承継又は移管する場合に限り、第76条の規定により当該清算委託者が返還請求権を有する当初証拠金(第72条の規定より預託されたものに限る。)の全部又は一部を、次の各号に掲げる承継又は移管の区分に応じ、当該各号に掲げる者に対して、担保移管することができる。

(1) 前項第1号に規定する清算約定(委託分)の承継 承継清算参加者

(2) 前項第2号及び第4号に規定する清算委託取引の移管 移管先清算参加者

(3) 前項第3号及び第5号に規定する清算委託取引の移管 移管先清算委託者

3 清算委託者は、第1項の規定により、清算約

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、清算参加者(以下「移管先清算参加者」という。)又は他の清算委託者(以下本条及び次条において「移管先清算委託者」という。)に移管することができる。

2 移管元清算委託者は、前項の規定により清算委託取引を移管する場合には、あらかじめ、当該移管元清算委託者の受託清算参加者(当該受託清算参加者以外の移管先清算参加者に対して移管する場合(以下「受託外参加者承継の場合」という。))には当該移管先清算参加者を、移管先清算委託者に対して移管する場合には当該移管先清算委託者及びその受託清算参加者を含む。以下本条において同じ。)に対して当該移管の申込みをし、当該移管元清算委託者の受託清算参加者の承諾を得るものとする。

3 移管元清算委託者の受託清算参加者は、前項に規定する清算委託取引の移管の承諾をし、かつ移管元清算委託者から当該移管に係る申込書の交付を受けた場合には、移管を希望する日の午後1時まで、当社に対して、当該申込書(移管元清算委託者及び当該移管元清算委託者の受託清算参加者が移管に合意することが記載されていることを要する。)を提出しなければならない。

定(委託分)を承継又は清算委託取引を移管(いずれの場合も、前項の規定により担保移管する場合は当該担保移管を含む。以下本条及び次条において同じ。)する場合には、あらかじめ、次の各号に掲げる承継又は移管の区分に応じて、当該各号に掲げる者に対して当該承継又は移管の申込みをし、承諾を得るものとする。

(1) 第1項第1号に規定する清算約定(委託分)の承継 承継元清算参加者及び承継清算参加者

(2) 第1項第2号に規定する清算委託取引の移管 移管先清算参加者

(3) 第1項第3号に規定する清算委託取引の移管 移管先清算委託者及び当該移管先清算委託者の受託清算参加者

(4) 第1項第4号に規定する清算委託取引の移管 移管元清算委託者の受託清算参加者及び移管先清算参加者

(5) 第1項第5号に規定する清算委託取引の移管 移管元清算委託者の受託清算参加者、移管先清算委託者及び当該移管先清算委託者の受託清算参加者

4 前項の規定により、清算約定(委託分)の承継又は清算委託取引の移管の申込みが行われ、かつ承諾された場合には、次の各号に掲げる承継又は移管の区分に応じて、当該各号に掲げる清算参加者は、当社に対して、当社が定めるところにより、当該承継又は移管の申込みを行わなければならない。

(1) 第1項第1号に規定する清算約定(委託分)の承継 承継清算参加者

(2) 第1項第2号及び第4号に規定する清算委託取引の移管 移管先清算参加者

(3) 第1項第3号及び第5号に規定する清算委託取引の移管 移管先清算委託者の受託清算参加者

5 当社は、前項に規定する申込みを受領した場合(第1項第2号又は第3号に規定する清算委託取引の移管の場合を除く。)には、当社が定

めるところにより、次の各号に掲げる承継又は移管の区分に応じて、当該各号に掲げる清算参加者に対して、当該申込みの内容を直ちに通知する。

(1) 第1項第1号に規定する清算約定（委託分）の承継 承継元清算参加者

(2) 第1項第4号及び第5号に規定する清算委託取引の移管 移管元清算委託者の受託清算参加者

6 前項各号に掲げる清算参加者は、前項に規定する申込みの内容に係る通知を受領した場合には、その内容を確認し、当社の定めるところにより、当社に対して承諾の通知を行うものとする。

7 清算委託者及び第3項各号に掲げる者は、第4項に規定する承継又は移管の申込み（当社が第5項の通知を行った場合にあっては、前項に規定する承諾の通知）が行われたことをもって、当該申込みの対象となる承継又は移管を行うことに合意しているとみなされることに、あらかじめ同意する。

8 第4項から第6項までの規定により行われた承継又は移管の申込みを撤回する場合には、第4項各号に掲げる清算参加者が、当社の定めるところにより、当社に対して申告するものとする。

（清算約定（委託分）の承継等の成立）

第58条の5 当社は、前条の規定により行われた承継又は移管の申込みを受領した場合（当社が同条第5項に規定する通知を行った場合にあっては、同条第6項に規定する承諾の通知を受領した場合）には、当該承継又は移管を希望する日の当社が定める時点において、次の各号に掲げる承継又は移管の区分に応じて、当該各号に掲げる清算参加者について、当該承継又は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、当社の定めるところにより、当社に対して当該債

（清算委託者の清算委託取引の移管の成立）

第58条の5 当社は、前条第3項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、移管元清算委託者の受託清算参加者（受託外参加者承継の場合には移管先清算参加者を、移管先清算委託者に対して移管する場合には当該移管先清算委託者の受託清算参加者を含む。以下本項において同じ。）が当社に対して当該債務負担時所要証拠金の額（第3項

務負担時所要証拠金の額（担保移管の申込みがあった場合は、当該担保移管が行われたと仮定した額とする。）が預託又は交付されていることを確認し、承継又は移管後のポジション保有状況に問題が無いと認められるときは、当社は当該承継又は移管の申込みを承諾することとする。

（１） 前条第１項第１号に規定する清算約定（委託分）の承継 承継元清算参加者及び承継清算参加者

（２） 前条第１項第２号に規定する清算委託取引の移管 移管先清算参加者

（３） 前条第１項第３号に規定する清算委託取引の移管 移管先清算委託者の受託清算参加者

（４） 前条第１項第４号に規定する清算委託取引の移管 移管元清算委託者の受託清算参加者及び移管先清算参加者

（５） 前条第１項第５号に規定する清算委託取引の移管 移管元清算委託者の受託清算参加者及び移管先清算委託者の受託清算参加者

２ 前条第１項各号に規定する清算約定（委託分）の承継又は清算委託取引の移管は、当社が前項に規定する承諾を行った時点で成立するものとする。

３ 前項の規定により清算約定（委託分）の承継又は清算委託取引の移管が成立した場合には、担保移管の申込みがあった当初証拠金は、次の各号に掲げる承継又は移管の区分に応じて、当該各号に規定する当初証拠金とみなす。

（１） 前条第１項第１号に規定する清算約定（委託分）の承継 清算委託者が承継清算参加者を代理人として当社に預託した当初証拠金

（２） 前条第１項第２号及び第４号に規定する清算委託取引の移管 移管先清算参加者が当社に預託した当初証拠金

（３） 前条第１項第３号及び第５号に規定す

の規定により移管先清算委託者が当該移管先清算委託者の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移管先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、移管後の当該移管元清算委託者の受託清算参加者のポジション保有状況に問題がないと認められるときは、当社は当該移管の申込みを承諾することとする。

２ 清算委託取引の移管は、前項の規定により移管の申込みを当社が承諾した時点で成立するものとする。

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当該移管元清算委託者の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当該移管先清算委託者の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（清算委託取引を移管先清算参加者に移管した場合には、当該移管先清算参加者が当社に預託した当初証拠金）とみなす。

４ 移管先清算参加者に対し清算委託取引を移管する場合において、第２項の規定により移管が成立したときは、移管の対象となった移管元清算委託者及び当該移管元清算委託者の受託清算参加者の間の清算委託取引（受託外参加者承継の場合には当該清算委託取引に係る清算約定（委託分）を含む。以下本項において同じ。）は当然に終了するとともに、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、将来に向かって消滅するものとする。受託外参加者承継の場合には、これと同時に、当該移管先清算参加者及び当社の間において本項

る清算委託取引の移管 移管先清算委託者が当該清算委託者の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

4 第2項の規定により清算約定（委託分）の承継又は清算委託取引の移管が成立した場合には、次の各号に掲げる承継又は移管の区分に応じて、当該各号に定めるところにより、承継又は移管が行われるものとする。

（1） 前条第1項第1号に規定する清算約定（委託分）の承継

a 権利義務の発生及び法律関係の成立

（a） 当社及び承継清算参加者の間において、承継元清算参加者及び当社の間の承継申込清算約定に係る権利義務（次のbの規定により承継申込清算約定が終了する直前のもの）と当社が定める条件が同一となる権利義務が発生するものとする。この場合において、当該権利義務については、これを清算委託者の承継清算参加者に対する有価証券等清算取次ぎの委託に基づき、承継清算参加者が当該清算委託者の計算により承継申込清算約定の終了時に成立させた清算約定（担保型）の清算約定（委託分）とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。

（b） 清算委託者及び承継清算参加者の間において、清算委託者及び承継元清算参加者の間の清算委託取引に係る権利義務（次のbの規定により承継申込清算約定に係る清算委託取引が終了する直前のもの）と当社が定める条件が同一となる権利義務が発生するものとする。この場合において、当該権利義務については、前（a）によりみなされる清算約定に係る清算委託取引の権利義務とみなす。

b 債権債務の消滅

承継申込清算約定及び当該承継申込清

算の規定により終了する清算約定（委託分）に係る権利義務と当社が定める条件が同一となる権利義務が新たに発生するものとする。

5 受託外参加者承継の場合には、当社は、当社が定めるところにより、承継時支払金額及び期限前終了手数料を算出することとし、前項の規定による清算約定（委託分）の終了及び権利義務の発生に伴い、当社、移管元清算委託者の受託清算参加者及び移管先清算参加者は、当社が定めるところにより、承継時支払金額、期限前終了手数料及び変動証拠金の授受を行う。

6 移管先清算委託者に対して清算委託取引を移管する場合において、第2項の規定により移管が成立したときは、移管の対象となった移管元清算委託者及び当該移管元清算委託者の受託清算参加者の間の清算委託取引（当該受託清算参加者以外の清算参加者を受託清算参加者とする移管先清算委託者に対し移管する場合（以下「受託外委託者承継（委託分）の場合」という。）には、当該清算委託取引に係る清算約定（委託分）を含む。以下本項において同じ。）は当然に終了するとともに、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、将来に向かって消滅するものとする。これと同時に、移管先清算委託者及び当該移管先清算委託者の受託清算参加者の間において当該清算委託取引と同一内容の法律関係（受託外委託者承継（委託分）の場合には、当該移管先清算委託者の受託清算参加者及び当社の間において本項の規定により終了する清算約定（委託分）に係る権利義務と当社が定める条件が同一となる権利義務を含む。）が新たに成立するものとする。

7 受託外委託者承継（委託分）の場合には、当社は、当社が定めるところにより、承継時支払金額及び期限前終了手数料を算出することとし、前項の規定による清算約定（委託分）の終了及び法律関係の成立に伴い、当社、移管元清算委託者の受託清算参加者及び移管先清算委

算約定に係る清算委託取引は、前 a の規定による権利義務の発生と同時に当然に終了するとともに、当該承継申込清算約定及び当該承継申込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。

c 金銭の授受

当社は、当社が定めるところにより、承継時等支払金額及び期限前終了手数料を算出することとし、当社、承継清算参加者、承継元清算参加者及び清算委託者は、a の規定による権利義務の発生及び前 b の規定による承継申込清算約定の終了に伴い、当社が定めるところにより、承継時等支払金額、期限前終了手数料及び変動証拠金の授受を行う。

(2) 前条第 1 項第 2 号に規定する清算委託取引の移管

移管元清算委託者及び当該移管元清算委託者の受託清算参加者の間において、移管対象の清算委託取引は当然に終了するとともに、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、将来に向かって消滅するものとする。この場合において、終了する清算委託取引に係る清算約定（委託分）は、移管先清算参加者の清算約定（担保型）の清算約定（自己分）とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。

(3) 前条第 1 項第 3 号に規定する清算委託取引の移管

a 権利義務の発生及び法律関係の成立

移管先清算委託者及び当該移管先清算委託者の受託清算参加者の間において、移管対象の清算委託取引と同一内容の法律関係が新たに成立するものとする。この場合において、当該法律関係は、当該移管先清算委託者の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委託取引（担保型）とみなす。

託者の受託清算参加者は、当社が定めるところにより、承継時支払金額、期限前終了手数料及び変動証拠金の授受を行う。

8 清算委託取引の移管に伴う移管元清算委託者及び当該移管元清算委託者の受託清算参加者（受託外参加者承継の場合には移管先清算参加者を、移管先清算委託者に対して移管する場合には当該移管先清算委託者及びその受託清算参加者を含む。）の間の債権債務の清算は、これらの者の間において、その合意に従って行う。

9 移管先清算参加者に対して清算委託取引を移管する場合において、第 4 項前段の規定により終了する清算委託取引に係る清算約定（委託分）（受託外参加者承継の場合には、第 4 項後段の規定により発生する権利義務）は、当該移管先清算参加者の清算約定（担保型）の清算約定（自己分）とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。

10 移管先清算委託者に対して清算委託取引を移管する場合において、第 6 項後段の規定により移管先清算委託者及び当該移管先清算委託者の受託清算参加者の間において成立する法律関係は、当該移管先清算委託者の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委託取引（担保型）とみなし、同項前段の規定により終了する清算委託取引に係る清算約定（委託分）（受託外委託者承継（委託分）の場合には、同項後段の規定により移管先清算委託者の受託清算参加者及び当社の間において発生する権利義務）は、移管先清算委託者の計算により成立する清算約定（担保型）の清算約定（委託分）とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。

b 債権債務の消滅

移管元清算委託者及び当該移管元清算委託者の受託清算参加者の間において、移管対象の清算委託取引は当然に終了するとともに、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、将来に向かって消滅するものとする。この場合において、終了する清算委託取引に係る清算約定（委託分）は、移管先清算委託者の計算により成立する清算約定（担保型）の清算約定（委託分）とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。

(4) 前条第1項第4号に規定する清算委託取引の移管

a 権利義務の発生及び法律関係の成立

移管先清算参加者及び当社の間において、次のbの規定により終了する清算約定（委託分）に係る権利義務と当社が定める条件が同一となる権利義務が新たに発生するものとする。この場合において、当該権利義務は、移管先清算参加者の清算約定（担保型）の清算約定（自己分）とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。

b 債権債務の消滅

移管元清算委託者及び当該移管元清算委託者の受託清算参加者の間において、移管対象の清算委託取引及び当該清算委託取引に係る清算約定（委託分）は当然に終了するとともに、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、将来に向かって消滅するものとする。

c 金銭の授受

当社は、当社が定めるところにより、承継時等支払金額及び期限前終了手数料を算出することとし、aの規定による権利義務の発生及び前bの規定による清算約定（委託分）の終了に伴い、当社、移管元清算委託者の受託清算参加者及び移管先清算参加者は、当社が定めるところにより、

承継時等支払金額、期限前終了手数料及び変動証拠金の授受を行う。

(5) 前条第1項第5号に規定する清算委託取引の移管

a 権利義務の発生及び法律関係の成立

(a) 移管先清算委託者及び当該移管先清算委託者の受託清算参加者の間において、移管対象の清算委託取引と同一内容の法律関係が新たに成立するものとする。この場合において、当該法律関係は、当該移管先清算委託者の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委託取引(担保型)とみなす。

(b) 移管先清算委託者の受託清算参加者及び当社の間において次のbの規定により終了する清算約定(委託分)に係る権利義務と当社が定める条件が同一となる権利義務が新たに発生するものとする。この場合において、当該権利義務は、移管先清算委託者の計算により成立する清算約定(担保型)の清算約定(委託分)とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。

b 債権債務の消滅

移管元清算委託者及び当該移管元清算委託者の受託清算参加者の間において、移管対象の清算委託取引及び当該清算委託取引に係る清算約定(委託分)は当然に終了するとともに、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、将来に向かって消滅する。

c 金銭の授受

当社は、当社が定めるところにより、承継時等支払金額及び期限前終了手数料を算出することとし、aの規定による法律関係の成立及び前bの規定による清算約定(委託分)の終了に伴い、当社、移管元清算委託者の受託清算参加者及び移管先清

算委託者の受託清算参加者は、当社が定めるところにより、承継時等支払金額、期限前終了手数料及び変動証拠金の授受を行う。

- 5 清算委託取引の移管に伴う移管元清算委託者及び当該移管元清算委託者の受託清算参加者（前条第1項第4号に規定する清算委託取引の移管の場合には移管先清算参加者を、前条第1項第5号に規定する清算委託取引の移管の場合には当該移管先清算委託者及びその受託清算参加者を含む。）の間の債権債務の清算は、これらの者の間において、その合意に従って行う。

(削る)

（清算参加者の清算約定（自己分）の移管の申込み）

第58条の6 清算参加者（以下本条及び次条において「移管元清算参加者」という。）は、当社との間で成立している清算約定（自己分）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、清算委託者（以下本条及び次条において「移管先清算委託者」という。）に移管することができる。

2 移管元清算参加者は、前項の規定により清算約定（自己分）を移管する場合には、あらかじめ、移管先清算委託者（当該移管元清算参加者以外の清算参加者を受託清算参加者とする移管先清算委託者に移管する場合（以下「受託外委託者承継（自己分）の場合」という。）には当該清算参加者を含む。以下本条において同じ。）に対して当該移管の申込みをし、当該移管先清算委託者の承諾を得るものとする。

3 移管元清算参加者は、前項に規定する清算約定（自己分）の移管について移管先清算委託者の承諾を得た場合には、移管を希望する日の午後1時まで、当社に対して、当該申込書（移管元清算参加者及び移管先清算委託者が移管に合意することが記載されていることを要する。）を提出しなければならない。

(削る)

(清算参加者の清算約定（自己分）の移管の成立)

第58条の7 当社は、前条第3項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、移管元清算参加者が移管先清算委託者への移管を希望する清算約定（自己分）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、移管元清算参加者（受託外委託者承継（自己分）の場合には移管先清算委託者の受託清算参加者を含む。以下本項において同じ。）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当該移管先清算委託者の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、移管後の当該移管元清算参加者のポジション保有状況に問題がないと認められるときは、当社は当該移管の申込みを承諾することとする。

2 清算約定（自己分）の移管は、前項の規定により移管の申込みを当社が承諾した時点で成立するものとする。

3 前項の規定により清算約定（自己分）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参加者が返還請求権を有する清算約定（自己分）に係る当初証拠金（清算約定（自己分）の全部について移管された場合であって、移管元清算参加者が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。）は、移管先清算委託者が当該移管先清算委託者の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とみなす。

4 第2項の規定により清算約定（自己分）の移管が成立した場合には、移管先清算委託者及び当該移管先清算委託者の受託清算参加者の間において当該清算約定（自己分）（当社が定める債権債務を除く。）と同一の経済的効果を有

する法律関係が新たに成立するものとする。この場合において、受託外委託者承継（自己分）の場合には、当該清算約定（自己分）は当然に終了するとともに、当該清算約定（自己分）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ものとし、これと同時に、当該移管先清算委託者の受託清算参加者及び当社の間において当該清算約定（自己分）に係る権利義務と当社が定める条件が同一となる権利義務が新たに発生するものとする。

5 清算約定（自己分）の移管に伴う移管元清算参加者及び移管先清算委託者（受託外委託者承継（自己分）の場合には当該移管先清算委託者の受託清算参加者を含む。）の間の債権債務の清算は、これらの者の間において、その合意に従って行う。

6 受託外委託者承継（自己分）の場合には、当社は、当社が定めるところにより、承継時支払金額及び期限前終了手数料を算出することとし、第4項の規定による清算約定（自己分）の終了及び権利義務の発生に伴い、当社、移管元清算参加者及び移管先清算委託者の受託清算参加者は、当社が定めるところにより、承継時支払金額、期限前終了手数料及び変動証拠金の授受を行う。

7 第4項前段の規定により成立する法律関係は、当該移管先清算委託者の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委託取引（担保型）とみなし、第1項の移管の申込みに係る清算約定（自己分）（受託外委託者承継（自己分）の場合には、第4項後段の規定により発生する権利義務）は、当該清算委託取引に係る清算約定（担保型）の清算約定（委託分）とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。

（清算参加者口座）

第59条 （略）

2・3 （略）

（清算参加者口座）

第59条 （略）

2・3 （略）

4 清算参加者は、第60条第2項の規定により複数に区分する清算取次口座を開設した場合には、当社に対し、当該区分に応じて委託取引口座を区分するよう請求するものとし、当社は当該請求に基づき委託取引口座を複数に区分する口座を設定する。

5～7 (略)

(清算約定(自己分)を記録する区分口座の変更)

第59条の2 清算参加者は、当社との間で成立している清算約定(自己分)の全部又は一部について、それらが記録される区分口座を、当該区分口座が設定された自己取引口座における他の区分口座に変更することができる。

2 清算参加者は、前項に規定する変更を行う場合には、当社が定めるところにより、当社に対して申告するものとする。

3 当社は、前項に規定する変更の申告を受領した場合には、当該申告があった当社営業日の当社が定める時点において、当該変更を行う。

4 清算参加者は、第2項の規定による変更の申告を撤回する場合には、当社の定めるところにより、当社に対して申告するものとする。

(清算約定(委託分)を記録する区分口座の変更)

第59条の3 清算委託者は、当社との間で成立している清算約定(委託分)の全部又は一部について、それらが記録される区分口座を、当該区分口座が設定された委託取引口座における他の区分口座に変更することができる。

2 清算委託者は、前項に規定する変更の申告の指図を行おうとする場合には、その旨を受託清算参加者に通知し、当該通知を受領した受託清算参加者は、当社が定めるところにより、当社に対して変更の申告を行うものとする。

3 当社は、前項に規定する変更の申告を受領した場合には、当該申告があった当社営業日の当

4 清算参加者は、次条第2項の規定により複数に区分する清算取次口座を開設した場合には、当社に対し、当該区分に応じて委託取引口座を区分するよう請求するものとし、当社は当該請求に基づき委託取引口座を複数に区分する口座を設定する。

5～7 (略)

(新設)

(新設)

社が定める時点において、当該変更を行う。

- 4 清算委託者は、第2項の規定による変更の申告を撤回する場合には、その旨を受託清算参加者に通知し、当該通知を受領した受託清算参加者は、当社が定めるところにより当社に対して撤回の申告を行うものとする。

(清算取次口座)

第60条 (略)

- 2 受託清算参加者は、清算委託者の請求があった場合には、当該清算委託者のために開設した清算取次口座を複数に区分する口座(以下本条において「清算取次区分口座」という。)を開設することができる。

3 (略)

- 4 受託清算参加者は、前条の規定により、委託取引口座において、清算約定(委託分)を記録する区分口座に変更があった場合には、当該変更に応じ、対象となった清算約定(委託分)に係る清算委託取引を管理する清算取次区分口座を変更するものとする。

付 則

- 1 この改正規定は、令和7年10月6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、令和7年10月6日以後の当社が定める日から施行する。

(清算取次口座)

第60条 (略)

- 2 受託清算参加者は、清算委託者の請求があった場合には、当該清算委託者のために開設した清算取次口座を複数に区分する口座を開設することができる。

3 (略)

(新設)

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>(当社が指定する通貨)</p> <p>第2条の2 業務方法書第2条第1項第1号の<u>6</u>、第11号、第50号及び第55号に規定する当社が指定する通貨は、米ドルとする。</p> <p>(債務負担に係る条件等)</p> <p>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つては、第1号に掲げる要件に限る。また、第3号及び第4号に掲げる要件にあつては、当該適格金利スワップ取引がパッケージ取引に属する場合に限る。)を満たすこととする。</p> <p>(1) (略)</p> <p>(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にあたらないこと。</p> <p><u>(3) 次項各号に掲げ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(当社が午後4時以降に債務負担の申込みを受領した場合にあつては、同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)がアップフロントフィーの決済日にあたらないこと。</u></p> <p><u>(4)</u> (略)</p> <p><u>(5)</u> (略)</p> <p>2～10 (略)</p> <p>(損益差金等の授受の申込みの方法等)</p> <p>第29条の2 (略)</p> | <p>(当社が指定する通貨)</p> <p>第2条の2 業務方法書第2条第1項第1号の<u>2</u>、第11号、第50号及び第55号に規定する当社が指定する通貨は、米ドルとする。</p> <p>(債務負担に係る条件等)</p> <p>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つては、第1号に掲げる要件に限る。また、第3号及び第4号に掲げる要件にあつては、当該適格金利スワップ取引がパッケージ取引に属する場合に限る。)を満たすこととする。</p> <p>(1) (略)</p> <p>(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<u>アップフロントフィーの決済日</u>にあたらないこと。</p> <p>(新設)</p> <p><u>(3)</u> (略)</p> <p><u>(4)</u> (略)</p> <p>2～10 (略)</p> <p>(損益差金等の授受の申込みの方法等)</p> <p>第29条の2 (略)</p> |

2・3 (略)

4 当社は、業務方法書第51条の2第1項の規定による損益差金等の授受の申込みについて、同条第2項の規定による資金決済化要件の充足の確認を、当該申込みを受けた日の午後4時（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、業務方法書第53条の2第2項の規定に従い当社がクーポン・ブレンディング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、業務方法書第53条の2の3第2項の規定に従い当社が参加者提案型コンプレッション成立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、業務方法書第53条の2の4第4項の規定に従い当社がJSCC提案型コンプレッション成立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、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。）以降速やかに行うものとする。ただし、午後4時より後の当該申込み（午後5時30分から午後7時までの間に新たに自己取引口座又は委託取引口座に記録された清算約定について、第2項の規定により当社に対して損益差金等の授受の申込みが行われたものとみなされる場合を含む。）については、午後7時以降速やかに当該要件の充足の確認を行うものとする。

（清算約定（自己分）の承継等時に授受する金銭等に関する事項）

第30条の5 業務方法書第58条の3第4項第1号cに規定する期限前終了手数料及び承継時等支払金額は、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

2・3 (略)

4 当社は、業務方法書第51条の2第1項の規定による損益差金等の授受の申込みについて、同条第2項の規定による資金決済化要件の充足の確認を、当該申込みを受けた日の午後4時（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、業務方法書第53条の2第2項の規定に従い当社がクーポン・ブレンディング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、業務方法書第53条の2の3第2項の規定に従い当社が参加者提案型コンプレッション成立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、業務方法書第53条の2の4第4項の規定に従い当社がJSCC提案型コンプレッション成立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、業務方法書第53条の4第1項、同第58条の3第1項、同第58条の5第1項又は同第58条の7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。）以降速やかに行うものとする。ただし、午後4時より後の当該申込み（午後5時30分から午後7時までの間に新たに自己取引口座又は委託取引口座に記録された清算約定について、第2項の規定により当社に対して損益差金等の授受の申込みが行われたものとみなされる場合を含む。）については、午後7時以降速やかに当該要件の充足の確認を行うものとする。

（清算約定（自己分）の承継等時に授受する金銭等に関する事項）

第30条の5 業務方法書第53条の4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。

ものとする。

(1) (略)

(2) 当社及び承継清算参加者は、承継申込清算約定（業務方法書第58条の2第1項第1号に規定する承継の対象となる清算約定をいう。以下同じ。）の終了日までに承継元清算参加者が当社に預託した変動証拠金の差引累計額に当該終了の日の翌当社営業日に授受すべき変動証拠金に係る利息を加減した額（当該承継申込清算約定が清算約定（決済型）である場合には、当該終了日までに承継元清算参加者が当社に交付した損益差金の差引累計額（損益差金の総支払額から総受取額を控除した額をいう。）に当該終了の日の翌当社営業日に授受すべき損益差金に係る調整金を加減した額とする。）と同額の承継時等支払金額を授受するものとする。この場合において、当該額が正数の場合には当社から承継清算参加者に承継時等支払金額を支払い、当該額が負数の場合には承継清算参加者から当社に承継時等支払金額を支払う。

2 当社、承継清算参加者及び承継元清算参加者は、業務方法書第58条の3第4項第1号cの規定に従い、前項の規定により算出した承継時等支払金額及び期限前終了手数料を、承継申込清算約定の終了の日の翌当社営業日に変動証拠金等と差引計算して授受を行う。

3 前2項の規定は、当社が、業務方法書第58条の5第4項第4号c及び第5号cの規定により期限前終了手数料及び承継時等支払金額を算出する場合に準用する。この場合において、第1項柱書中「第58条の3第4項第1号c」とあるのは「第58条の5第4項第4号c及び第5号c」と、同項第2号中「承継清算参加者は」とあるのは「移管先清算参加者（業務方法書第58条の4第1項第5号に規定する清算委託取引の移管の場合には当

(1) (略)

(2) 当社及び承継清算参加者は、承継申込清算約定（業務方法書第53条の4第1項に規定する承継申込清算約定をいう。以下同じ。）の終了日までに申込清算参加者（業務方法書第53条の3第1項に規定する申込清算参加者をいう。以下同じ。）が当社に預託した変動証拠金の差引累計額に当該終了の日の翌当社営業日に授受すべき変動証拠金に係る利息を加減した額（当該承継申込清算約定が清算約定（決済型）である場合には、当該終了日までに申込清算参加者が当社に交付した損益差金の差引累計額（損益差金の総支払額から総受取額を控除した額をいう。）に当該終了の日の翌当社営業日に授受すべき損益差金に係る調整金を加減した額とする。）と同額の承継時支払金額を授受するものとする。この場合において、当該額が正数の場合には当社から承継清算参加者に承継時支払金額を支払い、当該額が負数の場合には承継清算参加者から当社に承継時支払金額を支払う。

2 当社、承継清算参加者及び申込清算参加者は、業務方法書第53条の4第4項第3号の規定に従い、前項の規定により算出した承継時支払金額及び期限前終了手数料を、承継申込清算約定の終了の日の翌当社営業日に変動証拠金等と差引計算して授受を行う。

3 前2項の規定は、当社が、業務方法書第58条の5第5項及び第7項の規定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場合に準用する。この場合において、第1項柱書中「第53条の4第1項」とあるのは「第58条の5第5項及び第7項」と、同項第2号中「承継清算参加者は」とあるのは「移管先清算参加者（受託外委託者承継（委託分）の場合には当該移管先清算委託者の受託清算参加者。以下本条において同じ。）は

該移管先清算委託者の受託清算参加者。以下本条において同じ。)は」と、「承継申込清算約定(業務方法書第58条の2第1項第1号に規定する承継の対象となる清算約定をいう。以下同じ。)」とあるのは「業務方法書第58条の5第4項第4号bの規定により終了する清算約定(委託分)(業務方法書第58条の4第1項第5号に規定する清算委託取引の移管の場合には業務方法書第58条の5第4項第5号bの規定により終了する清算約定(委託分)。以下本条において同じ。)」と、「承継元清算参加者」とあるのは「移管元清算委託者の受託清算参加者」と、「当該承継申込清算約定」とあるのは「業務方法書第58条の5第4項第4号bの規定により終了する清算約定(委託分)」と、「承継元清算参加者が」とあるのは「移管元清算委託者の受託清算参加者が」と、「承継清算参加者に」とあるのは「移管先清算参加者に」と、「承継清算参加者から」とあるのは「移管先清算参加者から」と、第2項中「承継清算参加者」とあるのは「移管元清算委託者の受託清算参加者」と、「承継元清算参加者」とあるのは「移管先清算参加者(業務方法書第58条の4第1項第5号に規定する清算委託取引の移管の場合には当該移管先清算委託者の受託清算参加者)」と、「業務方法書第58条の3第4項第1号c」とあるのは「業務方法書第58条の5第4項第4号c及び第5号c」と、「承継申込清算約定」とあるのは「業務方法書第58条の5第4項第4号bの規定により終了する清算約定(委託分)」と読み替えるものとする。

- 4 第1項及び第2項の規定は、当社が、業務方法書第58条の3第4項第3号cの規定により期限前終了手数料及び承継時等支払金額を算出する場合に準用する。この場合において、第1項柱書中「第58条の3第4項第1号c」とあるのは「第58条の3第4項第3

と、「承継申込清算約定(業務方法書第53条の4第1項に規定する承継申込清算約定をいう。以下同じ。)」とあるのは「業務方法書第58条の5第4項前段の規定により終了する清算約定(委託分)(受託外委託者承継(委託分)の場合には同条第6項前段の規定により終了する清算約定(委託分)。以下本条において同じ。)」と、「申込清算参加者(業務方法書第53条の3第1項に規定する申込清算参加者をいう。以下同じ。)」とあるのは「移管元清算委託者の受託清算参加者」と、「当該承継申込清算約定」とあるのは「業務方法書第58条の5第4項前段の規定により終了する清算約定(委託分)」と、「申込清算参加者が」とあるのは「移管元清算委託者の受託清算参加者が」と、「承継清算参加者に」とあるのは「移管先清算参加者に」と、「承継清算参加者から」とあるのは「移管先清算参加者から」と、第2項中「承継清算参加者」とあるのは「移管元清算委託者の受託清算参加者」と、「申込清算参加者」とあるのは「移管先清算参加者(受託外委託者承継(委託分)の場合には当該移管先清算委託者の受託清算参加者)」と、「業務方法書第53条の4第4項第3号」とあるのは「業務方法書第58条の5第5項及び第7項」と、「承継申込清算約定」とあるのは「同条第4項前段の規定により終了する清算約定(委託分)」と読み替えるものとする。

- 4 第1項及び第2項の規定は、当社が、業務方法書第58条の7第6項の規定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場合に準用する。この場合において、第1項柱書中「第53条の4第1項」とあるのは「第58条の7第6項」と、同項第2号中

号c」と、同項第2号中「承継清算参加者は」とあるのは「移管先清算委託者の受託清算参加者は」と、「承継申込清算約定（業務方法書第58条の2第1項第1号に規定する承継の対象となる清算約定をいう。以下同じ。）」とあるのは「業務方法書第58条の3第4項第3号bの規定により終了する清算約定（自己分）」と、「承継元清算参加者」とあるのは「移管元清算参加者」と、「当該承継申込清算約定」とあるのは「当該清算約定（自己分）」と、「承継元清算参加者が」とあるのは「移管元清算参加者が」と、「承継清算参加者に」とあるのは「移管先清算委託者の受託清算参加者に」と、「承継清算参加者から」とあるのは「移管先清算委託者の受託清算参加者から」と、第2項中「承継清算参加者」とあるのは「移管先清算委託者の受託清算参加者」と、「承継元清算参加者」とあるのは「移管元清算参加者」と、「業務方法書第58条の3第4項第1号c」とあるのは「業務方法書第58条の3第4項第3号c」と、「承継申込清算約定」とあるのは「業務方法書第58条の3第4項第3号bの規定により終了する清算約定（自己分）」と読み替えるものとする。

（清算約定（自己分）の承継により新たに発生する権利義務に関する事項）

第30条の6 業務方法書第58条の3第4項第1号a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。

（承継等に係る当社への申込み等に関する事項）

第30条の7 業務方法書第58条の2第4項及び同第58条の4第4項に規定する当社に対する申込みは、承継又は移管を希望する当社営業日の午前8時30分から午後3時までの間に金利スワップ取引清算業務システムを用いる方法又は当社が通知若しくは公示によ

「承継清算参加者は」とあるのは「移管先清算委託者の受託清算参加者は」と、「承継申込清算約定（業務方法書第53条の4第1項に規定する承継申込清算約定をいう。以下同じ。）」とあるのは「業務方法書第58条の7第4項後段の規定により終了する清算約定（自己分）」と、「申込清算参加者（業務方法書第53条の3第1項に規定する申込清算参加者をいう。以下同じ。）」とあるのは「移管元清算参加者」と、「当該承継申込清算約定」とあるのは「当該清算約定（自己分）」と、「申込清算参加者が」とあるのは「移管元清算参加者が」と、「承継清算参加者に」とあるのは「移管先清算委託者の受託清算参加者に」と、「承継清算参加者から」とあるのは「移管先清算委託者の受託清算参加者から」と、第2項中「承継清算参加者」とあるのは「移管先清算委託者の受託清算参加者」と、「申込清算参加者」とあるのは「移管元清算参加者」と、「業務方法書第53条の4第4項第3号」とあるのは「業務方法書第58条の7第6項」と、「承継申込清算約定」とあるのは「同条第4項後段の規定により終了する清算約定（自己分）」と読み替えるものとする。

（清算約定（自己分）の承継により新たに発生する権利義務に関する事項）

第30条の6 業務方法書第53条の4第2項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）

り定める方法により行うものとする。

2 業務方法書第58条の2第5項及び同第58条の4第5項に規定する当社からの通知の方法は、金利スワップ取引清算業務システムを用いる方法とする。

3 業務方法書第58条の2第6項及び同第58条の4第6項に規定する承継又は移管の申込みに対する承諾の通知は、当該申込みがあった当社営業日の午後3時までに、金利スワップ取引清算業務システムを用いて行うものとする。

4 業務方法書第58条の2第8項及び同第58条の4第8項に規定する承継又は移管の申込みの撤回の申告は、当社に対して承継又は移管の申込みを行った当社営業日の午後3時までに、金利スワップ取引清算業務システムを用いて行うものとする。

5 当社が業務方法書第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を算出し、当社に対して債務負担時所要証拠金の額を預託又は交付していることを確認する時点は、当該承継又は移管の申込みがあった当社営業日の午後4時とする。

(区分口座の変更に係る当社への申告等に関する事項)

第30条の8 業務方法書第59条の2第2項及び同第59条の3第2項に規定する、区分口座の変更に係る当社への申告は、当該変更を希望する当社営業日の午前8時30分から午後3時までの間に、金利スワップ取引清算業務システムを用いて行うものとする。

(新設)

2 業務方法書第59条の2第4項及び同第59条の3第4項に規定する、区分口座の変更に係る申告の撤回は、当該申告があった当社営業日の午後3時までに、金利スワップ取引清算業務システムを用いて行うものとする。

3 業務方法書第59条の2第3項及び同第59条の3第3項に規定する、区分口座の変更に

行う時点は、申告があった当社営業日の午後4時とする。

(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5第4項第1号cに規定する期限前終了手数料及び承継時等支払金額は、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。

(1) (略)

(2) 当社、承継清算参加者及び清算委託者は、承継申込清算約定(業務方法書第58条の4第1項第1号に規定する承継の対象となる清算約定をいう。以下同じ。)の終了日までに清算委託者が承継元清算参加者に預託した変動証拠金の差引累計額に当該終了の日の翌当社営業日に授受すべき変動証拠金に係る利息を加減した額(当該承継申込清算約定が清算約定(決済型)である場合には、当該終了日までに承継元清算参加者が当社に交付した損益差金の差引累計額(損益差金の総支払額から総受取額を控除した額をいう。)に当該終了の日の翌当社営業日に授受すべき損益差金に係る調整金を加減した額とする。)と同額の承継時等支払金額を授受するものとする。この場合において、当該額が正数の場合には当社から承継清算参加者及び承継清算参加者から清算委託者に承継時等支払金額を支払い、当該額が負数の場合には清算委託者から承継清算参加者及び承継清算参加者から当社に承継時等支払金額を支払う。

2 当社、承継清算参加者、承継元清算参加者及び清算委託者は、業務方法書第58条の5第4項第1号cの規定に従い、前項の規定により算出した承継時等支払金額及び期限前終了手数料を、承継申込清算約定の終了の日の翌当社営

(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。

(1) (略)

(2) 当社、承継清算参加者及び清算委託者は、対象清算約定(業務方法書第58条の2第3項に規定する対象清算約定をいう。以下同じ。)の終了日までに清算委託者が承継元清算参加者に預託した変動証拠金の差引累計額に当該終了の日の翌当社営業日に授受すべき変動証拠金に係る利息を加減した額(当該承継申込清算約定が清算約定(決済型)である場合には、当該終了日までに申込清算参加者が当社に交付した損益差金の差引累計額(損益差金の総支払額から総受取額を控除した額をいう。)に当該終了の日の翌当社営業日に授受すべき損益差金に係る調整金を加減した額とする。)と同額の承継時支払金額を授受するものとする。この場合において、当該額が正数の場合には当社から承継清算参加者及び承継清算参加者から清算委託者に承継時支払金額を支払い、当該額が負数の場合には清算委託者から承継清算参加者及び承継清算参加者から当社に承継時支払金額を支払う

2 当社、承継清算参加者、承継元清算参加者及び清算委託者は、業務方法書第58条の3第4項第3号の規定に従い、前項の規定により算出した承継時支払金額及び期限前終了手数料を、対象清算約定の終了の日の翌当社営業日に変

業日に変動証拠金等と差引計算して授受を行う。

(清算約定(委託分)の承継により新たに発生する権利義務に関する事項)

第35条の4 業務方法書第58条の5第4項第1号a(a)及び(b)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。

(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4項第1号b、第2号並びに第3号a(a)及びb並びに同第58条の5第4項第1号b、第2号、第3号b、第4号b及び第5号b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。

(1)・(2) (略)

(清算委託取引又は清算約定(自己分)の移管により新たに発生する権利義務に関する事項)

第35条の4の3 業務方法書第58条の3第4項第3号a(b)並びに同第58条の5第4項第4号a及び第5号a(b)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。

(承継又は移管が行われた場合の債務負担時所要証拠金に関する事項)

第35条の4の4 業務方法書第58条の3第1項に定める債務負担時所要証拠金が当社に預託又は交付されていることの確認にあつ

動証拠金等と差引計算して授受を行う。

(清算約定(委託分)の承継により新たに発生する権利義務に関する事項)

第35条の4 業務方法書第58条の3第2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。

(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53条の4第3項、同第58条の3第3項、同第58条の5第4項及び第6項並びに同第58条の7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53条の4第1項、同第58条の3第1項、同第58条の5第1項及び同第58条の7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。

(1)・(2) (略)

(清算委託取引又は清算約定(自己分)の移管により新たに発生する権利義務に関する事項)

第35条の4の3 業務方法書第58条の5第4項及び第6項並びに第58条の7第4項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。

(承継又は移管が行われた場合の債務負担時所要証拠金に関する事項)

第35条の4の4 業務方法書第58条の3第1項に定める債務負担時所要証拠金が当社に預託又は交付されていることの確認にあつ

ては、移管先清算委託者に係る委託取引口座に
充当されているカスタマーバッファーの額を
預託額に含めて、不足額の確認を行う。

- 2 業務方法書第58条の5第1項に定める債
務負担時所要証拠金が当社に預託又は交付さ
れていることの確認にあたっては、次の各号に
掲げる承継又は移管の区分に応じて、当該各号
に掲げるカスタマーバッファーの額を預託額
に含めて、不足額の確認を行う。

(1) 業務方法書第58条の4第1項第1号
に規定する清算約定（委託分）の承継 承継
元清算参加者及び承継清算参加者のそれぞ
れについて、承継の対象となる清算約定（委
託分）に係る委託取引口座に充当されている
カスタマーバッファーの額

(2) 業務方法書第58条の4第1項第2号
から第5号までに規定する清算委託取引の
移管 移管元清算委託者（移管先清算委託者
に対して移管する場合には当該移管先清算
委託者を含む。）に係る委託取引口座に充当
されているカスタマーバッファーの額

（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（担保型）の清算約定（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（担保型）ごとに、当該各号に定
める方法とする。

(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51条の2第2項の規定に従い当社が資
金決済化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、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

ては、承継清算参加者及び承継元清算参加者の
それぞれについて、承継の対象となる清算約定
（委託分）に係る委託取引口座に充当されてい
るカスタマーバッファーの額を預託額に含め
て、不足額の確認を行う。

- 2 業務方法書第58条の5第1項に定める債
務負担時所要証拠金が当社に預託又は交付さ
れていることの確認にあたっては、移管元清算
委託者（移管先清算委託者に対して移管する場
合には当該移管先清算委託者を含む。）に係る
委託取引口座に充当されているカスタマーバ
ッファーの額を預託額に含めて、不足額の確認
を行う。

- 3 業務方法書第58条の7第1項に定める債
務負担時所要証拠金が当社に預託又は交付さ
れていることの確認にあたっては、移管先清算
委託者に係る委託取引口座に充当されている
カスタマーバッファーの額を預託額に含めて、
不足額の確認を行う。

（変動証拠金所要額）

第38条 業務方法書第78条第1項に規定す
る当社が定める変動証拠金所要額の算出方法
及び同条第2項に規定する当社が定める清算
約定（担保型）の清算約定（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（担保型）ごとに、当該各号に定
める方法とする。

(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5
1条の2第2項の規定に従い当社が資金決
済化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、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

ときは、当該確認を行った時点、業務方法書第53条の2第2項の規定に従い当社がクーポン・ブレンディング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、業務方法書第53条の2の3第2項の規定に従い当社が参加者提案型コンプレッション成立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、業務方法書第53条の2の4第4項の規定に従い当社がJSCC提案型コンプレッション成立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、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。以下本号及び次条において同じ。)における清算約定(担保型)の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ロード・カーブに基づいて当該算出日の午後4時の時点における清算約定(担保型)の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)～(4) (略)

2・3 (略)

(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)～(11) (略)

(12) 業務方法書第58条の3第4項第1号c及び第3号c並びに同第58条の5第4項第1号c、第4号c及び第5号cに規定する期限前終了手数料及び承継時等支払金額(円貨建清算約定に係るものに限る。)

2～4 (略)

(外貨による資金決済)

確認を行った時点、業務方法書第53条の2第2項の規定に従い当社がクーポン・ブレンディング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、業務方法書第53条の2の3第2項の規定に従い当社が参加者提案型コンプレッション成立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、業務方法書第53条の2の4第4項の規定に従い当社がJSCC提案型コンプレッション成立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、業務方法書第53条の4第1項、同第58条の3第1項、同第58条の5第1項又は同第58条の7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。以下本号及び次条において同じ。)における清算約定(担保型)の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ロード・カーブに基づいて当該算出日の午後4時の時点における清算約定(担保型)の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)～(4) (略)

2・3 (略)

(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)～(11) (略)

(12) 業務方法書第53条の4第1項、第58条の3第1項、第58条の5第5項及び第7項並びに第58条の7第6項に規定する期限前終了手数料及び承継時支払金額(円貨建清算約定に係るものに限る。)

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hまでに掲げる金銭

a～g (略)

h 業務方法書第58条の3第4項第1号c及び第3号c並びに同第58条の5第4項第1号c、第4号c及び第5号cに規定する期限前終了手数料及び承継時等支払金額（円貨建清算約定に係るものを除く。）

(2) (略)

2～5 (略)

付 則

1 この改正規定は、令和7年10月6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、令和7年10月6日以後の当社が定める日から施行する。

別表2 当初証拠金所要額の算出方法

1 当初証拠金所要額

(1) 清算約定（自己分）に係る当初証拠金所要額（次号に規定する場合以外の場合）

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

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hまでに掲げる金銭

a～g (略)

h 業務方法書第53条の4第1項、第58条の3第1項、第58条の5第5項及び第7項並びに第58条の7第6項に規定する期限前終了手数料及び承継時支払金額（円貨建清算約定に係るものを除く。）

(2) (略)

2～5 (略)

別表2 当初証拠金所要額の算出方法

1 当初証拠金所要額

(1) 清算約定（自己分）に係る当初証拠金所要額（次号に規定する場合以外の場合）

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、業務方法書第53条の2第2項の規定に従い当社がクーポン・ブレンディング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、業務方法書第53条の2の3第2項の規定に従い当社が参加者提案型コンプレッション成立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、業務方法書第53条の2の4第4項の規定に従い当社がJ S C C提案型コンプレッション成立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、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、当該承諾の時点を用いる。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つては、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並びに当該算出日の午後6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及び金利先物取引の建玉の同日の清算数値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用いる。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。

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、業務方法書第53条の2第2項の規定に従い当社がクーポン・ブレンディング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、業務方法書第53条の2の3第2項の規定に従い当社が参加者提案型コンプレッション成立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、業務方法書第53条の2の4第4項の規定に従い当社がJ S C C提案型コンプレッション成立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、業務方法書第53条の4第1項、同第58条の3第1項、同第58条の5第1項又は同第58条の7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、当該承諾の時点を用いる。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つては、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並びに当該算出日の午後6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及び金利先物取引の建玉の同日の清算数値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用いる。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

(a)・(b) (略)
b～h (略)
(1)の2～(4) (略)
2・3 (略)

様式第3号 清算受託契約の様式（日本語）

金利スワップ清算受託契約書

（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 乙は、業務方法書等の定めに従い、承継清算参加者を經由してクリアリング機構に承継の申込みを行い、当該承継の申込みをクリアリング機構が承諾した場合には、乙が承継清算参加者への承継を希望する委託清算約定（以下「対象委託清算約定」という。）に係る次に掲げる権利義務を一括して承継清算参加者に承継させることができる。

(1) 甲及びクリアリング機構の間の対象委託清算約定に係る権利義務（第6項の規定により対象委託清算約定が終了する直前のもの）と業務方法書等の定める条件が同一となる権利義務

(2) 甲及び乙の間の本清算委託取引に係る権利義務（第6項の規定により対象委託清算約定に係る本清算委託取引が終了する直前のもの）と業務方法書等の定める条件が同一となる権利義務

2 乙は、同一の委託取引口座における委託清算約定の全部について承継する場合に限り、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の全部又は一部を、承継清算参加者に担保移管することができる。

3 甲及び乙は、第1項の規定により、承継が成立した場合には、当該承継の時点で、前項の規定により担保移管の申込みがあった当初証拠金は、承継清算参加者を代理人としてクリアリ

場合には、当該額を臨時に変更することができる。

(a)・(b) (略)
b～h (略)
(1)の2～(4) (略)
2・3 (略)

様式第3号 清算受託契約の様式（日本語）

金利スワップ清算受託契約書

（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 乙は、業務方法書等の定めに従い、承継清算参加者を經由してクリアリング機構にクリアリング機構所定の承継申込書を交付し、当該承継の申込みをクリアリング機構が承諾した場合には、乙が承継清算参加者への承継を希望する委託清算約定（以下「対象委託清算約定」という。）に係る次に掲げる権利義務を一括して承継清算参加者に承継させることができる。

(1) 甲及びクリアリング機構の間の対象委託清算約定に係る権利義務（第5項の規定により対象委託清算約定が終了する直前のもの）と業務方法書等の定める条件が同一となる権利義務

(2) 甲及び乙の間の本清算委託取引に係る権利義務（第5項の規定により対象委託清算約定に係る本清算委託取引が終了する直前のもの）と業務方法書等の定める条件が同一となる権利義務

（新設）

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

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。

4 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(第2項の規定により担保移管する場合は、当該担保移管に係る申込みを含む。以下、本条において同じ)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。

5 (略)

6 (略)

(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 乙の有価証券等清算取次ぎの委託に基づき乙の計算において成立している他の清算参加者(乙との間で清算受託契約を締結している清算参加者に限る。以下本条において「承継元清算参加者」という。)の清算約定(委託分)その他業務方法書等に定める権利義務(以下「承継対象清算約定等」という。)について、業務方法書等の定めるところにより、乙が

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。

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。

4 (略)

5 (略)

(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 乙の有価証券等清算取次ぎの委託に基づき乙の計算において成立している他の清算参加者(乙との間で清算受託契約を締結している清算参加者に限る。以下本条において「承継元清算参加者」という。)の清算約定(委託分)その他業務方法書等に定める権利義務(以下「承継対象清算約定等」という。)について、業務方法書等の定めるところにより、乙が

甲に対して当該承継対象清算約定等の承継の申込みをし、甲がこれを承諾しクリアリング機構に対して承継の申込みを行った場合には、甲は、業務方法書等の定めるところにより、当該承継対象清算約定等を承継する。

2 乙は、自らの計算により成立している他の清算参加者の清算約定（委託分）の全部について承継する場合に限り、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の全部又は一部について、甲に担保移管することができる。

3 甲は、第1項の規定により承継元清算参加者の承継対象清算約定等を承継（前項の規定により担保移管する場合は、当該担保移管を含む。以下本条において同じ。）する旨を承諾する場合には、承継を希望するJ S C C営業日の午後3時までに、クリアリング機構に対して、当該承継の申込みを行わなければならない。

4 （略）

5 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には、当該承継の時点で、第2項の規定により担保移管の申込みがあった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。

甲に対して当該承継対象清算約定等の承継の申込みをし、甲がこれを承諾しクリアリング機構に対して承継申込書を提出した場合には、甲は、業務方法書等の定めるところにより、当該承継対象清算約定等を承継する。

（新設）

2 甲は、前項の規定により承継元清算参加者の承継対象清算約定等を承継する旨を承諾し、かつ乙から業務方法書等の定めるところにより承継申込書の交付を受けた場合には、承継を希望するJ S C C営業日の午後1時までに、クリアリング機構に対して、当該承継申込書（甲が当該承継の申込みを受けた旨、当該承諾をした旨及びクリアリング機構に承継の申込みをする旨並びに乙が承継元清算参加者に対して当該承継について通知をした旨及びクリアリング機構に承継の申込みをする旨が記載されていることを要する。）を提出しなければならない。

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。

| | |
|---|--|
| <p>(甲、甲以外の清算参加者又は他の清算委託者への本清算委託取引の移管)</p> <p>第 28 条の 5 (略)</p> <p><u>2 乙は、本清算委託取引の全部について移管する場合に限り、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の全部または一部を、甲以外の清算参加者又は移管先清算委託者に担保移管することができる。</u></p> <p><u>3 (略)</u></p> <p>(甲からの清算約定の移管)</p> <p>第 28 条の 6 の 2 (略)</p> <p><u>2 甲は、自らの計算により成立している清算約定 (自己分) の全部について移管する場合に限り、第 17 条の規定により甲が返還請求権を有する当初証拠金の全部又は一部について、乙に担保移管することができる。</u></p> <p><u>3 (略)</u></p> <p>(他の清算参加者からの清算約定の移管)</p> <p>第 28 条の 6 の 3 (略)</p> <p><u>2 乙は、移管元清算参加者が返還請求権を有する当初証拠金の全部又は一部に係る乙への担保移管を受けることができる。</u></p> <p><u>3 (略)</u></p> | <p>(甲、甲以外の清算参加者又は他の清算委託者への本清算委託取引の移管)</p> <p>第 28 条の 5 (略)</p> <p>(新設)</p> <p><u>2 (略)</u></p> <p>(甲からの清算約定の移管)</p> <p>第 28 条の 6 の 2 (略)</p> <p>(新設)</p> <p><u>2 (略)</u></p> <p>(他の清算参加者からの清算約定の移管)</p> <p>第 28 条の 6 の 3 (略)</p> <p>(新設)</p> <p><u>2 (略)</u></p> |
| <p>様式第 3 号の 2 清算受託契約の様式 (英語)</p> <p>Interest Rate Swap Clearing Brokerage Agreement</p> <p>Article 8. Payments and Receipts of Settlement Amount</p> <p>1 (Omitted)</p> <p>2 When Party A receives Settlement Amount from JSCC in connection with Cleared Contracts subject to Brokerage, Party A shall pay to Party B Cash in the amount equivalent to the Settlement Amount by the time agreed between Party A and Party B, or, promptly, absent such</p> | <p>様式第 3 号の 2 清算受託契約の様式 (英語)</p> <p>Interest Rate Swap Clearing Brokerage Agreement</p> <p>Article 8. Payments and Receipts of Settlement Amount</p> <p>1 (Omitted)</p> <p>2 When Party A receives Settlement Amount from JSCC in connection with Cleared Contracts subject to Brokerage, Party A shall pay to Party B Cash in the amount equivalent to the Settlement Amount by the time agreed between <u>by</u> Party A and Party B, or, promptly, absent</p> |

agreement, and in the manner agreed between Party A and Party B.

Article 28-3. Position Transfer of Subject Clearing Brokerage Contract to Other Clearing Participant

1 Subject to the provisions of the Rules, Party B may transfer the below listed claims and obligations under the Cleared Contracts subject to Brokerage with respect to which Party B desires a Position Transfer to the Successor Clearing Broker ("Relevant Cleared Contract subject to Brokerage") entirely to the Successor Clearing Broker by requesting Position Transfer to JSCC via Successor Clearing Broker, and if JSCC accepts such request for Position Transfer:

- (1) Claims and obligations of which the terms and conditions designated in the Rules are identical to the claims and obligations under to the Relevant Cleared Contract subject to Brokerage between Party A and JSCC existing immediately before the termination of the Relevant Cleared Contract subject to Brokerage pursuant to the provision of Paragraph 6 below; and
- (2) Claims and obligations of which the terms and conditions designated in the Rules are identical to the claims and obligations under the Subject Clearing Brokerage Contract between Party A and Party B existing immediately before the termination of the Subject Clearing Brokerage Contract corresponding to the Relevant Cleared Contract subject to Brokerage pursuant to the provision of Paragraph 6 below.

2 Only in the case of Position Transfer of all of

such agreement, and in the manner agreed between Party A and Party B.

Article 28-3. Position Transfer of Subject Clearing Brokerage Contract to Other Clearing Participant

1 Subject to the provisions of the Rules, Party B may transfer the below listed claims and obligations under the Cleared Contracts subject to Brokerage with respect to which Party B desires a Position Transfer to the Successor Clearing Broker ("Relevant Cleared Contract subject to Brokerage") entirely to the Successor Clearing Broker by delivering Position Transfer Request in the form prescribed by JSCC to JSCC via Successor Clearing Broker, and if JSCC accepts such request for Position Transfer:

- (1) Claims and obligations of which the terms and conditions designated in the Rules are identical to the claims and obligations under to the Relevant Cleared Contract subject to Brokerage between Party A and JSCC existing immediately before the termination of the Relevant Cleared Contract subject to Brokerage pursuant to the provision of Paragraph 5 below; and
- (2) Claims and obligations of which the terms and conditions designated in the Rules are identical to the claims and obligations under the Subject Clearing Brokerage Contract between Party A and Party B existing immediately before the termination of the Subject Clearing Brokerage Contract corresponding to the Relevant Cleared Contract subject to Brokerage pursuant to the provision of Paragraph 5 below.

(Newly specified)

the Cleared Contracts subject to Brokerage in the same Customer Account, Party B may conduct Collateral Transfer of all or a part of Initial Margin to which it has the right to claim return pursuant to the provisions of Article 17 to the Successor Clearing Broker.

3 Party A and Party B hereby agree in advance that, when Position Transfer becomes effective pursuant to the provisions of Paragraph 1, Initial Margin of which Collateral Transfer is requested pursuant to the provisions of Paragraph 2 above will be deemed as Initial Margin that has been deposited with JSCC by Party B via the Successor Clearing Broker as agent at the time of such Position Transfer.

4 When Party B makes request of Position Transfer (and request of Collateral Transfer when conducting Collateral Transfer pursuant to the provisions of Paragraph 2; the same applies in this Article) to JSCC pursuant to the provision of Paragraph 1, Party B shall request the Successor Clearing Broker to accept such Position Transfer and obtain its consent in advance. Then, Party B shall notify Party A to the effect that it will request such Position Transfer. In this case, Party B shall deposit and pay to Party A the Margin Required to Clear related to the Cleared Contract subject to Brokerage to be paid or received in association with the Position Transfer and other amount to be paid or received between Party A and Party B in relation to the Cleared Contract subject to

2 Party A and Party B hereby agree in advance that, when the claims and obligations listed in Paragraph 1 related to all Cleared Contracts subject to Brokerage for Party B are transferred to the Successor Clearing Broker pursuant to the provision of Paragraph 1, Initial Margin in which Party B has the right to claim return pursuant to the provision of Article 17 of this Agreement will be deemed as Initial Margin that has been deposited with JSCC by Party B via the Successor Clearing Broker as agent at the time of such Position Transfer, except for those for which notification to the effect of treating it as Initial Margin deposited with JSCC through Party A acting as agent has been given pursuant to the provisions of the Rules.

3 When Party B makes request to JSCC of the Position Transfer pursuant to the provision of Paragraph 1, Party B shall request the Successor Clearing Broker to accept such Position Transfer and obtain its consent in advance. Then, Party B shall notify Party A to the effect that it will request such Position Transfer. In this case, Party B shall deposit and pay to Party A the Margin Required to Clear related to the Cleared Contract subject to Brokerage to be paid or received in association with the Position Transfer and other amount to be paid or received between Party A and Party B in relation to the Cleared Contract subject to Brokerage pursuant to the provisions of the Rules, excluding Initial Margin deemed to have been deposited with JSCC via the Successor

Brokerage pursuant to the provisions of the Rules, excluding Initial Margin deemed to have been deposited with JSCC via the Successor Clearing Broker acting as agent pursuant to the provision of Paragraph 2, by the date and time agreed between Party A and Party B that is at or before the cut-off time for delivery to JSCC, in the manner agreed between Party A and Party B.

5 (Omitted)

6 (Omitted)

Article 28-4. Position Transfer of Clearing Brokerage Contracts from other Clearing Participant

1 When Party B requests the Position Transfer of the Customer's Cleared Contracts of Party B's another Clearing Broker coming into effect as a result of its Clearing Brokerage for Party B (referred to as "Carrying Clearing Broker" in this Article) and other claims and obligations set forth in the Rules ("Position Transfer Cleared Contracts" (*shoukei taishou seisan yakujou tou*)) to Party A, and Party A accepts such request and submits such request to JSCC pursuant to the provisions of the Rules, the Position Transfer of the Position Transfer Cleared Contracts to Party A shall come into effect pursuant to the provisions of the Rules.

2 Only in the case of Position Transfer of all of the Customer's Cleared Contracts on Party B's book at another Clearing Participant, Party B may conduct Collateral Transfer of all or a part of Initial Margin to which it has the right to claim return pursuant to the provisions of the Clearing Brokerage Agreement between Party B and the Carrying Clearing Broker to Party A.

3 When Party A accepts the Position Transfer (and the Collateral Transfer when conducting

Clearing Broker acting as agent pursuant to the provision of Paragraph 2, by the date and time agreed between Party A and Party B that is at or before the cut-off time for delivery to JSCC, in the manner agreed between Party A and Party B.

4 (Omitted)

5 (Omitted)

Article 28-4. Position Transfer of Clearing Brokerage Contracts from other Clearing Participant

1 When Party B requests the Position Transfer of the Customer's Cleared Contracts of Party B's another Clearing Broker coming into effect as a result of its Clearing Brokerage for Party B (referred to as "Carrying Clearing Broker" in this Article) and other claims and obligations set forth in the Rules ("Position Transfer Cleared Contracts" (*shoukei taishou seisan yakujou tou*)) to Party A, and Party A accepts such request and submits such request form to JSCC pursuant to the provisions of the Rules, the Position Transfer of the Position Transfer Cleared Contracts to Party A shall come into effect pursuant to the provisions of the Rules.

(Newly specified)

2 When Party A accepts the Position Transfer pursuant to the provision of Paragraph 1 and

Collateral Transfer pursuant to the provisions of Paragraph 2; the same applies in this Article) pursuant to the provision of Paragraph 1, it shall request the Position Transfer to JSCC by 3:00 p.m. on the JSCC Business Day which is the desired date of Position Transfer.

4 (Omitted)

5 Party A and Party B hereby agree in advance that if the Carrying Clearing Broker's Position Transfer Cleared Contracts are transferred to Party A pursuant to the provision of Paragraph 1 and the claims and obligations arising from all Customer's Cleared Contracts are transferred, the Initial Margin of which Collateral Transfer is requested pursuant to the provisions of Paragraph 2 shall be deemed as Initial Margin deposited with JSCC by Party B via Party A acting as its agent at the time of such Position Transfer.

Article 28-5. Transfer of Subject Clearing Brokerage Contracts to Party A, Other Clearing Participant or Other Customer

1 Subject to the provisions of the Rules, Party B may Transfer the Subject Clearing Brokerage Contracts to Party A, any other Clearing

has received the request form therefor from Party B in accordance with the Rules, it shall submit such request form to JSCC by 1:00 p.m. on the JSCC Business Day which is the desired date of Position Transfer. Such request form shall state, among other things, the effect that Party A has received the request to accept the Position Transfer, it has consented to accept such Position Transfer and it is submitting the request form for such Position Transfer to JSCC; and that Party B notified the Carrying Clearing Broker of such Position Transfer and Party B requests the Position Transfer to JSCC.

3 (Omitted)

4 Party A and Party B hereby agree in advance that if the Carrying Clearing Broker's Position Transfer Cleared Contracts are transferred to Party A pursuant to the provision of Paragraph 1 and the claims and obligations arising from all Customer's Cleared Contracts are transferred, the Initial Margin in which Party B has the right to claim return pursuant to the provisions of the Clearing Brokerage Agreement between Party B and the Carrying Clearing Broker shall be deemed as Initial Margin deposited with JSCC by Party B via Party A acting as its agent at the time of such Position Transfer, except for those for which notification to the effect of treating it as Initial Margin deposited with JSCC through Carrying Clearing Broker acting as agent has been given pursuant to the provisions of the Rules.

Article 28-5. Transfer of Subject Clearing Brokerage Contracts to Party A, Other Clearing Participant or Other Customer

1 Subject to the provisions of the Rules, Party B may Transfer the Subject Clearing Brokerage Contracts to Party A, any other Clearing

| | |
|---|--|
| Participant (referred to as “Transferee Clearing Participant” in this Article) or any other Customer (seisan itakusha) (referred to as “Transferee Customer” in this Article). | Participant (referred to as “Transferee Clearing Participant” in this Article) or any other Customer (seisan itakusha) (referred to as “Transferee Customer in this Article”). |
| <u>2 Only in the case of Transfer of all of the Subject Clearing Brokerage Contracts, Party B may conduct Collateral Transfer of all or a part of Initial Margin to which Party B has the right to claim return pursuant to the provisions of Article 17 to another Clearing Participant or a Receiving Customer.</u> | (Newly specified) |
| <u>3 (Omitted)</u> | <u>2 (Omitted)</u> |
| Article 28-6-2. Transfer of Cleared Contracts from Party A | Article 28-6-2. Transfer of Cleared Contracts from Party A |
| 1 (Omitted) | 1 (Omitted) |
| <u>2 Only in the case of Transfer of all of the Proprietary Cleared Contracts on its book, Party A may conduct Collateral Transfer of all or a part of Initial Margin to which it has the right to claim return pursuant to the provisions of Article 17 to Party B.</u> | (Newly specified) |
| <u>3 (Omitted)</u> | <u>2 (Omitted)</u> |
| Article 28-6-3. Transfer of Cleared Contracts from Other Clearing Participant | Article 28-6-3. Transfer of Cleared Contracts from Other Clearing Participant |
| 1 (Omitted) | 1 (Omitted) |
| <u>2 Party B may accept Collateral Transfer to Party B of all or a part of Initial Margin to which the Transferring Clearing Participant has the right to claim return.</u> | (Newly specified) |
| <u>3 (Omitted)</u> | <u>2 (Omitted)</u> |
| Article 29. Event of Default | Article 29. Event of Default |
| 1 An occurrence of any of the following events shall constitute an Event of Default in respect of Party B: | 1 An occurrence of any of the following events shall constitute an Event of Default in respect of Party B: |
| (1) • (2) (Omitted) | (1) • (2) (Omitted) |
| (3) Bankruptcy and other similar events: | (3) Bankruptcy and other similar events: |

a.~ c. (Omitted)

d. If a petition is filed in respect of Party B for commencement of proceedings seeking an insolvency or determination of bankruptcy or other relief under the laws concerning bankruptcy or insolvency or other similar laws affecting the rights of creditors, including a petition for commencement or acknowledgment of the bankruptcy proceedings, rehabilitation proceedings, reorganization proceedings, special liquidation (tokubetsu seisan) or foreign bankruptcy proceedings or equivalent proceedings under laws and regulations of a foreign country against Party B, or if a petition for dissolution or liquidation of Party B is filed;

e.~ i. (Omitted)

(4) (Omitted)

2・3 (Omitted)

Article 31. Return of Customer Initial Margin upon Termination of Subject Clearing Brokerage Contracts

1 If all Subject Clearing Brokerage Contracts are terminated pursuant to the provision of Article 30.2 or 30.3 of this Agreement, Party A shall immediately return to Party B Customer Initial Margin deposited by Party B, provided that Party B may not request the return of Customer Initial Margin from Party A until the settlement of all Subject Clearing Brokerage Contracts and Cross Margined JGB Futures Cleared Contracts and Cross Margined Interest Rate Futures Cleared Contracts recorded on Party B Clearing Brokerage Account is completed under the provision of Article 26.1 of this Agreement, except for the case where the claims and obligations in Customer Initial

a.~ c. (Omitted)

d. If a petition is filed in respect of Party B for commencement of proceedings seeking a insolvency or determination of bankruptcy or other relief under the laws concerning bankruptcy or insolvency or other similar laws affecting the rights of creditors, including a petition for commencement or acknowledgment of the bankruptcy proceedings, rehabilitation proceedings, reorganization proceedings, special liquidation (tokubetsu seisan) or foreign bankruptcy proceedings or equivalent proceedings under laws and regulations of a foreign country against Party B, or if a petition for dissolution or liquidation of Party B is filed;

e.~ i. (Omitted)

(4) (Omitted)

2・3 (Omitted)

Article 31. Return of Customer Initial Margin upon Termination of Subject Clearing Brokerage Contracts

1 If all Subject Clearing Brokerage Contracts are terminated pursuant to the provision of Article 30.2 or 30.3 of this Agreement, Party A shall immediately return to Party B Customer Initial Margin deposited by Party B, provided that Party B may not request the return of Customer Initial Margin from Party A until the settlement of all Subject Clearing Brokerage Contracts and Cross Margined JGB Futures Cleared Contracts and Cross Margined Interest Rate Futures Cleared Contracts recorded on Party B Clearing Brokerage Account is completed under the provision of Article 26.1 of this Agreement. This proviso shall not affect the settlement of the claims and obligations in

Margin are settled pursuant to the provision of Article 32 below.

2 · 3 (Omitted)

Article 34. Position Transfer of Outstanding Contracts

1 (Omitted)

2 Party A and Party B hereby agree in advance that when the Outstanding Contracts are transferred to the Successor Clearing Broker(s) pursuant to the provision of Paragraph 1, Initial Margin in which Party B has the right to claim the return pursuant to the provision of Article 17 of this Agreement shall be deemed as Initial Margin deposited with JSCC through the Successor Clearing Broker(s) acting as agent for Party B at the time of such Position Transfer.

3 · 4 (Omitted)

Article 35. Close-Out Netting of Subject Clearing Brokerage Contracts if Outstanding Contracts are not Transferred

1~5 (Omitted)

6 For the purpose of Paragraph 5, where Customer Initial Margin is deposited in the form of Eligible Securities Collateral, unless otherwise agreed between Party A and Party B, Party A shall return Cash in the amount equivalent to the market value of Eligible Securities Collateral used to determine the appraisal value of the Eligible Securities Collateral as of the Initial Loss-Determination Date in relation to the Default of Party A ("Initial Loss-Determination Date") in lieu of returning the Eligible Securities Collateral.

7 If the Subject Clearing Brokerage Contracts are terminated pursuant to the provision of Paragraph 1, all monetary obligations outstanding between Party A and Party B under

Customer Initial Margin pursuant to the provision of Article 32 below.

2 · 3 (Omitted)

Article 34. Position Transfer of Outstanding Contracts

1 (Omitted)

2 Party A and Party B hereby agree in advance that when the Outstanding Contracts are transferred to the Successor Clearing Broker(s) pursuant to the provision of Paragraph 1, Initial Margin in which Party B has the right to claim the return pursuant to the provision of Article 17 of this Agreement shall be deemed as Initial Margin deposited with JSCC through the Successor Clearing Broker(s) acting as agent for part B at the time of such Position Transfer.

3 · 4 (Omitted)

Article 35. Close-Out Netting of Subject Clearing Brokerage Contracts if Outstanding Contracts are not Transferred

1~5 (Omitted)

6 For the purpose of Paragraph 3, where Customer Initial Margin is deposited in the form of Eligible Securities Collateral, unless otherwise agreed between Party A and Party B, Party A shall return Cash in the amount equivalent to the market value of Eligible Securities Collateral used to determine the appraisal value of the Eligible Securities Collateral as of the Initial Loss-Determination Date in relation to the Default of Party A ("Initial Loss-Determination Date") in lieu of returning the Eligible Securities Collateral.

7 If the Subject Clearing Brokerage Contracts are terminated pursuant to the provision of Paragraph 1, all monetary obligations outstanding between Party A and Party B under

this Agreement as of the Initial Loss-Determination Date shall be settled as set forth below. Such monetary obligations shall include the obligations to pay the Early Termination Amount as a result of termination of the Subject Clearing Brokerage Contracts pursuant to the provision of Paragraph 1, which include, if the Cross Margined JGB Futures Cleared Contracts or Cross Margined Interest Rate Futures Cleared Contracts are recorded on the Party B Clearing Brokerage Account, the payment obligation existing between Party A and Party B in respect to the legal relationship having the same economic effect as the Subject Clearing Brokerage Contracts that will come into existence pursuant to the provision of Article 28-9.1 of this Agreement (where Paragraph 3 applies, other than the payment obligations related to the Post-Default Allocated Profit and Loss set forth in Paragraph 3; the same applies in this Paragraph), the obligations to return Variation Margin pursuant to the provision of Paragraph 4, the obligations to return Customer Initial Margin pursuant to the provisions of Paragraphs 5 and 6, the obligations to pay Fixed Amount and Floating Amount that remain unpaid, if any, and any and all other monetary obligations outstanding between Party A and Party B:

(1)~(4) (Omitted)

(5) As a result of netting pursuant to the provision of Item (1), if the Party A's Obligations at Initial Loss-Determination Date remain, the sum of that remaining amount and the amount of the obligation to return Customer Initial Margin pursuant to the provisions of Paragraphs 5 and 6 shall constitute the obligations of Party A owed to Party B arising from the termination of all

this Agreement as of the Initial Loss-Determination Date shall be settled as set forth below. Such monetary obligations shall include the obligations to pay the Early Termination Amount as a result of termination of the Subject Clearing Brokerage Contracts pursuant to the provision of Paragraph 1, which include, if the Cross Margined JGB Futures Cleared Contracts or Cross Margined Interest Rate Futures Cleared Contracts are recorded on the Party B Clearing Brokerage Account, the payment obligation existing between Party A and Party B in respect to the legal relationship having the same economic effect as the Subject Clearing Brokerage Contracts that will come into existence pursuant to the provision of Article 28-9.1 of this Agreement (where Paragraph 3 applies, other than the payment obligations related to the Post-Default Allocated Profit and Loss set forth in Paragraph 3; the same applies in this Paragraph), the obligations to return Variation Margin pursuant to the provision of Paragraph 4, the obligations to return Customer Initial Margin pursuant to the provisions of Paragraphs 5 and 6, the obligations to pay Fixed Amount and Floating Amount that remain unpaid, if any, and any and all other monetary obligations outstanding between Party A and Party B:

(1)~(4) (Omitted)

(5) As a result of netting pursuant to the provision of Item (1), if the Party A's Obligations at Initial Loss-Determination Date remain, the sum of that remaining amount and the amount of the obligation to return Customer Initial Margin pursuant to the provisions of Paragraphs 3 and 4 shall constitute the obligations of Party A owed to Party B arising from the termination of all Subject Clearing

| | |
|--|--|
| <p>Subject Clearing Brokerage Contracts (referred to as “Party A’s Final Obligations” in this Article) and the claims in the Party A’s Final Obligations shall constitute the claims of Party B to Party A.</p> <p>8 If Party A owes Party A’s Final Obligations pursuant to the provision of Paragraph <u>7</u>, Party A shall perform Party A’s Final Obligations by the time agreed between Party A and Party B, or promptly, absent such agreement, and in the manner agreed between Party A and Party B.</p> <p>9 (Omitted)</p> <p>Article 40. Compulsory Termination of this Agreement</p> <p>1~4 (Omitted)</p> <p>5 If the settlement of the Subject Clearing Brokerage Contracts has not been completed at the time of the termination of this Agreement pursuant to the provision of Paragraph 1, this Agreement shall continue to govern said Subject Clearing Brokerage Contracts and the settlement thereof.</p> | <p>Brokerage Contracts (referred to as “Party A’s Final Obligations” in this Article) and the claims in the Party A’s Final Obligations shall constitute the claims of Party B to Party A.</p> <p>8 If Party A owes Party A’s Final Obligations pursuant to the provision of Paragraph <u>5</u>, Party A shall perform Party A’s Final Obligations by the time agreed between Party A and Party B, or promptly, absent such agreement, and in the manner agreed between Party A and Party B.</p> <p>9 (Omitted)</p> <p>Article 40. Compulsory Termination of this Agreement</p> <p>1~4 (Omitted)</p> <p>5 If the settlement of the Subject Clearing Brokerage Contracts has not been completed at the time of the termination of this Agreement pursuant to <u>the provisions of</u> the provision of Paragraph 1, this Agreement shall continue to govern said Subject Clearing Brokerage Contracts and the settlement thereof.</p> |
|--|--|