金利スワップ取引清算業務における有価証券等清算取次ぎの意思確認プロセス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いて、Swap Execution Facility 又は Multilateral Trading Facility で執行されるクライアント（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をいう。以下同じ。）取引に係る債務負担プロセスを効率化することを目的として、当社及び受託清算参加者間の有価証券等清算取次ぎに係る意思確認プロセス（以下「Take-up プロセス」という。）を省略できることとするため、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

・クライアント取引に係る Take-up プロセスの省略を希望する受託清算参加者は、あらかじめ当社に対し、省略の対象となる取引に係る情報を申告する。

・当社は、省略の対象となる取引について、有価証券等清算取次ぎの委託の申込みに係る当社から受託清算参加者に対する通知及び当該委託の申込みに対する受託清算参加者から当社に対する承諾の通知があったこととみなす。

（備　考）

・ 金利スワップ清算業務に関する業務方法書第５４条の２第４項及び第５５条の２

・金利スワップ清算業務に関する業務方法書の取扱い第３１条の２

・金利スワップ清算業務に関する業務方法書の取扱い別紙様式第３号及び第３号の２

Ⅲ．施行日

２０２３年９月１９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、２０２３年９月１９日以後の当社が定める日から施行する。

以　上

別　紙

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　　２

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　　４

別　紙

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
（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有価証券等清算取次ぎの委託） 第５４条の２　（略） ２・３　（略） ４　前２項の規定にかかわらず、受託清算参加者から当社に対して、当社が定めるところにより前２項に規定する通知の省略を希望する申告があった場合には、受託清算参加者及び清算委託者は、第１項の規定により準用する前条第１項に規定する通知を当社が受領したことをもって、第２項に規定する当社から受託清算参加者に対する通知及び第３項の規定による受託清算参加者から当社に対する承諾の通知が行われ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有価証券等清算取次ぎの委託） 第５４条の２　（略） ２・３　（略） （新設）
（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条の２　前条各項の規定は、第５４条の２の規定において準用する第５４条第１項に規定する通知が当社に到達した場合に準用する。この場合において、前条第１項中「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」とあるのは「第５４条の２第３項の規定により有価証券等清算取次ぎの委託の申込みに対して承諾する旨を、当社に対して通知したとき、又は第５４条の２第４項の規定により有価証券等清算取次ぎの委託の申込みに対して承諾する旨を、当社に対して通知したものとみなされるとき」と読み替えるものとする。	（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条の２　前条各項の規定は、第５４条の２の規定において準用する第５４条第１項に規定する通知が当社に到達した場合に準用する。この場合において、前条第１項中「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」とあるのは「第５４条の２第３項の規定により有価証券等清算取次ぎの委託の申込みに対して承諾する旨を、当社に対して通知したとき」と読み替えるものとする。

付　　則 １　この改正規定は、令和５年９月１９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５年９月１９日以後の当社が定める日から施行する。	

別　紙

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
（有価証券等清算取次ぎの委託の申込みに対する通知の省略） 第３１条の２　業務方法書第５４条の２第４項に規定する当社が定める申告（申告内容の変更に係る申告を含む。）は、当社所定の書面を当社に提出して行うものとする。 ２　業務方法書第５４条の２第４項に規定する同条第２項及び第３項に規定する通知の省略を解消する場合の申告は、当社所定の書面を当社に提出して行うものとする。	（新設）
付　　則 １　この改正規定は、令和５年９月１９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５年９月１９日以後の当社が定める日から施行する。	
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	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
（有価証券等清算取次ぎの委託） 第４条　（略） ２～４　（略） ５　第３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有価証券等清算取次ぎの委託の申込み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に係る通知を行った場合には、甲は、当該通知に係る金利スワップ取引の有価証	（有価証券等清算取次ぎの委託） 第４条　（略） ２～４　（略） ５　第３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有価証券等清算取次ぎの委託の申込み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に係る通知を行った場合には、甲は、当該通知に係る金利スワップ取引の有価証

券等清算取次ぎの委託の申込み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。ただし、甲及び乙は、甲が、業務方法書等の規定に従い、あらかじめクリアリング機構に対して、有価証券等清算取次ぎの委託の申込みに係るクリアリング機構の甲に対する通知及び当該通知に係る金利スワップ取引の有価証券等清算取次ぎの委託の申込みの諾否に係る甲のクリアリング機構に対する通知の省略を希望する申告を行った場合については、甲及び乙は、第１項の通知をクリアリング機構が受領したことをもって、クリアリング機構が甲に対して有価証券等清算取次ぎの委託に係る通知を行い、甲が当該通知に係る金利スワップ取引の有価証券等清算取次ぎの委託の申込みについて承諾する旨をクリアリング機構に対して通知し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。	券等清算取次ぎの委託の申込み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。
（委託清算約定の成立） 第５条　（略） ２　前項の規定にかかわらず、乙が甲と同一の企業集団に含まれない者である場合、前項の規定中「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」とあるのは、「甲が同条第５項の規定により有価証券等清算取次ぎの委託の申込みについて承諾する旨をクリアリング機構に対して通知したとき、又は、同項ただし書により、クリアリング機構が甲に対して有価証券等清算取次ぎの委託の申込みに係る通知を行い、甲が当該通知に係る金利スワップ取引の有価証券等清算取次ぎの委託の申込みについて承諾する旨をクリアリング機構に対して通知したものとみなされるとき」と読み替えられるものとする。 ３・４　（略）	（委託清算約定の成立） 第５条　（略） ２　前項の規定にかかわらず、乙が甲と同一の企業集団に含まれない者である場合、前項の規定中「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」とあるのは、「甲が同条第５項の規定により有価証券等清算取次ぎの委託の申込みについて承諾する旨をクリアリング機構に対して通知したとき」と読み替えられるものとする。 ３・４　（略）
様式第３号の２　清算受託契約の様式（英語） Interest Rate Swap Clearing Brokerage Agreement	様式第３号の２　清算受託契約の様式（英語） Interest Rate Swap Clearing Brokerage Agreement

Article 4.　Clearing Brokerage 1~4 (Omitted) 5 When Party B is deemed to have applied for Clearing Brokerage to Party A pursuant to the provision of Paragraph 2 as amended by the provision of Paragraph 3, and JSCC gives notice concerning such application to Party A in accordance with the provisions of the Rules, Party A shall notify JSCC of its decision as to whether or not it accepts Party B's application for Clearing Brokerage for the IRS Transaction; provided, however, that Party A and Party B hereby agree in advance that if Party A has given, pursuant to the provisions of the Rules, a notification of its desire to skip JSCC's notification to Party A related to the request for Clearing Brokerage and Party A's notification to JSCC of its acceptance or denial of the request for Clearing Brokerage of the IRS Transaction related to such notification, JSCC's notification to Party A related to the request for Clearing Brokerage and Party A's notification to JSCC of its acceptance of the request for Clearing Brokerage shall be deemed to have been given upon arrival of the notification set forth in Paragraph 1 at JSCC.	Article 4.　Clearing Brokerage 1~4 (Omitted) 5 When Party B is deemed to have applied for Clearing Brokerage to Party A pursuant to the provision of Paragraph 2 as amended by the provision of Paragraph 3, and JSCC gives notice concerning such application to Party A in accordance with the provisions of the Rules, Party A shall notify JSCC of its decision as to whether or not it accepts Party B's application for Clearing Brokerage for the IRS Transaction.
Article 5. Execution of Cleared Contract Subject to Brokerage 1 (Omitted) 2 Notwithstanding the provision of Paragraph 1, if Party B does not belong to the same Corporate Group as Party A, the phrase "Clearing Brokerage is deemed to have been applied for and accepted pursuant to the provision of Article 4.2 of this Agreement" in Paragraph 1 shall be replaced with the phrase "Party A notifies JSCC of its decision to accept Party B's application for Clearing Brokerage pursuant to the provision of Article 4.5 of this Agreement or	Article 5. Execution of Cleared Contract Subject to Brokerage 1 (Omitted) 2 Notwithstanding the provision of Paragraph 1, if Party B does not belong to the same Corporate Group as Party A, the phrase "Clearing Brokerage is deemed to have been applied for and accepted pursuant to the provision of Article 4.2 of this Agreement" in Paragraph 1 shall be replaced with the phrase "Party A notifies JSCC of its decision to accept Party B's application for Clearing Brokerage pursuant to the provision of Article 4.5 of this Agreement."

JSCC's notification to Party A related to the request for Clearing Brokerage and Party A's notification to JSCC of its acceptance of the request for Clearing Brokerage shall be deemed to have been given pursuant to the proviso of Article 4.5 of this Agreement." 3~4 (Omitted)	3~4 (Omitted)