

**変動証拠金の資金決済制度の導入に伴う
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

当社は、金利スワップ取引に係る清算業務に関し、金利スワップ取引清算参加者（以下「清算参加者」という。）等の清算約定の現在価値の変動に係る債務を担保する目的で、当社及び清算参加者等との間で日々、変動証拠金の授受を行っているが、清算参加者等における資本規制上のエクスポージャーの圧縮を図るべく、変動証拠金の授受に代わり、資金決済として損益額の授受を行うことを可能とする制度を導入するため、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

1. 損益差金の授受

- ・清算参加者は、変動証拠金の資金決済制度を利用する場合には、あらかじめ届出を行うこととする。
- ・清算参加者及び清算委託者は、変動証拠金の資金決済制度を利用する場合、当該制度の対象となる清算約定を選定の上、当社に対して損益差金等の授受の申込みを行うものとする。
- ・当該申込みに係る清算約定について、当社が資金決済化要件の充足を確認した場合には、変動証拠金の授受に代わり、損益差金の授受を行うこととする。なお、日々の損益差金の請求により、当該清算約定の正味現在価値はゼロにリセットされるものとする。

2. 損益差金に係る調整金の授受

- ・損益差金については、変動証拠金の利息（P A I）に相当する額を損益差金に係る調整金（P A A）として授受を行う。

3. コンプレッション等により新規に成立する取引の取扱い

- ・各種コンプレッション等により新規に成立する取引は、変動証拠金の授受を行う清算約定として成立するものとする。

4. 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（以下「I R S業務方法書」という。）第27条の7等
- ・I R S業務方法書第51条の2等
- ・I R S業務方法書第61条の2等
- ・I R S業務方法書第83条の2等
- ・I R S業務方法書第53条第2項等

III. 施行日

2016年12月19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

1. 金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の一部改正新旧対照表
2. 金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の取扱いの一部改正新旧対照表
3. 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

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>(1)～(28) (略)</p> <p><u>(28)の2 「清算委託取引(決済型)」</u> とは、<u>清算委託取引のうち、本業務方法書等の定めるところにより、変動証拠金の授受を行わず、損益差金の授受を行うものをいう。</u></p> <p><u>(28)の3 「清算委託取引(担保型)」</u> とは、<u>清算委託取引のうち、本業務方法書等の定めるところにより、変動証拠金の授受を行うものをいう。</u></p> <p>(29)～(35) (略)</p> <p><u>(35)の2 「清算約定(決済型)」</u>とは、<u>清算約定のうち、本業務方法書等の定めるところにより、変動証拠金の授受を行わず、損益差金の授受を行うものをいう。</u></p> <p>(36) (略)</p> <p><u>(36)の2 「清算約定(担保型)」</u>とは、<u>清算約定のうち、本業務方法書等の定めるところにより、変動証拠金の授受を行うものをいう。</u></p> <p><u>(36)の3 「損益差金」とは、次に掲げる金銭を総称していう。</u></p> <p>a 第61条の2第1項第1号に掲げ</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>(1)～(28) (略)</p> <p>(新設)</p> <p>(新設)</p> <p>(29)～(35) (略)</p> <p>(新設)</p> <p>(36) (略)</p> <p>(新設)</p> <p>(新設)</p>

<p><u>る現在価値の変動に係るエクスポージャーを決済する目的で、当社営業日ごとに、当社及び清算参加者の間で授受される金銭</u></p>	
<p>b <u>第61条の2第1項第2号に掲げる現在価値の変動に係るエクスポージャーを決済する目的で、当社営業日ごとに、当社及び受託清算参加者の間で授受される金銭</u></p>	
<p>c <u>第61条の2第1項第3号に掲げる現在価値の変動に係るエクスポージャーを決済する目的で、当社営業日ごとに、受託清算参加者及び清算委託者の間で授受される金銭</u></p>	
<p><u>(36)の4 「損益差金等」とは、損益差金及び損益差金に係る調整金を総称していう。</u></p>	(新設)
<p><u>(36)の5 「損益差金に係る調整金」とは、第83条の2第1項に規定する金銭をいう。</u></p>	(新設)
<p>2・3 (略)</p>	2・3 (略)
<p><u>第5節の3 損益差金等の授受に関する届出</u></p>	(新設)
<p><u>(損益差金等の授受に関する届出)</u></p>	
<p><u>第27条の7 清算参加者が、本業務方法書等の定めるところにより、清算約定について初めて損益差金等の授受の申込みを行おうとする場合には、あらかじめ、当社が定めるところにより、その旨を当社に届け出なければならない。</u></p>	(新設)
<p>(債務負担による清算約定の成立)</p>	(債務負担による清算約定の成立)
<p>第49条 (略)</p>	第49条 (略)
<p>2～5 (略)</p>	2～5 (略)

<p><u>6 第1項の規定により成立する清算約定は、清算約定（担保型）として成立するものとする。</u></p> <p><u>（損益差金等の授受の申込み）</u></p>	(新設)
<p><u>第51条の2 清算参加者は、清算約定（担保型）について、損益差金等の授受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（以下「損益差金等の授受の申込み」という。）をするものとする。</u></p> <p><u>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（担保型）について損益差金等の授受の申込みを受けた場合において、当該清算約定（担保型）が当社の定める条件（以下「資金決済化要件」という。）を満たすこと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（担保型）が資金決済化要件を満たしているときは、当社が当該確認を行った時点をもって、当該清算約定（担保型）は清算約定（決済型）として取り扱われ、以後、変動証拠金の授受が行われないものとする。</u></p> <p><u>3 前項の規定により資金決済化要件を満たすことが確認された場合には、当社及び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、当社が定めるところにより、当該清算約定（担保型）に係る変動証拠金、変動証拠金の返還債務及び損益差金の支払債務について差引計算を行うものとする。</u></p> <p><u>4 清算参加者は、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、第2項の規定による当社の確認を行うまでの</u></p>	(新設)

<p><u>間において、当社が定める方法により、損益差金等の授受の申込みを撤回することができる。</u></p> <p><u>5 前各項に規定するほか、損益差金等の授受にあたり必要な事項は、当社が定める。</u></p> <p>(清算約定の取引毎コンプレッション)</p> <p>第53条 (略)</p> <p>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が当社の定める条件（以下「取引毎コンプレッション要件」という。）を満たすこと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満たしているときは、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、<u>清算約定（担保型）として成立させる。</u></p> <p>3～7 (略)</p> <p>(清算約定のクーポン・ブレンディング)</p> <p>第53条の2 (略)</p> <p>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</p>	<p>(清算約定の取引毎コンプレッション)</p> <p>第53条 (略)</p> <p>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が当社の定める条件（以下「取引毎コンプレッション要件」という。）を満たすこと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満たしているときは、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。</p> <p>3～7 (略)</p> <p>(清算約定のクーポン・ブレンディング)</p> <p>第53条の2 (略)</p> <p>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</p>
---	--

<p>座に記録されている複数の清算約定についてクーポン・ブレンディングの申込みを受けた場合において、当該清算約定及びクーポン・ブレンディングにより新たに成立する清算約定が当社の定める条件（以下「クーポン・ブレンディング要件」という。）を満たすことを当社が定めるところにより確認するものとし、当該清算約定及びクーポン・ブレンディングにより新たに成立する清算約定がクーポン・ブレンディング要件を満たしているときは、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、当該クーポン・ブレンディング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、<u>清算約定（担保型）</u>として成立させる。</p> <p>3～7 （略）</p> <p>（清算約定の一括コンプレッション）</p> <p>第53条の2の2 （略）</p> <p>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が当社の定める条件を満たすこと並びに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、一括コンプレッション成立要件を満たしてい</p>	<p>座に記録されている複数の清算約定についてクーポン・ブレンディングの申込みを受けた場合において、当該清算約定及びクーポン・ブレンディングにより新たに成立する清算約定が当社の定める条件（以下「クーポン・ブレンディング要件」という。）を満たすことを当社が定めるところにより確認するものとし、当該清算約定及びクーポン・ブレンディングにより新たに成立する清算約定がクーポン・ブレンディング要件を満たしているときは、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、当該クーポン・ブレンディング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。</p> <p>3～7 （略）</p> <p>（清算約定の一括コンプレッション）</p> <p>第53条の2の2 （略）</p> <p>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が当社の定める条件を満たすこと並びに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、一括コンプレッション成立要件を満たしてい</p>
---	---

<p>るときは、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、<u>清算約定（担保型）として成立させる。</u></p> <p>3～7 （略）</p> <p>（清算約定の参加者提案型コンプレッション）</p> <p>第53条の2の3 （略）</p> <p>2 当社は、前項の規定により参加者提案型コンプレッションの申込みを受けた場合において、当該申込みに係る清算約定及び当該参加者提案型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並びに当該清算参加者（共同清算参加者を含む。以下本項において同じ。）が参加者提案型コンプレッションが成立したと仮定して算出する債務負担時所要証拠金の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「参加者提案型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、参加者提案型コンプレッション成立要件を満たしているときは、当社及び当該清算参加者は、当該清算約定を終了させ、当該参加者提案型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、<u>清算約定（担保型）として成立させる。</u></p> <p>3～6 （略）</p> <p>（清算約定（自己分）の承継の成立）</p> <p>第53条の4 （略）</p> <p>2～3 （略）</p>	<p>るときは、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。</p> <p>3～7 （略）</p> <p>（清算約定の参加者提案型コンプレッション）</p> <p>第53条の2の3 （略）</p> <p>2 当社は、前項の規定により参加者提案型コンプレッションの申込みを受けた場合において、当該申込みに係る清算約定及び当該参加者提案型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並びに当該清算参加者（共同清算参加者を含む。以下本項において同じ。）が参加者提案型コンプレッションが成立したと仮定して算出する債務負担時所要証拠金の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「参加者提案型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、参加者提案型コンプレッション成立要件を満たしているときは、当社及び当該清算参加者は、当該清算約定を終了させ、当該参加者提案型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。</p> <p>3～6 （略）</p> <p>（清算約定（自己分）の承継の成立）</p> <p>第53条の4 （略）</p> <p>2～3 （略）</p>
---	---

<p>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。</p> <p>(1) (略)</p> <p>(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との間の<u>清算約定(担保型)</u>の清算約定(自己分)に係る権利義務とみなす。</p> <p>(3) (略)</p> <p>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<u>清算約定(担保型)</u>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。</p> <p>6 (略)</p> <p>(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)</p> <p>第55条 (略)</p> <p>2～3 (略)</p> <p>4 清算約定(委託分)は、清算委託取引の終了その他の当社が定める場合には、当社が定める時点以降、当該清算約定(委託分)の当事者である清算参加者の自己の計算による清算約定<u>(担保型)</u>として取り扱われるものとする。</p> <p>5～6 (略)</p> <p><u>(清算委託者が行う清算約定(委託分)に関する損益差金等の申込み等)</u></p> <p>第55条の3 <u>清算委託者は、清算約定(担</u></p>	<p>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。</p> <p>(1) (略)</p> <p>(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との清算約定(自己分)に係る権利義務とみなす。</p> <p>(3) (略)</p> <p>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。</p> <p>6 (略)</p> <p>(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)</p> <p>第55条 (略)</p> <p>2～3 (略)</p> <p>4 清算約定(委託分)は、清算委託取引の終了その他の当社が定める場合には、当社が定める時点以降、当該清算約定(委託分)の当事者である清算参加者の自己の計算による清算約定として取り扱われるものとする。</p> <p>5～6 (略)</p> <p>(新設)</p>
---	--

<p><u>保型)の清算約定(委託分)について損益差金等の授受の申込みの指図又は損益差金等の授受の申込みの撤回の指図を行う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。</u></p> <p><u>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51条の2第1項又は第4項の規定に従い、当該通知に係る清算約定(担保型)の清算約定(委託分)について当社に対して損益差金等の授受の申込み又は損益差金等の授受の申込みの撤回を行うものとする。</u></p> <p>(清算約定(委託分)の承継の成立)</p> <p>第58条の3 (略)</p> <p>2～3 (略)</p> <p>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。</p> <p>(1) (略)</p> <p>(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<u>清算約定(担保型)</u>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。</p> <p>(3)～(4) (略)</p> <p>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、</p>	<p>(清算約定(委託分)の承継の成立)</p> <p>第58条の3 (略)</p> <p>2～3 (略)</p> <p>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。</p> <p>(1) (略)</p> <p>(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(委託分)及びその清算委託取引に係る権利義務とみなす。</p> <p>(3)～(4) (略)</p> <p>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、</p>
--	--

<p>これを<u>清算約定（担保型）</u>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。</p> <p>（清算委託取引の移管の成立）</p> <p>第58条の5 （略）</p> <p>2～5 （略）</p> <p>6 第4項前段の規定により消滅する清算委託取引に係る清算約定（委託分）は、受託清算参加者の<u>清算約定（担保型）</u>の清算約定（自己分）とみなすとともに、本業務方法書等の規定を適用する。同項後段の規定により発生する移管先清算委託者及び受託清算参加者間の清算委託取引は、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<u>（担保型）</u>とみなすとともに、同項後段の規定により消滅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<u>清算約定（担保型）</u>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。</p> <p>（受託清算参加者の清算約定（自己分）の移管の成立）</p> <p>第58条の7 （略）</p> <p>2～5 （略）</p> <p>6 第4項の規定により発生する移管先清算委託者及び受託清算参加者間の法律関係は、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<u>（担保型）</u>とみなすとともに、受託清算参加者及び当社との間の移管申込清算約定を当該清算委託取引の取次ぎに基づき成立した受託</p>	<p>これを清算約定（委託分）とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。</p> <p>（清算委託取引の移管の成立）</p> <p>第58条の5 （略）</p> <p>2～5 （略）</p> <p>6 第4項前段の規定により消滅する清算委託取引に係る清算約定（委託分）は、受託清算参加者の清算約定（自己分）とみなすとともに、本業務方法書等の規定を適用する。同項後段の規定により発生する移管先清算委託者及び受託清算参加者間の清算委託取引は、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とみなすとともに、同項後段の規定により消滅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（委託分）とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。</p> <p>（受託清算参加者の清算約定（自己分）の移管の成立）</p> <p>第58条の7 （略）</p> <p>2～5 （略）</p> <p>6 第4項の規定により発生する移管先清算委託者及び受託清算参加者間の法律関係は、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とみなすとともに、受託清算参加者及び当社との間の移管申込清算約定を当該清算委託取引の取次ぎに基づき成立した受託清算参加者</p>
--	--

<p>清算参加者及び当社との間の<u>清算約定（担保型）</u>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。</p> <p>7 （略）</p> <p>（清算参加者口座）</p> <p>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、<u>損益差金</u>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。</p> <p>2～5 （略）</p> <p>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、<u>変動証拠金及び損益差金</u>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。</p> <p>7 （略）</p> <p>（清算取次口座）</p> <p>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、<u>損益差金</u>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</p>	<p>及び当社との間の清算約定（委託分）とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。</p> <p>7 （略）</p> <p>（清算参加者口座）</p> <p>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。</p> <p>2～5 （略）</p> <p>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<u>変動証拠金</u>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。</p> <p>7 （略）</p> <p>（清算取次口座）</p> <p>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</p>
---	---

<p>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。</p> <p>2 （略）</p> <p>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、<u>変動証拠金及び損益差金</u>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。</p> <p>第6章 証拠金等 （証拠金の目的）</p> <p>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。</p> <p>（1）～（2）（略）</p> <p>（3） 清算約定（自己分）に関して当社及び清算参加者の間で授受される変動証拠金 清算参加者が<u>清算約定（担保型）</u>の清算約定（自己分）に関して当社に対して負担する債務又は当社が<u>清算約定（担保型）</u>の清算約定（自己分）に関して清算参加者に対して負担する債務</p> <p>（4） 清算約定（委託分）に関して当社及び受託清算参加者の間で授受される変動証拠金 受託清算参加者が<u>清算約定（担保型）</u>の清算約定（委託分）に関して当社に対して負担する債務又は当社が<u>清算約定（担保型）</u>の清算約定（委託分）に関し</p>	<p>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。</p> <p>2 （略）</p> <p>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<u>及び変動証拠金</u>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。</p> <p>第6章 証拠金 （証拠金の目的）</p> <p>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。</p> <p>（1）～（2）（略）</p> <p>（3） 清算約定（自己分）に関して当社及び清算参加者の間で授受される変動証拠金 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債務又は当社が清算約定（自己分）に関して清算参加者に対して負担する債務</p> <p>（4） 清算約定（委託分）に関して当社及び受託清算参加者の間で授受される変動証拠金 受託清算参加者が清算約定（委託分）に関して当社に対して負担する債務又は当社が清算約定（委託分）に関して受託清算参加者に対して負担する債務</p>
---	--

<p>て受託清算参加者に対して負担する債務</p> <p>(5) 清算委託取引に関して受託清算参加者及び清算委託者の間で授受される変動証拠金</p> <p>清算委託者が清算委託取引 <u>(担保型)</u> に関して受託清算参加者に対して負担する債務又は受託清算参加者が清算委託取引 <u>(担保型)</u> に関して清算委託者に対して負担する債務</p> <p>2～3 (略)</p> <p><u>(損益差金の目的)</u></p> <p><u>第61条の2 損益差金は、次の各号に掲げる損益差金の区分に応じて、当該各号に掲げる清算約定 (決済型) 又は清算委託取引 (決済型) の現在価値の変動に係るエクスポージャーを決済する目的で、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。</u></p> <p><u>(1) 清算約定 (自己分) に関して当社及び清算参加者の間で授受される損益差金</u></p> <p><u>清算約定 (決済型) の清算約定 (自己分) の現在価値の変動に係るエクスポージャー</u></p> <p><u>(2) 清算約定 (委託分) に関して当社及び受託清算参加者の間で授受される損益差金</u></p> <p><u>清算約定 (決済型) の清算約定 (委託分) の現在価値の変動に係るエクスポージャー</u></p> <p><u>(3) 清算委託取引に関して受託清算参加者及び清算委託者の間で授受される</u></p>	<p>(5) 清算委託取引に関して受託清算参加者及び清算委託者の間で授受される変動証拠金</p> <p>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又は受託清算参加者が清算委託取引に関して清算委託者に対して負担する債務</p> <p>2～3 (略)</p> <p>(新設)</p>
--	---

<p><u>損益差金</u></p> <p><u>清算委託取引（決済型）の清算委託取引の現在価値の変動に係るエクスポージャー</u></p> <p><u>2 第78条の2第2項に定める時点をもって、当該時点における前項各号に掲げる清算約定（決済型）及び清算委託取引（決済型）の正味現在価値はゼロとして算出されたものとする。ただし、当社が定める場合については、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が行われた清算約定（決済型）及び清算委託取引（決済型）の当該申込みが行われた日の当社が定める時点をもって、正味現在価値はゼロとして算出されたものとする。</u></p> <p>第3節 変動証拠金等</p> <p>（変動証拠金等の授受）</p> <p>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<u>（担保型）</u>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<u>（担保型）</u>の通貨の金銭により授受する。</p> <p>（1）～（2） （略）</p> <p><u>2 前項の規定は、当社及び清算参加者が損益差金の授受を行う場合について準用する。この場合において、前項中「変動証拠金」とあるのは「損益差金」と、「清算約定（担保型）」とあるのは「清算約定（決済型）」と読み替えるものとする。</u></p> <p>（変動証拠金所要額）</p> <p>第78条 変動証拠金所要額は、各清算参加者について、自己取引口座及び委託取</p>	<p>第3節 変動証拠金</p> <p>（変動証拠金の授受）</p> <p>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。</p> <p>（1）～（2） （略）</p> <p>（新設）</p> <p>（変動証拠金所要額）</p> <p>第78条 変動証拠金所要額は、各清算参加者について、自己取引口座及び委託取</p>
---	--

<p>引口座ごとに、前当社営業日から当社営業日までの<u>清算約定（担保型）</u>の正味現在価値の変動に応じて、当社が定める方法により当社が算出する。</p> <p>2 当社は、<u>清算約定（担保型）</u>の清算約定（委託分）の変動証拠金所要額を、当社が定める方法により委託取引口座ごとに算出し、その金額を当該清算委託者と清算受託契約を締結している受託清算参加者に通知する。</p>	<p>引口座ごとに、前当社営業日から当社営業日までの清算約定の正味現在価値の変動に応じて、当社が定める方法により当社が算出する。</p> <p>2 当社は、清算約定（委託分）の変動証拠金所要額を、当社が定める方法により委託取引口座ごとに算出し、その金額を当該清算委託者と清算受託契約を締結している受託清算参加者に通知する。</p>
<p><u>（損益差金所要額）</u></p> <p><u>第78条の2 前条の規定は、損益差金所要額について準用する。この場合において、同条第1項及び第2項中「変動証拠金所要額」とあるのは「損益差金所要額」と、「清算約定（担保型）」とあるのは「清算約定（決済型）」と、前条第1項中「正味現在価値の変動に応じて」とあるのは「正味現在価値に応じて」と読み替えるものとする。</u></p> <p>2 <u>前項の規定により算出した損益差金所要額について当社が清算参加者に通知を行った時点をもって、当該損益差金の支払いに係る債権債務が新たに成立するものとする。</u></p>	<p>（新設）</p>
<p><u>（損益差金の支払時限）</u></p> <p><u>第81条の2 前条の規定は、損益差金の授受について準用する。この場合において、前条第1項及び第2項中「変動証拠金」とあるのは「損益差金」と、前条第1項中「変動証拠金所要額に相当する金銭を当社に預託し」とあるのは「損益差金所要額に相当する金銭を当社に支払わ」と、前条第2項中「変動証拠金所要</u></p>	<p>（新設）</p>

<p><u>額に相当する金銭を当該清算参加者に預託する」とあるのは「損益差金所要額に相当する金銭を当該清算参加者に支払う」と読み替えるものとする。</u></p>	
<p><u>(損益差金の臨時支払)</u></p>	
<p><u>第82条の2 前条の規定は、損益差金の臨時支払について準用する。この場合において、同条中「第78条及び第81条」とあるのは「第78条の2及び第81条の2」と、「変動証拠金の臨時預託」とあるのは「損益差金の臨時支払」と読み替えるものとする。</u></p>	<p>(新設)</p>
<p>(変動証拠金に係る利息の取扱い)</p>	<p>(変動証拠金に係る利息の取扱い)</p>
<p>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<u>(担保型)</u>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<u>(担保型)</u>の通貨の金銭により授受するものとする。</p>	<p>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。</p>
<p>(1)～(2) (略)</p>	<p>(1)～(2) (略)</p>
<p>2～3 (略)</p>	<p>2～3 (略)</p>
<p><u>(損益差金に係る調整金の取扱い)</u></p>	
<p><u>第83条の2 当社及び清算参加者は、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(決済型)に応じて、当該各号に定める日ごとに損益差金に係る調整金を当該清算約定(決済型)の通貨の金銭により授受するものとする。</u></p>	<p>(新設)</p>
<p><u>(1) 円貨建清算約定 当社営業日</u></p>	
<p><u>(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</u></p>	
<p><u>2 前条第2項及び第3項の規定は、損益</u></p>	

<p><u>差金に係る調整金の授受について準用する。この場合において、同条第2項及び第3項中「変動証拠金の利息」及び「変動証拠金に係る利息」とあるのは、「損益差金に係る調整金」と読み替えるものとする。</u></p> <p>(外貨による資金決済の方法)</p> <p>第85条の4 (略)</p> <p>2 (略)</p> <p>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 <u>(損益差金等を除く。)</u> 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。</p> <p>(1)～(3) (略)</p> <p>4～6 (略)</p> <p>(損失回避のための措置)</p> <p>第93条 (略)</p> <p>2 損失回避取引については、これを清算約定 <u>(担保型)</u> 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。</p> <p>(クロスマージン処分取引の実施)</p> <p>第93条の2 (略)</p> <p>2 (略)</p> <p>3 クロスマージン処分取引については、これを清算約定 <u>(担保型)</u> 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。</p> <p>4～7 (略)</p>	<p>(外貨による資金決済の方法)</p> <p>第85条の4 (略)</p> <p>2 (略)</p> <p>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。</p> <p>(1)～(3) (略)</p> <p>4～6 (略)</p> <p>(損失回避のための措置)</p> <p>第93条 (略)</p> <p>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。</p> <p>(クロスマージン処分取引の実施)</p> <p>第93条の2 (略)</p> <p>2 (略)</p> <p>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。</p> <p>4～7 (略)</p>
--	---

<p>(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)</p> <p>第94条 (略)</p> <p>2 (略)</p> <p>3 清算委託者は、<u>第1項</u>の規定により当社に対して同項の権利義務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、その承諾を得なければならない。</p> <p>4 (略)</p> <p>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。)、<u>変動証拠金及び損益差金</u>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、<u>変動証拠金及び損益差金</u>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。</p> <p>6 当社が前項の規定による承諾を行った</p>	<p>(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)</p> <p>第94条 (略)</p> <p>2 (略)</p> <p>3 清算委託者は、<u>前項</u>の規定により当社に対して同項の権利義務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、その承諾を得なければならない。</p> <p>4 (略)</p> <p>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。)<u>及び変動証拠金</u>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<u>及び変動証拠金</u>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。</p> <p>6 当社が前項の規定による承諾を行った</p>
--	---

<p>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。</p> <p>(1) (略)</p> <p>(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遡及して成立させた<u>清算約定(担保型)</u>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。</p> <p>(3) 当社、承継清算参加者及び当該承諾に係る清算委託者は、第1号の規定による権利義務の発生に伴い、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、<u>変動証拠金及び損益差金</u>の授受を行う。</p> <p>(4)～(6) (略)</p> <p>7 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<u>清算約定(担保型)</u>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。</p> <p>8 (略)</p> <p>(入札対象取引の成立等)</p> <p>第99条 (略)</p> <p>2 当社及び前項の清算参加者は、同項の規定による入札対象取引の成立に伴い、当社が規則で定めるところにより、当社が規則で定める金銭、<u>変動証拠金及び損益差金</u>の授受を行う。</p> <p>3 第1項の規定により成立した入札対象取引については、これを清算約定(<u>担保</u></p>	<p>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。</p> <p>(1) (略)</p> <p>(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遡及して成立させた清算約定(委託分)及びその清算委託取引に係る権利義務とみなす。</p> <p>(3) 当社、承継清算参加者及び当該承諾に係る清算委託者は、第1号の規定による権利義務の発生に伴い、当社が規則で定めるところにより、承継時支払金額、未払債務及び<u>変動証拠金</u>の授受を行う。</p> <p>(4)～(6) (略)</p> <p>7 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(委託分)とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。</p> <p>8 (略)</p> <p>(入札対象取引の成立等)</p> <p>第99条 (略)</p> <p>2 当社及び前項の清算参加者は、同項の規定による入札対象取引の成立に伴い、当社が規則で定めるところにより、当社が規則で定める金銭及び<u>変動証拠金</u>の授受を行う。</p> <p>3 第1項の規定により成立した入札対象取引については、これを清算約定とみな</p>
---	--

<p><u>型</u>)とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。</p> <p>4 (略)</p> <p style="text-align: center;">付 則</p> <p>この改正規定は、平成28年12月19日から施行する。</p>	<p>して、本業務方法書等の規定を適用する。</p> <p>4 (略)</p>
--	---

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>(届出方法)</p> <p>第16条 業務方法書第13条第1項、第14条、第19条、<u>第27条の6、第27条の7、第44条及び第45条の規定による当社への届出は、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。</u></p> <p>2 業務方法書第13条第1項、第14条、第19条、<u>第27条の6、第27条の7、及び第44条の規定による当社への届出は、当社がその都度指定するときまでに行うものとする。</u></p> <p><u>(損益差金等の授受の申込みの方法等)</u></p> <p>第29条の2 業務方法書第51条の2第1項及び第4項に規定する当社が定める方法は、<u>当社が通知又は公示により定める方法とする。</u></p> <p>2 <u>業務方法書第51条の2第1項に規定する損益差金等の授受の申込みについて、清算参加者が自己取引口座又は委託取引口座に記録されることとなるすべての清算約定（担保型）について損益差金等の授受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（担保型）は、その記録時点で前項の規定に従い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す。</u></p> <p>3 業務方法書第51条の2第2項に規定</p>	<p>(届出方法)</p> <p>第16条 業務方法書第13条第1項、第14条、第19条、第44条及び第45条の規定による当社への届出は、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。</p> <p>2 業務方法書第13条第1項、第14条、第19条及び第44条の規定による当社への届出は、当社がその都度指定するときまでに行うものとする。</p> <p>(新設)</p>

する当社の定める条件は、損益差金等の授受の申込みに係る清算約定（担保型）について、当社が確認を行う時点において、既に発生している預託又は支払いが完了していない変動証拠金に関する債権債務がないこととする。

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。

5 業務方法書第51条の2第3項に規定

する当社が定める差引計算については、当社及び清算参加者は、資金決済化要件を満たす清算約定につき当該要件の充足の確認を行った日までに相手方に預託すべき変動証拠金に相当する額として算出される額（以下本項において「本資金決済化金額」という。）を、当該日までに相手方に預託すべき変動証拠金の差引累計額（変動証拠金の総支払額から総受取額を控除した額をいう。）から減じ、差引計算後の額の変動証拠金の差引累計額が正数となる場合には、相手方に当該額の変動証拠金が預託されているものとみなし、当該差引累計額が負数となる場合には、相手方からその負数の絶対値に相当する金額の変動証拠金の預託を受けているものとみなす。この場合において、当社及び清算参加者は、本資金決済化金額に相当する金銭を、損益差金に係る支払債務が成立した時点で、当該債務の弁済に充当する。

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、損益差金等の授受の申込みについて資金決済化要件の充足の確認を行わないこととし又は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。

(清算約定（自己分）の承継時に授受する

(清算約定（自己分）の承継時に授受する

<p>金銭等に関する事項)</p> <p>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。</p> <p>(1) 期限前終了手数料の額は、当該各清算約定について当該終了の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（変動証拠金の総支払額から総受取額を控除した額をいう。以下本条において同じ。）に当該終了の日の翌当社営業日に授受すべき変動証拠金に係る利息を加減した額（<u>当該各清算約定が清算約定（決済型）である場合には、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の額とする。</u>）と同額とし、当該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、当該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する。</p> <p>(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（<u>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</u></p>	<p>金銭等に関する事項)</p> <p>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。</p> <p>(1) 期限前終了手数料の額は、当該各清算約定について当該終了の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（変動証拠金の総支払額から総受取額を控除した額をいう。以下本条において同じ。）に当該終了の日の翌当社営業日に授受すべき変動証拠金に係る利息を加減した額と同額とし、当該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、当該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する。</p> <p>(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</p>
---	---

<p><u>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。</u></p> <p>2 （略）</p>	<p>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。</p> <p>2 （略）</p>
<p><u>（清算約定（委託分）に関する損益差金等の授受の申込み）</u></p> <p><u>第33条の2 業務方法書第55条の3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。</u></p> <p>（清算約定（委託分）の承継時に授受する金銭等に関する事項）</p> <p>第35条の3 業務方法書第58条の3第1項に規定する期限前終了手数料及び承継時支払金額は、次に定めるところにより円貨建清算約定、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。</p> <p>（1） 期限前終了手数料の額は、当該各清算約定について当該終了の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（変動証拠金の総支払額から総受取額を控除した額をいう。以下本条において同じ。）に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</p>	<p>（新設）</p> <p>（清算約定（委託分）の承継時に授受する金銭等に関する事項）</p> <p>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。</p> <p>（1） 期限前終了手数料の額は、当該各清算約定について当該終了の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（変動証拠金の総支払額から総受取額を控除した額をいう。以下本条において同じ。）に当該終了の日の翌当社営業日に授受すべき変動証拠金に係る利息を加減した額と同</p>

<p><u>該各清算約定が清算約定（決済型）である場合には、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の額とする。）と同額とし、当該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、当該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する。</u></p> <p>(2) 当社、承継清算参加者及び清算委託者は、対象清算約定（業務方法書第58条の2第3項に規定する対象清算約定をいう。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（<u>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。</u>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。</p> <p>2 (略)</p> <p><u>(損益差金に係る時点)</u></p>	<p>額とし、当該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、当該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する。</p> <p>(2) 当社、承継清算参加者及び清算委託者は、対象清算約定（業務方法書第58条の2第3項に規定する対象清算約定をいう。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。</p> <p>2 (略)</p>
--	--

<p><u>第35条の6 業務方法書第61条の2第2項に規定する当社が定める場合は、同第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が午後4時以降に行われており（午後5時30分から午後7時までの間に新たに記録された清算約定について、第29条の2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。）、当該申込み日の正味現在価値を算出する場合とし、当社が定める時点は、当該申込みが行われた清算約定について、第29条の2第4項の規定により資金決済化要件の充足の確認が行われた時点とする。</u></p> <p style="text-align: center;">第5章 証拠金等</p> <p>(変動証拠金所要額)</p> <p>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<u>清算約定(担保型)</u>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<u>(担保型)</u>ごとに、当該各号に定める方法とする。</p> <p>(1) 円貨建清算約定</p> <p>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（<u>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ときは、当該確認を行った時点、業務方法書第53</u></p>	<p>(新設)</p> <p style="text-align: center;">第5章 証拠金</p> <p>(変動証拠金所要額)</p> <p>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。</p> <p>(1) 円貨建清算約定</p> <p>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（<u>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、</u></p>
---	--

<p>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<u>清算約定(担保型)</u>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<u>清算約定(担保型)</u>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</p> <p>(2)～(4) (略)</p> <p>2 前項第1号における<u>清算約定(担保型)</u>の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。</p> <p>3 前項の規定は、第1項第2号から第4号に定める<u>清算約定(担保型)</u>の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</p>	<p>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</p> <p>(2)～(4) (略)</p> <p>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。</p> <p>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</p>
---	--

<p>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。</p> <p><u>(損益差金所要額)</u></p> <p><u>第38条の2 業務方法書第78条の2に規定する当社が定める損益差金所要額の算出方法及び当社が定める清算約定(決済型)の清算約定(委託分)の損益差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(決済型)ごとに、当該各号に定める方法とする。</u></p> <p><u>(1) 円貨建清算約定</u></p> <p><u>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時の時点における清算約定(決済型)の円貨建清算約定について算出した正味現在価値に相当する額を求める方法</u></p> <p><u>(2) 豪ドル建清算約定</u></p> <p><u>前号に定める方法を準用する。この場合において、「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。</u></p> <p><u>(3) 米ドル建清算約定</u></p> <p><u>第1号に定める方法を準用する。この場合において、「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。</u></p> <p><u>(4) ユーロ建清算約定</u></p> <p><u>第1号に定める方法を準用する。この場合において、「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</u></p>	<p>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。</p> <p>(新設)</p>
--	---

<p><u>前1 1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。</u></p> <p><u>2 前条第2項の規定は、前項第1号に定める清算約定（決済型）の円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、「清算約定（担保型）」は「清算約定（決済型）」と読み替えるものとする。</u></p> <p><u>3 前条第3項の規定は、第1項第2号から第4号までに定める清算約定（決済型）の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、「清算約定（担保型）」は「清算約定（決済型）」と読み替えるものとする。</u></p> <p>（変動証拠金に係る利息等の算出）</p> <p>第4 2条 業務方法書第8 3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（担保型）に応じて、当該各号に定める金利とする。</p> <p>（1）～（4） （略）</p> <p>2 業務方法書第8 3条第1項に規定する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（担保型）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。</p> <p>（1）～（4） （略）</p> <p><u>3 業務方法書第8 3条の2第1項に規定する損益差金に係る調整金は、次の各号に掲げる通貨の清算約定（決済型）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。</u></p> <p><u>（1） 円貨建清算約定 前項第1号の規定を準用する。この場合において、「預</u></p>	<p>（変動証拠金に係る利息の算出）</p> <p>第4 2条 業務方法書第8 3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。</p> <p>（1）～（4） （略）</p> <p>2 業務方法書第8 3条第1項に規定する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（担保型）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。</p> <p>（1）～（4） （略）</p> <p>（新設）</p>
--	---

託されている円貨建清算約定に係る変動証拠金」は「交付されている円貨建清算約定に係る損益差金」と読み替えるものとする。

(2) 豪ドル建清算約定 前項第2号の規定を準用する。この場合において、「預託されている豪ドル建清算約定に係る変動証拠金」は「交付されている豪ドル建清算約定に係る損益差金」と読み替えるものとする。

(3) 米ドル建清算約定 前項第3号の規定を準用する。この場合において、「預託されている米ドル建清算約定に係る変動証拠金」は「交付されている米ドル建清算約定に係る損益差金」と読み替えるものとする。

(4) ユーロ建清算約定 前項第4号の規定を準用する。この場合において、「預託されているユーロ建清算約定に係る変動証拠金」は「交付されているユーロ建清算約定に係る損益差金」と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)

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

(国債証券先物取引の建玉の清算参加者口座への記録)

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

<p>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つては、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）及び<u>損益差金所要額（外貨建清算約定に係る損益差金所要額にあつては、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）</u>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。</p> <p>(2) (略)</p> <p>2 (略)</p> <p>(日本円による資金決済の方法)</p> <p>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。</p> <p>(1) <u>清算約定（担保型）の円貨建清算約定に係る変動証拠金</u></p> <p><u>(1)の2 清算約定（決済型）の円貨建清算約定に係る損益差金</u></p> <p>(2) <u>清算約定（担保型）の円貨建清算約定に係る変動証拠金の利息</u></p> <p><u>(2)の2 清算約定（決済型）の円貨建清算約定に係る損益差金に係る調整金</u></p> <p>(3)～(11) (略)</p> <p><u>(12) 業務方法書第53条の4第1項及</u></p>	<p>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つては、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）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。</p> <p>(2) (略)</p> <p>2 (略)</p> <p>(日本円による資金決済の方法)</p> <p>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。</p> <p>(1) 円貨建清算約定に係る変動証拠金（新設）</p> <p>(2) 円貨建清算約定に係る変動証拠金の利息（新設）</p> <p>(3)～(11) (略)</p> <p>(新設)</p>
---	---

<p><u>び第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（円貨建清算約定に係るものに限る。）</u></p> <p>2～4（略）</p> <p>（外貨による資金決済）</p> <p>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。</p> <p>（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</p> <p>a <u>清算約定（担保型）の外貨建清算約定に係る変動証拠金</u></p> <p>aの2 <u>清算約定（決済型）の外貨建清算約定に係る損益差金</u></p> <p>b <u>清算約定（担保型）の外貨建清算約定に係る変動証拠金の利息</u></p> <p>bの2 <u>清算約定（決済型）の外貨建清算約定に係る損益差金に係る調整金</u></p> <p>c～g（略）</p> <p>（2）（略）</p> <p>2～5（略）</p> <p>付 則</p> <p>この改正規定は、平成28年12月19日から施行する。</p> <p>別表2 当初証拠金所要額の算出方法</p> <p>1 当初証拠金所要額</p>	<p>2～4（略）</p> <p>（外貨による資金決済）</p> <p>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。</p> <p>（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</p> <p>a 外貨建清算約定に係る変動証拠金（新設）</p> <p>b 外貨建清算約定に係る変動証拠金の利息（新設）</p> <p>c～g（略）</p> <p>（2）（略）</p> <p>2～5（略）</p> <p>別表2 当初証拠金所要額の算出方法</p> <p>1 当初証拠金所要額</p>
--	--

<p>(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）</p> <p>a～g （略）</p> <p>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又は損益差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。</p> <p>(1) の 2 清算約定（自己分）に係る当初証拠金所要額（午後 5 時 30 分から午後 7 時までの間に新たな清算約定（自己分）が成立した場合）</p> <p>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 7 時時点における清算約定（自己分）について算出した当初証拠金相当額に変動証拠金・損益差金相当額を加減した額とする。ただし、当社が市場環境の急激な変化が生じた場合その他当社の金利スワップ取引清算業務の適切な遂行を確保する観点から必要と認める場合には、当該額を臨時に変更することができる。</p> <p>b （略）</p> <p>c 上記 a に規定する「変動証拠金・損益差金相当額」とは、算出日の午後</p>	<p>(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）</p> <p>a～g （略）</p> <p>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。</p> <p>(1) の 2 清算約定（自己分）に係る当初証拠金所要額（午後 5 時 30 分から午後 7 時までの間に新たな清算約定（自己分）が成立した場合）</p> <p>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 7 時時点における清算約定（自己分）について算出した当初証拠金相当額に変動証拠金相当額を加減した額とする。ただし、当社が市場環境の急激な変化が生じた場合その他当社の金利スワップ取引清算業務の適切な遂行を確保する観点から必要と認める場合には、当該額を臨時に変更することができる。</p> <p>b （略）</p> <p>c 上記 a に規定する「変動証拠金相当額」とは、算出日の午後 4 時時点に</p>
---	---

<p>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、同日の午後 3 時 2 分時点（ユーロ建清算約定にあつては、午前 1 1 時 2 分時点。以下本 c 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、当該算出日の午後 7 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、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の差額に相当する額（外貨建清算約定にあつては、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。</p> <p>d～e （略）</p> <p>(2)～(4) （略）</p> <p>2 日中証拠金所要額</p> <p>(1) 清算約定（自己分）に係る日中証拠金所要額</p> <p>a 清算約定（自己分）に係る日中証拠金所要額は、自己取引口座の算出日の正午時点における清算約定（自己分）について算出した当初証拠金相当額に変動証拠金・<u>損益差金</u>相当額を加減した額とする。ただし、当社が市場環境の急激な変化が生じた場合その他当社の金利スワップ取引清算業務の適切な遂行を確保する観点から必要と認める場合には、当該額を臨時に変更することができる。</p> <p>b （略）</p> <p>c 上記 a に規定する「<u>変動証拠金・損益差金</u>相当額」とは、算出日の前当社営業日の午後 4 時時点における清</p>	<p>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（ユーロ建清算約定にあつては、午前 1 1 時 2 分時点。以下本 c 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、当該算出日の午後 7 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、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の差額に相当する額（外貨建清算約定にあつては、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。</p> <p>d～e （略）</p> <p>(2)～(4) （略）</p> <p>2 日中証拠金所要額</p> <p>(1) 清算約定（自己分）に係る日中証拠金所要額</p> <p>a 清算約定（自己分）に係る日中証拠金所要額は、自己取引口座の算出日の正午時点における清算約定（自己分）について算出した当初証拠金相当額に変動証拠金相当額を加減した額とする。ただし、当社が市場環境の急激な変化が生じた場合その他当社の金利スワップ取引清算業務の適切な遂行を確保する観点から必要と認める場合には、当該額を臨時に変更することができる。</p> <p>b （略）</p> <p>c 上記 a に規定する「<u>変動証拠金</u>相当額」とは、算出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</p>
--	---

<p>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（ユーロ建清算約定にあつては、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つては、午後4時30分）時点をいう。）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、当該算出日の午前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つては、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。</p> <p>d～e （略）</p> <p>(2)～(4) （略）</p> <p>3 債務負担時所要証拠金</p> <p>(1) 清算約定（自己分）に係る債務負担時所要証拠金</p> <p>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について算出した当初証拠金相当額に変動証</p>	<p>いて、清算約定の通貨ごとに、同日の午後3時2分時点（ユーロ建清算約定にあつては、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つては、午後4時30分）時点をいう。）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、当該算出日の午前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つては、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。</p> <p>d～e （略）</p> <p>(2)～(4) （略）</p> <p>3 債務負担時所要証拠金</p> <p>(1) 清算約定（自己分）に係る債務負担時所要証拠金</p> <p>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について算出した当初証拠金相当額に変動証</p>
--	---

<p> <u>抛金・損益差金</u>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抛金等の額（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。 </p> <p>b (略)</p> <p>c 上記aに規定する「<u>変動証抛金・損益差金</u>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分時点の清算イールド・カーブ、午後5時30分から午後7時までの間に債務負担の申込み</p>	<p> 抛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抛金等の額（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。 </p> <p>b (略)</p> <p>c 上記aに規定する「<u>変動証抛金</u>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分時点の清算イールド・カーブ、午後5時30分から午後7時までの間に債務負担の申込みを受領した場</p>
---	--

<p>を受領した場合は、当該申込受領日の午後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。</p> <p>d～e（略） (2)～(4)（略）</p> <p>様式第3号 清算受託契約の様式</p> <p>金利スワップ清算受託契約書</p> <p><u>（損益差金等の授受の申込みを行う場合の適用規定の変更）</u></p> <p><u>第54条 乙が損益差金等の授受の申込みを行う場合、第2条、第9条、第20条、第21条、第22条、第23条、第28条の2、第28条の3、第28条の4、第28条の5、第28条の6、第28条の6の2、第30条、第32条、第36条、第37条、第37条の2及び第38条の規定の適用については、以下のとおりとする。</u></p> <p><u>（1） 第2条第1項第10号の次に以下の二項目を加えて適用する。</u></p> <p><u>（10）の2 本清算委託取引（決済型）」とは、本清算委託取引のうち、清算約定（決済型）の委託清算約定と同一の経済的効果を有するものをいう。</u></p> <p><u>（10）の3 本清算委託取引（担保型）」とは、本清算委託取引のうち、清算約定（担保型）の委託清算約定と同一の経済的効果を有するものをいう。</u></p>	<p>合は、当該申込受領日の午後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。</p> <p>d～e（略） (2)～(4)（略）</p> <p>様式第3号 清算受託契約の様式</p> <p>金利スワップ清算受託契約書</p> <p>（新設）</p>
---	--

- (2) 第9条第1項中「国債証券先物取引の建玉その他本契約」とあるのは、「国債証券先物取引の建玉、損益差金その他本契約」とする。
- (3) 第2節「変動証拠金」とあるのは、「変動証拠金等」とする。
- (4) 第20条、第21条第1項、第22条第1項及び第2項、第28条の2、第28条の4第3項、第28条の6の2第1項、第36条第3項、第37条第2項、第37条の2第2項並びに第38条第2項中「委託清算約定」とあるのは、「清算約定（担保型）の委託清算約定」とする。
- (5) 第23条、第28条の2、第28条の4第3項、第36条第3項、第37条第2項、第37条の2第2項及び第38条第2項中「本清算委託取引」とあるのは、「本清算委託取引（担保型）」とする。
- (6) 第28条の3第4項中「及び乙の間でそれぞれ発生するものとする。」は、「及び乙の間でそれぞれ発生するものとする。この場合において、承継清算参加者及びクリアリング機構の間の権利義務は、清算約定（担保型）の委託清算約定として、承継清算参加者及び乙の間の権利義務は、清算委託取引（担保型）として取扱いを行うものとする。」とする。
- (7) 第28条の5第1項中「同一内容の新たな清算委託取引」とあるのは、「同一内容の清算委託取引（担保型）としての新たな清算委託取引」とする。
- (8) 第28条の6第1項中「同一内容の新たな法律関係」とあるのは、「同一

<p><u>内容の清算委託取引（担保型）としての新たな法律関係」とする。</u></p> <p><u>(9) 第28条の6の2第1項中「同一の経済効果を有する新たな法律関係」とあるのは、「同一の経済効果を有する清算委託取引（担保型）としての新たな法律関係」とする。</u></p> <p><u>(10) 第30条第5項中「清算約定として」とあるのは、「清算約定（担保型）として」とする。</u></p> <p><u>(11) 第32条第1項柱書中「未払いの固定金額及び変動金額の支払債務」とあるのは、「未払いの固定金額、変動金額及び損益差金の支払債務」とする。</u></p> <p><u>2 前項の場合には、第6条の次に以下の一条を加えて次に掲げる各規定を適用する。</u></p> <p><u>(損益差金等の授受の申込み)</u></p> <p><u>第7条 乙は、清算約定（担保型）の委託清算約定に関する損益差金等の授受の申込みの指図又は損益差金等の授受の申込みの撤回の指図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。</u></p> <p><u>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、クリアリング機構に対して当該通知に係る損益差金等の授受の申込み又は損益差金等の授受の申込みの撤回を行うものとする。</u></p> <p><u>3 第1項の場合には、第20条の次に以下の一条を加えて次に掲げる各規定を適用する。</u></p> <p><u>(損益差金)</u></p>	
--	--

第20条の2 甲及び乙は、次の各号に掲げる通貨の清算約定（決済型）の委託清算約定に応じて、当該各号に掲げる日ごとに、清算約定（決済型）の委託清算約定の通貨の損益差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 J S C

C営業日

(2) 外貨建委託清算約定 J S C

C営業日かつ外貨本国営業日である日

2 清算約定（決済型）の委託清算約定に係る損益差金所要額は、業務方法書等の定めるところにより、クリアリング機構が算出するものとし、甲は当該額を乙に対して通知するものとする。

4 第1項の場合には、第21条の次に以下の一条を加えて次に掲げる各規定を適用する。

(損益差金の授受)

第21条の2 乙は、甲が清算約定（決済型）の委託清算約定に係る損益差金をクリアリング機構に交付すべき場合には、当該損益差金に相当する金銭を、当該損益差金の算出日の翌 J S C C営業日（外貨建清算約定に係る損益差金にあつては、当該損益差金の算出日の後最初に到来する J S C C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、乙が当該損益差金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、当該損益差金算出日から起算して翌々 J S C C 営業日（外貨建清算約定に係る損益差金にあつては、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 J S C C 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 甲は、クリアリング機構から清算約定（決済型）の委託清算約定に係る損益差金を受領した場合には、当該損益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。

5 第1項の場合には、第22条の次に以下の一条を加えて次に掲げる各規定を適用する。

（損益差金に係る調整金の授受）

第22条の2 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清算約定（決済型）の委託清算約定に応じて、当該各号に掲げる J S C C 営業日ごとに、清算約定（決済型）の委託清算約定の通貨の損益差金に係る調整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 J S C C 営業日

（2） 外貨建委託清算約定 J S C C 営業日かつ外貨本国営業日である日

2 清算約定（決済型）の委託清算約定の損益差金に係る調整金の額は、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。

3 乙は、甲が損益差金に係る調整金をクリアリング機構に交付すべき場合には、当該損益差金に係る調整金に相当する金銭を、当該損益差金に係る調整金の算出日の翌J S C C営業日（外貨建清算約定の損益差金に係る調整金にあつては、当該損益差金に係る調整金の算出日の後最初に到来するJ S C C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、乙が当該損益差金に係る調整金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、当該損益差金に係る調整金の算出日から起算して翌々J S C C営業日（外貨建清算約定の損益差金に係る調整金にあつては、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J S C C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 甲は、クリアリング機構から損益差金に係る調整金を受領した場合には、当該調整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。

<p><u>(注5) 甲及び乙は、乙が損益差金等の授受の申込みを行わない場合には、本契約から第54条を削除することができる。</u></p>	<p>(新設)</p>
--	-------------

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
<p>(破綻処理清算約定の期限前終了手数料)</p> <p>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つては、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。</p> <p>(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</p> <p>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。</p> <p>a 当該入札対象取引の成立により当社及び清算参加者の間で授受された落札時支払金額（当該破綻処理清算</p>	<p>(破綻処理清算約定の期限前終了手数料)</p> <p>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つては、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。</p> <p>(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</p> <p>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。</p> <p>a 当該入札対象取引の成立により当社及び清算参加者の間で授受された落札時支払金額</p>

<p><u>約定が清算約定（決済型）である場合には、落札時支払金額から破綻清算参加者が当社に交付した当該破綻処理清算約定に係る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。）を控除した額とする。）</u></p> <p>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（<u>変動証拠金及び損益差金を除く。</u>）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。）</p> <p>(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</p> <p>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。</p> <p>a 当該入札対象取引が成立したとすれば当社及び清算参加者の間で授受</p>	<p>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。）</p> <p>(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</p> <p>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。</p> <p>a 当該入札対象取引が成立したとすれば当社及び清算参加者の間で授受</p>
--	---

<p>されるべき落札時支払金額（当該破綻処理清算約定が清算約定（決済型）である場合には、落札時支払金額から破綻清算参加者が当社に交付した当該破綻処理清算約定に係る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。）を控除した額とする。）</p> <p>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（変動証拠金及び損益差金を除く。）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。）</p> <p>（損失回避取引の実施）</p> <p>第7条（略）</p> <p>2～4（略）</p> <p>5 当社と清算参加者の間に損失回避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損失回避取引を行うものであるときは、当該損失回避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<u>清算約定（担保型）</u>の清算約定（委託分）と、当該損失回避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<u>清算約定（担保型）</u>の清算約定（委託分）とみなされる当該損失回避取引に係る清算委託取引（担保型）と、それぞれみなす。</p>	<p>されるべき落札時支払金額</p> <p>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。）</p> <p>（損失回避取引の実施）</p> <p>第7条（略）</p> <p>2～4（略）</p> <p>5 当社と清算参加者の間に損失回避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損失回避取引を行うものであるときは、当該損失回避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、当該損失回避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）とみなされる当該損失回避取引に係る清算委託取引と、それぞれみなす。</p>
---	--

<p>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<u>清算約定（担保型）</u>の清算約定（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<u>清算約定（担保型）</u>の清算約定（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<u>（担保型）</u>と、それぞれみなす。</p> <p>（清算約定（委託分）の承継）</p> <p>第8条 （略）</p> <p>2～4 （略）</p> <p>5 業務方法書第9 4条第5項に規定する承継時支払金額、未払債務、<u>変動証拠金及び損益差金</u>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。</p> <p>（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9 4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。）<u>（当該対象清算約定が清算</u></p>	<p>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。</p> <p>（清算約定（委託分）の承継）</p> <p>第8条 （略）</p> <p>2～4 （略）</p> <p>5 業務方法書第9 4条第5項に規定する承継時支払金額、未払債務<u>及び変動証拠金</u>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。</p> <p>（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9 4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</p>
--	---

<p><u>約定（決済型）である場合には、破綻認定日までに清算委託者が破綻清算参加者に交付した破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとの損益差金の差引累計額（当該通貨の種類ごとの損益差金の総支払額から総受取額を控除した額をいう。）とする。）</u>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。</p> <p>(2) (略)</p> <p>(3) <u>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及び損益差金の額</u>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及び損益差金の額とする。</p> <p>6 (略)</p> <p>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、<u>変動証拠金及び損益差金</u>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、<u>変動証拠金及び損益差金</u></p>	<p>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。</p> <p>(2) (略)</p> <p>(3) <u>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。</u></p> <p>6 (略)</p> <p>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<u>及び変動証拠金</u>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<u>及び変動証拠金</u>については、業務方法書</p>
---	--

<p>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。)</p> <p>8 (略)</p> <p>(受託清算参加者の破綻処理入札の参加)</p> <p>第13条 (略)</p> <p>2 (略)</p> <p>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<u>清算約定(担保型)</u>の清算約定(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<u>清算約定(担保型)</u>の清算約定(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<u>(担保型)</u>と、それぞれみなす。</p> <p>(入札対象取引の成立に伴う落札時支払金額等の授受)</p> <p>第14条 (略)</p> <p>2 当社及び清算参加者は、業務方法書第99条及び本規則第12条の規定により成立した入札対象取引について、次に定めるところにより、業務方法書第99条第2項の規定による落札時支払金額、<u>変動証拠金及び損益差金</u>の授受を行う。</p> <p>(1) (略)</p> <p>(2) 変動証拠金の額は、当該入札対象取引が新たな清算約定<u>(担保型)</u>として破綻処理入札実施日に成立したと仮定した場合において、その翌当社営業日に授受されるべき変動証拠金の額とする。</p>	<p>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。)</p> <p>8 (略)</p> <p>(受託清算参加者の破綻処理入札の参加)</p> <p>第13条 (略)</p> <p>2 (略)</p> <p>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。</p> <p>(入札対象取引の成立に伴う落札時支払金額等の授受)</p> <p>第14条 (略)</p> <p>2 当社及び清算参加者は、業務方法書第99条及び本規則第12条の規定により成立した入札対象取引について、次に定めるところにより、業務方法書第99条第2項の規定による落札時支払金額<u>及び</u>変動証拠金の授受を行う。</p> <p>(1) (略)</p> <p>(2) 変動証拠金の額は、当該入札対象取引が新たな清算約定として破綻処理入札実施日に成立したと仮定した場合において、その翌当社営業日に授受されるべき変動証拠金の額とする。</p>
--	--

<p>(3) <u>損益差金の額は、当該入札対象取引が新たな清算約定（決済型）として破綻処理入札実施日に成立したと仮定した場合において、その翌当社営業日に授受されるべき損益差金の額とする。</u></p> <p>(4) 当社及び当該清算参加者は、前3号の落札時支払金額、<u>変動証拠金及び損益差金</u>を差引計算した残額を、破綻処理入札実施日の翌当社営業日に授受する。</p> <p>(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、<u>損益差金、損益差金に係る調整金、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。</u></p> <p>(破綻処理損失から除くべき損失等) 第19条 (略) 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、<u>変動金額、損益差金</u>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ゲン処分取引について当社及び清算</p>	<p>(新設)</p> <p>(3) 当社及び当該清算参加者は、前2号の落札時支払金額<u>及び変動証拠金</u>を差引計算した残額を、破綻処理入札実施日の翌当社営業日に授受する。</p> <p>(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。</p> <p>(破綻処理損失から除くべき損失等) 第19条 (略) 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、<u>変動金額</u>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ゲン処分取引について当社及び清算参加者の間</p>
---	--

<p>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応する当社の損失とする。</p> <p>3～5 （略）</p> <p style="text-align: center;">付 則</p> <p>この改正規定は、平成28年12月19日から施行する。</p>	<p>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応する当社の損失とする。</p> <p>3～5 （略）</p>
---	---