

決済保証準備金の再充填に係る業務方法書の取扱い等の一部改正について

I. 改正趣旨

昨年7月にCPMI-IOSCOが公表したFMI原則に関する追加ガイダンス（再建に係るガイダンスを含む。）において、清算参加者の破綻に伴う損失によって清算機関が拠出する損失補償財源を費消した場合の再充填が求められていることを踏まえ、当社の各清算業務における規則に、当社が拠出する損失補償財源である決済保証準備金の再充填について規定する。

併せて、証券取引等清算業務における規則において、決済保証準備金の額を規定する等、所要の改正を行う。

II. 改正概要

- | | |
|---|---|
| <ul style="list-style-type: none">業務方法書等の定めるところにより決済保証準備金の一部又は全部を取り崩した場合の、再充填に係る規定を新設する。証券取引等清算業務における決済保証準備金の額を規定するとともに、CDS清算業務における決済保証準備金の額を変更する。 | <p>(備考)</p> <ul style="list-style-type: none">業務方法書取扱い第20条の11第2項、CDS清算業務に関する清算参加者の破綻処理に関する規則第3条第2項等、金利スワップ取引清算業務に関する清算参加者の破綻処理に関する規則第3条第2項等、国債店頭取引清算業務に関する清算参加者の破綻処理に関する規則第3条第2項等業務方法書取扱い第20条の11第1項、CDS清算業務に関する清算参加者の破綻処理に関する規則第3条第1項等 |
|---|---|

III. 施行日

2018年6月18日から施行する。

以上

業務方法書の取扱い等の一部改正新旧対照表

目 次

	(ページ)
1. 業務方法書の取扱いの一部改正新旧対照表	2
2. C D S 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	3
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	5
4. 国債店頭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	8

業務方法書の取扱いの一部改正新旧対照表

新	旧
<p>(証券取引等決済保証準備金の積立て等)</p> <p>第20条の11 当社は、証券取引等決済保証準備金として<u>200億円を積み立てる。</u></p> <p>2 業務方法書等の定めるところにより証券取引等決済保証準備金の全部又は一部が取り崩された場合には、<u>当社は、その都度、取り崩された額と同額を証券取引等決済保証準備金として積み立てる。本項の規定に基づく積立ての累計額は、200億円を上限とする。</u></p> <p style="text-align: center;">付 則</p> <p>この改正規定は、平成30年6月18日から施行する。</p>	<p>(証券取引等決済保証準備金の積立て等)</p> <p>第20条の11 当社は、<u>各事業年度の終了後、証券取引等清算業務に係る利益のうち当社がその都度定める額を、証券取引等決済保証準備金として積み立てる。</u></p> <p>2 業務方法書等の定めるところにより証券取引等決済保証準備金の全部又は一部が取り崩された場合には、<u>その取り崩された額を証券取引等決済保証準備金の積立額から減じる。</u></p>

CDS清算業務に関する清算参加者の破綻処理に関する規則の一部改正新旧対照表

新	旧
<p>(第一階層CDS決済保証準備金の積立て等)</p> <p>第3条 当社は、第一階層CDS決済保証準備金として<u>15億円</u>を積み立てる。</p> <p>(削る)</p> <p><u>2 本業務方法書等の定めるところにより第一階層CDS決済保証準備金の全部又は一部が取り崩された場合には、当社は、その都度、取り崩された額と同額を第一階層CDS決済保証準備金として積み立てる。本項の規定に基づく積立ての累計額は、15億円を上限とする。</u></p>	<p>(第一階層CDS決済保証準備金の積立て等)</p> <p>第3条 当社は、<u>CDS清算業務の開始に際し、20億円を、</u>第一階層CDS決済保証準備金として積み立てる。</p> <p><u>2 当社は、各事業年度の終了後、CDS清算業務に係る利益のうち当社がその都度定める額を、第一階層CDS決済保証準備金として積み立てる。</u></p> <p><u>3 本業務方法書等の定めるところにより第一階層CDS決済保証準備金の全部又は一部が取り崩された場合には、その取り崩された額を第一階層CDS決済保証準備金の額から減じる。</u></p>
<p>(第二階層CDS決済保証準備金の積立て等)</p> <p>第4条 当社は、第二階層CDS決済保証準備金として<u>5億円</u>を積み立てる。</p> <p>(削る)</p> <p><u>2 本業務方法書等の定めるところにより第二階層CDS決済保証準備金の全部又は一部が取り崩された場合には、当社は、その都度、取り崩された額と同額を第二階層CDS決済保証準備金として積み立てる。本項の規定に基づく積立ての累計額は、5億円を上限とする。</u></p>	<p>(第二階層CDS決済保証準備金の積立て等)</p> <p>第4条 当社は、<u>10億円を、</u>第二階層CDS決済保証準備金として積み立てる。</p> <p><u>2 当社は、各事業年度の終了後、CDS清算業務に係る利益のうち当社がその都度定める額を、第二階層CDS決済保証準備金として積み立てる。</u></p> <p><u>3 前2項の規定にかかわらず、本業務方法書等の定めるところにより第二階層CDS決済保証準備金の全部又は一部が取り崩された場合には、その取り崩された額を第二階層CDS決済保証準備金の額から減じる。</u></p>
<p>(回収金等の分配を受ける清算参加者が存在しない場合の取扱い)</p> <p>第35条 当社は、業務方法書第111条第1項各号の額の分配を受ける清算参加者が存在しない場合には、次の各号に掲げる順序に従い、当該各号の定めるところにより当該額からその回収等</p>	<p>(回収金等の分配を受ける清算参加者が存在しない場合の取扱い)</p> <p>第35条 当社は、業務方法書第111条第1項各号の額の分配を受ける清算参加者が存在しない場合には、次の各号に掲げる順序に従い、当該各号の定めるところにより当該額からその回収等</p>

に要した諸費用を控除した残額を処理するものとする。

(1) 当社は、当該残額を、関連する破綻処理単位期間に係る取崩しについて第4条第2項の規定により当社が第二階層CDS決済保証準備金として積み立てた額に満つるまで、第二階層CDS決済保証準備金として積み立てる。この場合、当該積立額につき、同項の規定による第二階層CDS決済保証準備金の積立は行われなかったものとみなす。

(2) 当社は、前号による積立て後の残額を、第二階層CDS決済保証準備金の積立額が5億円に満つるまで、第二階層CDS決済保証準備金として積み立てる。

(3) 当社は、前2号による積立て後の残額を、関連する破綻処理単位期間に係る取崩しについて第3条第2項の規定により当社が第一階層CDS決済保証準備金として積み立てた額に満つるまで、第一階層CDS決済保証準備金として積み立てる。この場合、当該積立額につき、同項の規定による第一階層CDS決済保証準備金の積立は行われなかったものとみなす。

(4) 当社は、前3号による積立て後の残額を、第一階層CDS決済保証準備金として積み立てる。

付 則

この改正規定は、平成30年6月18日から施行する。

に要した諸費用を控除した残額を処理するものとする。

(新設)

(1) 当社は、当該残額を、金20億円に満つるまで、第二階層CDS決済保証準備金として積み立てる。

(新設)

(2) 当社は、前号の積立て後の残額を、第一階層CDS決済保証準備金として積み立てる。

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>(第一階層金利スワップ決済保証準備金の積立て等)</p> <p>第3条 当社は、第一階層金利スワップ決済保証準備金として<u>20億円</u>を積み立てる。</p> <p>(削る)</p> <p><u>2 本業務方法書等の定めるところにより第一階層金利スワップ決済保証準備金の全部又は一部が取り崩された場合には、当社は、その都度、取り崩された額と同額を第一階層金利スワップ決済保証準備金として積み立てる。本項の規定に基づく積立ての累計額は、20億円を上限とする。</u></p>	<p>(第一階層金利スワップ決済保証準備金の積立て等)</p> <p>第3条 当社は、<u>金利スワップ取引清算業務の開始に際し、20億円を、第一階層金利スワップ決済保証準備金として積み立てる。</u></p> <p><u>2 当社は、各事業年度の終了後、金利スワップ取引清算業務に係る利益のうち当社がその都度定める額を、第一階層金利スワップ決済保証準備金として積み立てる。</u></p> <p><u>3 本業務方法書等の定めるところにより第一階層金利スワップ決済保証準備金の全部又は一部が取り崩された場合には、その取り崩された額を第一階層金利スワップ決済保証準備金の額から減じる。</u></p>
<p>(第二階層金利スワップ決済保証準備金の積立て等)</p> <p>第4条 当社は、第二階層金利スワップ決済保証準備金として<u>20億円</u>を積み立てる。</p> <p>2 本業務方法書等の定めるところにより第二階層金利スワップ決済保証準備金の全部又は一部が取り崩された場合には、<u>当社は、その都度、取り崩された額と同額を第二階層金利スワップ決済保証準備金として積み立てる。本項の規定に基づく積立ての累計額は、20億円を上限とする。</u></p>	<p>(第二階層金利スワップ決済保証準備金の積立て等)</p> <p>第4条 当社は、<u>金利スワップ取引清算業務の開始に際し、20億円を、第二階層金利スワップ決済保証準備金として積み立てる。</u></p> <p>2 本業務方法書等の定めるところにより第二階層金利スワップ決済保証準備金の全部又は一部が取り崩された場合には、<u>その取り崩された額を第二階層金利スワップ決済保証準備金の額から減じる。</u></p>
<p>(破綻処理損失から除くべき損失等)</p> <p>第19条 (略)</p> <p>2 (略)</p> <p>3 業務方法書第103条第1項第1号に規定する第一階層金利スワップ決済保証準備金を通貨</p>	<p>(破綻処理損失から除くべき損失等)</p> <p>第19条 (略)</p> <p>2 (略)</p> <p>3 業務方法書第103条第1項第1号に規定する第一階層金利スワップ決済保証準備金を通貨</p>

の種類ごとに按分した額は、第一階層金利スワップ決済保証準備金の全額（第一階層金利スワップ決済保証準備金が本業務方法書等の定めるところにより取り崩された場合には、当該取り崩された後の残額）を、破綻処理入札実施日（同一の破綻処理清算約定に関して複数の破綻処理入札が行われる場合は、当該破綻処理入札のうち最初に到来する破綻処理入札実施日）の前当社営業日における通貨の種類ごとの破綻処理清算約定について算出した当初証拠金所要額相当額に応じて按分した額とする。

4・5（略）

（回収金等の分配を受ける清算参加者が存在しない場合の取扱い）

第30条 当社は、業務方法書第111条第1項各号の額の分配を受ける清算参加者が存在しない場合には、次の各号に掲げる順序に従い、当該各号の定めるところにより当該額からその回収等に要した諸費用を控除した残額を処理するものとする。

（1） 当社は、当該残額を、関連する破綻処理単位期間に係る取崩しについて第4条第2項の規定により当社が第二階層金利スワップ決済保証準備金として積み立てた額に満つるまで、第二階層金利スワップ決済保証準備金として積み立てる。この場合、当該積立額につき、同項の規定による第二階層金利スワップ決済保証準備金の積立は行われなかったものとみなす。

（2） 当社は、前号による積立て後の残額を、第二階層金利スワップ決済保証準備金の積立額が20億円に満つるまで、第二階層金利スワップ決済保証準備金として積み立てる。

（3） 当社は、前2号による積立て後の残額を、関連する破綻処理単位期間に係る取崩しにつ

の種類ごとに按分した額は、第一階層金利スワップ決済保証準備金の全額（第一階層金利スワップ決済保証準備金が第3条第3項の規定により減じられている場合には、当該減じられた後の残額）を、破綻処理入札実施日（同一の破綻処理清算約定に関して複数の破綻処理入札が行われる場合は、当該破綻処理入札のうち最初に到来する破綻処理入札実施日）の前当社営業日における通貨の種類ごとの破綻処理清算約定について算出した当初証拠金所要額相当額に応じて按分した額とする。

4・5（略）

（回収金等の分配を受ける清算参加者が存在しない場合の取扱い）

第30条 当社は、業務方法書第111条第1項各号の額の分配を受ける清算参加者が存在しない場合には、次の各号に掲げる順序に従い、当該各号の定めるところにより当該額からその回収等に要した諸費用を控除した残額を処理するものとする。

（新設）

（1） 当社は、当該残額を、金20億円に満つるまで、第二階層金利スワップ決済保証準備金として積み立てる。

（新設）

いて第3条第2項の規定により当社が第一階層金利スワップ決済保証準備金として積み立てた額に満つるまで、第一階層金利スワップ決済保証準備金として積み立てる。この場合、当該積立額につき、同項の規定による第一階層金利スワップ決済保証準備金の積立ては行われなかったものとみなす。

(4) 当社は、前3号による積立て後の残額を、第一階層金利スワップ決済保証準備金として積み立てる。

付 則

この改正規定は、平成30年6月18日から施行する。

(2) 当社は、前号の積立て後の残額を、第一階層金利スワップ決済保証準備金として積み立てる。

国債店頭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>(第一階層国債店頭取引決済保証準備金の積立て等)</p> <p>第3条 当社は、第一階層国債店頭取引決済保証準備金として<u>17億5,000万円</u>を積み立てる。</p> <p>(削る)</p> <p>2 本業務方法書等の定めるところにより第一階層国債店頭取引決済保証準備金の全部又は一部が取り崩された場合には、<u>当社は、その都度、取り崩された額と同額を第一階層国債店頭取引決済保証準備金として積み立てる。本項の規定に基づく積立ての累計額は、17億5,000万円を上限とする。</u></p> <p>(第二階層国債店頭取引決済保証準備金の積立て等)</p> <p>第4条 当社は、第二階層国債店頭取引決済保証準備金として<u>17億5,000万円</u>を積み立てる。</p> <p>2 本業務方法書等の定めるところにより第二階層国債店頭取引決済保証準備金の全部又は一部が取り崩された場合には、<u>当社は、その都度、取り崩された額と同額を第二階層国債店頭取引決済保証準備金として積み立てる。本項の規定に基づく積立ての累計額は、17億5,000万円を上限とする。</u></p> <p>(回収金等の分配を受ける清算参加者が存在しない場合の取扱い)</p> <p>第37条 当社は、業務方法書第84条第1項各号</p>	<p>(第一階層国債店頭取引決済保証準備金の積立て等)</p> <p>第3条 当社は、<u>本規則の施行に際し、17億5,000万円を、第一階層国債店頭取引決済保証準備金として積み立てる。</u></p> <p>2 <u>当社は、各事業年度の終了後、国債店頭取引清算業務に係る利益のうち当社がその都度定める額を、第一階層国債店頭取引決済保証準備金として積み立てる。</u></p> <p>3 本業務方法書等の定めるところにより第一階層国債店頭取引決済保証準備金の全部又は一部が取り崩された場合には、<u>その取り崩された額を第一階層国債店頭取引決済保証準備金の額から減じる。</u></p> <p>(第二階層国債店頭取引決済保証準備金の積立て等)</p> <p>第4条 当社は、<u>本規則の施行に際し、17億5,000万円を、第二階層国債店頭取引決済保証準備金として積み立てる。</u></p> <p>2 本業務方法書等の定めるところにより第二階層国債店頭取引決済保証準備金の全部又は一部が取り崩された場合には、<u>その取り崩された額を第二階層国債店頭取引決済保証準備金の額から減じる。</u></p> <p>(回収金等の分配を受ける清算参加者が存在しない場合の取扱い)</p> <p>第37条 当社は、業務方法書第84条第1項各号</p>

の額の分配を受ける清算参加者が存在しない場合には、次の各号に掲げる順序に従い、当該各号の定めるところにより当該額からその回収等に要した諸費用を控除した残額を処理するものとする。

(1) 当社は、当該残額を、関連する破綻処理単位期間に係る取崩しについて第4条第2項の規定により当社が第二階層国債店頭取引決済保証準備金として積み立てた額に満つるまで、第二階層国債店頭取引決済保証準備金として積み立てる。この場合、当該積立額につき、同項の規定による第二階層国債店頭取引決済保証準備金の積立ては行われなかったものとみなす。

(2) 当社は、前号による積立て後の残額を、第二階層国債店頭取引決済保証準備金の積立額が17億5,000万円に満つるまで、第二階層国債店頭取引決済保証準備金として積み立てる。

(3) 当社は、前2号による積立て後の残額を、関連する破綻処理単位期間に係る取崩しについて第3条第2項の規定により当社が第一階層国債店頭取引決済保証準備金として積み立てた額に満つるまで、第一階層国債店頭取引決済保証準備金として積み立てる。この場合、当該積立額につき、同項の規定による第一階層国債店頭取引決済保証準備金の積立ては行われなかったものとみなす。

(4) 当社は、前3号による積立て後の残額を、第一階層国債店頭取引決済保証準備金として積み立てる。

付 則

この改正規定は、平成30年6月18日から施行する。

の額の分配を受ける清算参加者が存在しない場合には、次の各号に掲げる順序に従い、当該各号の定めるところにより当該額からその回収等に要した諸費用を控除した残額を処理するものとする。

(新設)

(1) 当社は、当該残額を、17億5,000万円に満つるまで、第二階層国債店頭取引決済保証準備金として積み立てる。

(新設)

(2) 当社は、前号の積立て後の残額を、第一階層国債店頭取引決済保証準備金として積み立てる。

--	--