

「CDS 清算基金所要額に関する規則」の一部改正について

I. 改正趣旨

当社は、FMI 原則の追加ガイダンスを踏まえたリスク管理制度見直しの一環として、CDS 取引に係る清算基金所要額の算出頻度を現行の週次から日次に変更するため、CDS 清算基金所要額に関する規則について、別紙のとおり所要の改正を行う。

II. 改正概要

1. 清算基金の所要額算出期間の見直し

- ・ CDS 取引に係る清算基金所要額の算出頻度を現行の週次から日次に変更する。

2. その他

- ・ その他、所要の改正を行う。

(備 考)

- ・ CDS 清算基金所要額に関する規則第 2 条等

III. 施行日

2018年9月25日から施行する。

以 上

CDS清算基金所要額に関する規則の一部改正新旧対照表

新	旧
<p>(CDS清算基金所要額)</p> <p>第2条 各清算参加者に係るCDS清算基金所要額は、<u>毎営業日</u>、別表「CDS清算基金所要額の算出に関する表」により算出する額とする。ただし、当社は、当該清算参加者が合併する場合その他必要と認める場合に限り、CDS清算基金所要額を臨時に変更することができる。</p> <p>2 (略)</p> <p style="text-align: center;">付 則</p> <p>1 この改正規定は、平成30年9月25日から施行する。</p> <p>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、平成30年9月25日以後の当社が定める日から施行する。</p> <p>別表 CDS清算基金所要額の算出に関する表</p> <p>各清算参加者に係るCDS清算基金所要額は、CDS清算基金算出日 (<u>CDS清算基金所要額の算出を行う日</u>をいう。以下同じ。)において、次のaに定めるCDS清算基金基礎基準額とbに定めるストレス時想定損失負担額のうちいずれか大きい額 (これらの額がいずれも1億円を下回る場合には1億円) とする。</p>	<p>(CDS清算基金所要額)</p> <p>第2条 各清算参加者に係るCDS清算基金所要額は、別表「CDS清算基金所要額の算出に関する表」により算出する額とする。ただし、当社は、当該清算参加者が合併する場合その他必要と認める場合に限り、CDS清算基金所要額を臨時に変更することができる。</p> <p>2 (略)</p> <p>別表 CDS清算基金所要額の算出に関する表</p> <p>各清算参加者に係るCDS清算基金所要額は、CDS清算基金算出日 (<u>債務負担処理期間(CDS清算業務に関する業務方法書の取扱い第35条第2項に規定する債務負担処理期間</u>をいう。以下同じ。))における第3当社営業日(当社が通知により別に定める場合を除く。)をいう。以下同じ。)において、次のaに定めるCDS清算基金基礎基準額とbに定めるストレス時想定損失負担額のうちいずれか大き</p>

a・b (略)

い額（これらの額がいずれも1億円を下回る場合には1億円）とし、当該額を当該CDS清算基金算出日からその直後の清算基金算出日の前日まで適用する。

a・b (略)