

**コンプレッション制度の機能向上等に伴う
「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

当社は、金利スワップ取引に係る清算業務に関し、債務負担済取引の残高圧縮機能（コンプレッション機能）について、より高い利便性を提供するため、当社が解約内容等を提案する方式でのコンプレッション機能（以下「JSCC提案型コンプレッション」という。）を導入するとともに、当社の清算参加者等の利便性の向上を図るため、TIBOR取引に係る残存期間を拡大し、また、円建て金利スワップの前後スタブ付取引を清算対象とするため、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。

また、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、金利スワップ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、金利スワップ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

（備考）

1. JSCC提案型コンプレッション

(1). 申込み等

- ・ JSCC提案型コンプレッションの利用を希望する清算参加者は、当社に対して、事前に利用に係る意思表示を行ったうえで、JSCC提案型コンプレッションの対象取引を選定し当社に申込みを行い又は必要に応じて撤回を行う。

- ・ 金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書（以下「IRS業務方法書」という。）第53条の2の4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30条の4の2等

(2). コンプレッションの実施等

- ・ 当社は、清算参加者から申込みを受けた対象取引等に基づき、JSCC提案型コンプレッションにより終了する清算約定及び新たに成立する清算約定の内容について、清算参加者に対して提示する。
- ・ 清算参加者は、JSCC提案型コンプレッション実施日の前当社営業日に提示される提案内容を確認の上、JSCC提案型コンプレッションへの参加に係る承諾を当社に行う。
- ・ JSCC提案型コンプレッションの申込みを行ったすべての清算参加者から当社に対して当該承諾がなされた場合、当社は、証拠金預託額の十分性等のJSCC提案型コンプレッション成立要件を充足していることを確認したうえで、JSCC提案型コンプレッションを成立させる。

- ・ IRS業務方法書第53条の2の4等
- ・ IRS業務方法書の取扱い第30条の4の2等

- ・ J S C C 提案型コンプレッションの成立により、取引の一部を満期到来前に解約するとともに、新規の清算約定（担保型）を成立させる。
- ・ J S C C 提案型コンプレッションに係る解約手数料は、コンプレッション成立日の翌々当社営業日に、当社と該当する清算参加者との間で授受する。

(3)．清算委託者が行う清算約定（委託分）に関する申込み等

- ・ 清算委託者は、清算参加者に対して J S C C 提案型コンプレッションへの利用に係る意思表示、対象取引の申込み、当該申込みの撤回、又は承諾に係る指図を行うものとする。
- ・ 清算参加者は、当該指図に基づき、当社に対して清算委託者の利用に係る意思表示等を行うものとする。

- ・ I R S 業務方法書第 5 7 条の 5 等
- ・ I R S 業務方法書の取扱い第 3 0 条の 4 の 2 等

(4)．コンプレッション手数料

- ・ 清算参加者又は清算委託者ごとに、J S C C 提案型コンプレッションにより解約された取引の件数から新規に成立する清算約定の件数を削減した件数 1 件につき、以下のとおりの金額とする。

- ・ 金利スワップ取引清算業務に係る手数料に関する規則第 5 条等

| 対象件数 | 適用手数料 (1 件あたり) |
|---------------------------|-------------------|
| 2, 5 0 0 件以内 | 6, 0 0 0 円 |
| 2, 5 0 1 件以上 5, 0 0 0 件以内 | 3, 6 0 0 円 |
| 5, 0 0 1 件以上 | 1, 2 0 0 円 |

- ・ 各段階の対象件数部分に対して、その段階の手数料が適用される。
(対象件数の計算は、1 計算年度（4 月から翌年 3 月まで）ごとに実施する。)
- ・ 株主清算参加者及びそのアフィリエイトにあつては、上記の料金について、コンプレッション手数料の年度上限額を適用する。

2. 円建て金利スワップの清算対象の拡大

- ・ 日本円 T I B O R (D-T I B O R) の清算対象取引に係る残存期間を 2 0 年まで拡大し、ユーロ円 T I B O R (Z-T I B O R) の清算対象取引に係る残存期間を 3 0 年まで拡大する。
- ・ 円建て金利スワップの前後スタブ付取引について、清算対象とする。

- ・ I R S 業務方法書の取扱い第 9 条等

3. 清算基金の所要額算出期間の見直し

- ・金利スワップ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。

- ・金利スワップ清算基金所要額に関する規則第2条等

4. その他

- ・その他、所要の改正を行う。

Ⅲ. 施行日

2018年9月25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 | 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 | 5 |
| 3. 金利スワップ取引清算業務に係る手数料に関する規則の一部改正新旧対照表 | 1 4 |
| 4. 金利スワップ清算基金所要額に関する規則の一部改正新旧対照表 | 1 7 |

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)～(4) (略)</p> <p>(4)の2 「解約手数料」とは、一括コンプレッション、参加者提案型コンプレッション又は<u>JSCC提案型コンプレッション</u>により清算約定がその終了日前に終了した場合において、当社と当該清算約定の当事者である清算参加者との間で授受される金銭をいう。</p> <p>(4)の3～(72) (略)</p> <p><u>(72)の2 「JSCC提案型コンプレッション」とは、第53条の2の4の規定に基づき、当社が定める方法により、二以上の清算参加者又は清算委託者に係る清算約定についてコンプレッションを行うことをいう。</u></p> <p>(73) (略)</p> <p>2・3 (略)</p> <p><u>(清算約定のJSCC提案型コンプレッション)</u></p> <p><u>第53条の2の4 清算参加者は、清算約定についてJSCC提案型コンプレッションを行おうとする場合には、当社が定めるところにより、あらかじめ当社にその旨の意思表示をするものとする。</u></p> <p><u>2 前項に規定する意思表示を行った清算参加者は、JSCC提案型コンプレッションを行おうとする清算約定について、当社が定める方法により申込みを行う。</u></p> <p><u>3 当社は、前項の規定によりJSCC提案型コンプレッションの申込みを受けた場合、当該申込み内容に基づき当社が提案するコンプレッションにより終了する清算約定及び新たに成立する清</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>(1)～(4) (略)</p> <p>(4)の2 「解約手数料」とは、一括コンプレッション又は参加者提案型コンプレッションにより清算約定がその終了日前に終了した場合において、当社と当該清算約定の当事者である清算参加者との間で授受される金銭をいう。</p> <p>(4)の3～(72) (略)</p> <p>(新設)</p> <p>(73) (略)</p> <p>2・3 (略)</p> <p>(新設)</p> |

算約定の内容を、当該清算約定の当事者である清算参加者に対して通知する。

4 当社は、前項に規定する提案内容について、第2項に規定するJ S C C提案型コンプレッションの申込みを行ったすべての清算参加者から当社に対して、当社の定める方法による承諾がなされた場合において、当該申込みに係る清算約定及びJ S C C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がJ S C C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「J S C C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、J S C C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、J S C C提案型コンプレッションの提案内容に従い清算約定を終了させ、新たな清算約定を、清算約定（担保型）として成立させる。

5 前項の規定により終了した清算約定に基づく債権債務（当社が定めるものを除く。）は、将来に向かって消滅する。

6 当社は、第4項に規定する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時点で、J S C C提案型コンプレッション成立要件を満たしていない場合、J S C C提案型コンプレッションを行わないものとする。

7 清算参加者は、第2項の規定によるJ S C C提案型コンプレッションの申込みについて、当社が定める方法により、J S C C提案型コンプレッションの申込みを撤回することができる。

8 第4項の規定により終了した清算約定に係る当事者は、当社が定めるところにより当社との間で解約手数料として金銭を授受するものとする。

9 前各項に規定するほか、清算約定のJ S C C提案型コンプレッションに必要な事項は、当社が定める。

| | |
|--|-------------|
| <p><u>(清算委託者が行う清算約定(委託分)に関するJ S C C提案型コンプレッションの申込み等)</u></p> <p><u>第57条の5 清算委託者は、清算約定(委託分)について、J S C C提案型コンプレッションの利用に係る意思表示の指図、J S C C提案型コンプレッションを行う清算約定(委託分)の申込みの指図、当該申込みの撤回の指図又はJ S C C提案型コンプレッションに係る承諾の指図を行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53条の2の4第1項、第2項、第4項又は第7項の規定に従い、当該通知に係る清算約定(委託分)について当社に対してJ S C C提案型コンプレッションの利用に係る意思表示、J S C C提案型コンプレッションを行う清算約定(委託分)の申込み、当該申込みの撤回又はJ S C C提案型コンプレッションに係る承諾を行うものとする。</u></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>(新設)</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>(適格金利スワップ取引の要件)</p> <p>第9条 業務方法書第2条第1項第47号に規定する当社が定める要件は、次に掲げるすべての要件(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金利スワップ取引及び損失回避取引については、第1号を除くすべての要件)とする。</p> <p>(1)～(8) 略</p> <p>(9) 債務負担の申込みの日における終了日までの期間について、次のaからdまでに掲げる金利スワップ取引ごとに、当該aからdまでに定める期間であること。</p> <p>a 変動金利としてAUD-BBR-BBSWであるものを対象とする金利スワップ取引 3日以上3,666日以内</p> <p>b 変動金利として<u>JPY-TIBOR-17097</u>、EUR-EURIBOR-Telemate又はEUR-EURIBOR-Reutersであるものを対象とする金利スワップ取引 3日以上7,318日以内</p> <p>c 変動金利として<u>JPY-TIBOR-ZTIBOR</u>又はUSD-LIBOR-BBAであるものを対象とする金利スワップ取引(当該取引のうち、前bに掲げる取引に該当するものを除く。) 3日以上10,971日以内</p> <p>d (略)</p> | <p>(適格金利スワップ取引の要件)</p> <p>第9条 業務方法書第2条第1項第47号に規定する当社が定める要件は、次に掲げるすべての要件(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金利スワップ取引及び損失回避取引については、第1号を除くすべての要件)とする。</p> <p>(1)～(8) 略</p> <p>(9) 債務負担の申込みの日における終了日までの期間について、次のaからdまでに掲げる金利スワップ取引ごとに、当該aからdまでに定める期間であること。</p> <p>a 変動金利として<u>JPY-TIBOR-17097</u>又はAUD-BBR-BBSWであるものを対象とする金利スワップ取引 3日以上3,666日以内</p> <p>b 変動金利として<u>JPY-TIBOR-ZTIBOR</u>、EUR-EURIBOR-Telemate又はEUR-EURIBOR-Reutersであるものを対象とする金利スワップ取引(当該取引のうち、前aに掲げる取引に該当するものを除く。) 3日以上7,318日以内</p> <p>c 変動金利としてUSD-LIBOR-BBAであるものを対象とする金利スワップ取引 3日以上10,971日以内</p> <p>d (略)</p> |

(損益差金等の授受の申込みの方法等)

第29条の2 (略)

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。

(清算約定のJSCC提案型コンプレッションの申込みの方法等)

第30条の4の2 業務方法書第53条の2の4第1項に規定する当社への意思表示は、清算参加者が、JSCC提案型コンプレッションを

(損益差金等の授受の申込みの方法等)

第29条の2 (略)

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。

(新設)

行おうとする清算約定（清算約定（自己分）及び清算委託者（受託清算参加者と同一の企業集団に含まれる者に限る。）に係る清算約定（委託分）とする。）について、当社所定の書面を当社がその都度指定するときまでに当社に提出する方法により行うものとする。

2 業務方法書第53条の2の4第2項及び第7項に規定する当社が定める方法は、JSCC提案型コンプレッションを行おうとする自己取引口座又は委託取引口座に記録されている清算約定を、金利スワップ取引清算業務システムを用いて指定する方法とする。

3 業務方法書第53条の2の4第4項に規定する当社の定める方法は、清算参加者が、JSCC提案型コンプレッション成立要件を確認する日の午前10時までに当社所定の書面を当社に提出する方法とする。

4 業務方法書第53条の2の4第4項に規定する当社の定める条件は、次に定めるとおりとする。

(1) JSCC提案型コンプレッションの申込みに係る清算約定及びJSCC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、固定金利と変動金利を交換する想定元本の金額が一定の円貨建清算約定であること

(2) JSCC提案型コンプレッション成立要件の確認を行う日からその翌当社営業日までの日が、JSCC提案型コンプレッションの申込みに係る清算約定及びJSCC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の金利支払日にあたらないこと。

(3) JSCC提案型コンプレッションの申込みに係る清算約定及びJSCC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のアップフロントフィーの決済日が、JSCC提案型コンプレッションの利用に係る意思表示の期限日以前であること。

(4) JSCC提案型コンプレッションの申

込みに係る清算約定が、当社がその都度指定するときまでに債務負担されたものであること

(5) J S C C 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第9条に規定する適格金利スワップ取引の要件（同条第1項第3号に掲げるものを除く。）を満たすこと。

5 当社は、業務方法書第53条の2の4第4項の規定による J S C C 提案型コンプレッション成立要件の確認を、当社が通知により定める日の午後4時以降速やかに行うものとする。

6 業務方法書第53条の2の4第8項に規定する解約手数料は、J S C C 提案型コンプレッションが成立した翌々当社営業日に当社と J S C C 提案型コンプレッションにより終了した清算約定の当事者である清算参加者との間で授受するものとする。

7 当社は、業務方法書第53条の2の4第4項に規定する 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時点で、J S C C 提案型コンプレッションの申込みがなされた清算約定について、同第53条第1項の規定による取引毎コンプレッションの申込み又は同第53条の2第1項によるクーポン・ブレンディングの申込みが行われていた場合、J S C C 提案型コンプレッションに係る申込みを優先する。

8 当社は、業務方法書第53条の2の4第4項に規定する承諾が同条第2項に規定する J S C C 提案型コンプレッションの申込みを行ったすべての清算参加者から行われない場合又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若しく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、J S C C 提案型コンプレッション成立要件の確認を行わないこととし又は J S C

C提案型コンプレッション成立要件の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。

(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ロード・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、

(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ロード・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

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(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)

付 則

- 1 この改正規定は、平成30年9月25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、平成30年9月25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

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(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)

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及び当該算出日の午後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いう。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。

(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

金利スワップ清算受託契約書

(JSCC提案型コンプレッションを利用する場合の適用規定の変更)

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、当該承諾の時点をいう。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及び当該算出日の午後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いう。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。

(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

金利スワップ清算受託契約書

(新設)

第57条 乙がJSCC提案型コンプレッションを利用する場合、第26条の7の次に以下の一条を加えて適用する。

(委託清算約定に関するJSCC提案型コンプレッションの申込み)

第26条の8 乙は、委託清算約定に関するJSCC提案型コンプレッションの利用に係る意思表示の指図、JSCC提案型コンプレッションを行う委託清算約定の申込みの指図、当該申込みの撤回の指図又はJSCC提案型コンプレッションに係る承諾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。

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JSCC提案型コンプレッションの利用に係る意思表示、JSCC提案型コンプレッションを行う委託清算約定の申込み、当該申込みの撤回又はJSCC提案型コンプレッションに係る承諾を行うものとする。

2 前項の場合には、第28条及び第28条の2の規定は、次のとおり改めて適用する。

(取引毎コンプレッション等による本清算委託取引の終了)

第28条 取引毎コンプレッション、クーポン・ブレンディング、一括コンプレッション、参加者提案型コンプレッション又はJSCC提案型コンプレッションにより委託清算約定が終了した場合には、当該委託清算約定に係る本清算委託取引も当然に終了するとともに、当該本清算委託取引に基づく債権債務(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取引毎コンプレッション要件、クーポン・ブレンディング要件、一括コンプレッション成立要件、参加者提案型コンプレッション成立要件又はJSCC提案型コンプレッション成立要件の充足を確認す

ることができたときに既に発生している当該本清算委託取引（外貨建委託清算約定に関するものに限る。）に基づく預託又は支払いが完了していない変動証拠金等に関する債権債務を除く。）は、業務方法書等の定めるところにより将来に向かって消滅するものとする。この場合において、当該本清算委託取引に関し、甲乙間に未決済の金銭がある場合には、甲及び乙は、速やかに当該金銭の授受を行うものとする。

（取引毎コンプレッション等による本清算委託取引の成立）

第28条の2 取引毎コンプレッション、クーポン・ブレンディング、一括コンプレッション、参加者提案型コンプレッション又はJSCC提案型コンプレッションにより甲とクリアリング機構の間に新たな委託清算約定が成立した場合には、甲乙間において当該委託清算約定に係る本清算委託取引が同時に成立するものとする。

（注8） 甲及び乙は、乙がJSCC提案型コンプレッションを利用しない場合には、本契約から第57条を削除することができる。

（新設）

金利スワップ取引清算業務に係る手数料に関する規則の一部改正新旧対照表

| 新 | 旧 |
|---|---|
| <p>(円貨建清算約定に係る清算手数料)</p> <p>第4条 (略)</p> <p>2～4 (略)</p> <p>5 前各項の規定は、業務方法書第53条に規定する取引毎コンプレッション、同第53条の2に規定するクーポン・ブレンディング、同第53条の2の2に規定する一括コンプレッション、<u>同第53条の2の3に規定する参加者提案型コンプレッション又は同第53条の2の4に規定するJSCC提案型コンプレッション</u>により清算約定が成立する場合の円貨建清算約定に係る清算手数料について準用する。</p> <p>(コンプレッション手数料)</p> <p>第5条 コンプレッション手数料は、次の各号に掲げるコンプレッションの区分に応じ、当該各号に定めるところにより自己取引口座及び委託取引口座ごとに算出した金額の総額とする。</p> <p>(1)～(3) (略)</p> <p><u>(4) 業務方法書第53条の2の4に規定するJSCC提案型コンプレッション</u> <u>JSCC提案型コンプレッションにより終了した清算約定の件数からJSCC提案型コンプレッションにより新たに成立した清算約定の件数を減じた件数</u> (以下「<u>JSCC提案型コンプレッション手数料対象件数</u>」<u>という。</u>)<u>について、JSCC提案型コンプレッションが成立した月の属する計算年度における当該時点の累計のJSCC提案型コンプレッション手数料対象件数に応じ、JSCC提案型コンプレッション手数料対象件数1件あたり次に掲げる金額</u></p> <p>a <u>当該計算年度のJSCC提案型コンプレッション手数料対象件数の累計が2,500件までの部分</u> <u>1件あたり6,000円</u></p> | <p>(円貨建清算約定に係る清算手数料)</p> <p>第4条 (略)</p> <p>2～4 (略)</p> <p>5 前各項の規定は、業務方法書第53条に規定する取引毎コンプレッション、同第53条の2に規定するクーポン・ブレンディング、同第53条の2の2に規定する一括コンプレッション<u>又は同第53条の2の3に規定する参加者提案型コンプレッション</u>により清算約定が成立する場合の円貨建清算約定に係る清算手数料について準用する。</p> <p>(コンプレッション手数料)</p> <p>第5条 コンプレッション手数料は、次の各号に掲げるコンプレッションの区分に応じ、当該各号に定めるところにより自己取引口座及び委託取引口座ごとに算出した金額の総額とする。</p> <p>(1)～(3) (略)</p> <p>(新設)</p> |

| | |
|--|---|
| <p>b <u>当該計算年度の J S C C 提案型コンプレッション手数料対象件数の累計が 2, 5 0 0 件を超え、5, 0 0 0 件までの部分 1 件あたり 3, 6 0 0 円</u></p> <p>c <u>当該計算年度の J S C C 提案型コンプレッション手数料対象件数の累計が 5, 0 0 0 件を超える部分 1 件あたり 1, 2 0 0 円</u></p> <p>2・3 (略)</p> <p>(クライアント・クリアリング手数料)</p> <p>第 5 条の 2 (略)</p> <p>2～5 (略)</p> <p>6 前各項の規定は、業務方法書第 5 3 条に規定する取引毎コンプレッション、同第 5 3 条の 2 に規定するクーポン・ブレンディング、同第 5 3 条の 2 の 2 に規定する一括コンプレッション、<u>同第 5 3 条の 2 の 3 に規定する参加者提案型コンプレッション又は同第 5 3 条の 2 の 4 に規定する J S C C 提案型コンプレッション</u>により清算約定が成立する場合のクライアント・クリアリング手数料について準用する。</p> <p>(クライアント・クリアリング手数料に係る特則)</p> <p>第 5 条の 2 の 2 (略)</p> <p>2～7 (略)</p> <p>8 前各項の規定は、業務方法書第 5 3 条に規定する取引毎コンプレッション、同第 5 3 条の 2 に規定するクーポン・ブレンディング、同第 5 3 条の 2 の 2 に規定する一括コンプレッション、<u>同第 5 3 条の 2 の 3 に規定する参加者提案型コンプレッション又は同第 5 3 条の 2 の 4 に規定する J S C C 提案型コンプレッション</u>により、クライアント・クリアリングに係る清算約定が成立し届出委託取引口座に記録される場合の当該清算約定に関するクライアント・クリアリング手数料について準用する。</p> | <p>2・3 (略)</p> <p>(クライアント・クリアリング手数料)</p> <p>第 5 条の 2 (略)</p> <p>2～5 (略)</p> <p>6 前各項の規定は、業務方法書第 5 3 条に規定する取引毎コンプレッション、同第 5 3 条の 2 に規定するクーポン・ブレンディング、同第 5 3 条の 2 の 2 に規定する一括コンプレッション<u>又は同第 5 3 条の 2 の 3 に規定する参加者提案型コンプレッション</u>により清算約定が成立する場合のクライアント・クリアリング手数料について準用する。</p> <p>(クライアント・クリアリング手数料に係る特則)</p> <p>第 5 条の 2 の 2 (略)</p> <p>2～7 (略)</p> <p>8 前各項の規定は、業務方法書第 5 3 条に規定する取引毎コンプレッション、同第 5 3 条の 2 に規定するクーポン・ブレンディング、同第 5 3 条の 2 の 2 に規定する一括コンプレッション<u>又は同第 5 3 条の 2 の 3 に規定する参加者提案型コンプレッション</u>により、クライアント・クリアリングに係る清算約定が成立し届出委託取引口座に記録される場合の当該清算約定に関するクライアント・クリアリング手数料について準用する。</p> |
|--|---|

(LIBORライセンス手数料)

第5条の7 各月のLIBORライセンス手数料は、自己取引口座及び委託取引口座ごとに、変動金利としてJPY-LIBOR-BBA又はUSD-LIBOR-BBAを対象とする清算約定について、当社が公示により定める債務負担の申込みの日における終了日までの期間に応じて、当該各月に成立した清算約定(業務方法書第53条に規定する取引毎コンプレッション、同第53条の2に規定するクーポン・ブレンディング、同第53条の2の2に規定する一括コンプレッション、同第53条の2の3に規定する参加者提案型コンプレッション又は同53条の2の4に規定するJSCC提案型コンプレッション)により成立した清算約定を除く。)の想定元本の通貨ごとの合計額(外貨建清算約定に係る合計額にあつては、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の合計額とする。)に、当社が公示により定める値を乗じた金額を1,000,000で除した額の総額とする。

付 則

- 1 この改正規定は、平成30年9月25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き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。

(LIBORライセンス手数料)

第5条の7 各月のLIBORライセンス手数料は、自己取引口座及び委託取引口座ごとに、変動金利としてJPY-LIBOR-BBA又はUSD-LIBOR-BBAを対象とする清算約定について、当社が公示により定める債務負担の申込みの日における終了日までの期間に応じて、当該各月に成立した清算約定(業務方法書第53条に規定する取引毎コンプレッション、同第53条の2に規定するクーポン・ブレンディング、同第53条の2の2に規定する一括コンプレッション又は同第53条の2の3に規定する参加者提案型コンプレッションにより成立した清算約定を除く。)の想定元本の通貨ごとの合計額(外貨建清算約定に係る合計額にあつては、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の合計額とする。)に、当社が公示により定める値を乗じた金額を1,000,000で除した額の総額とする。

金利スワップ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>(金利スワップ清算基金所要額)</p> <p>第2条 各清算参加者に係る金利スワップ清算基金所要額は、<u>毎営業日</u>、別表「金利スワップ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、金利スワップ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 金利スワップ清算基金所要額の算出に関する表</p> <p>1 各清算参加者に係る金利スワップ清算基金所要額は、金利スワップ清算基金算出日（<u>金利スワップ清算基金所要額の算出を行う日</u>をいう。以下同じ。）におけるストレス時想定損失負担額と1億円のうちいずれか大きい額とする。</p> <p>2 (略)</p> | <p>(金利スワップ清算基金所要額)</p> <p>第2条 各清算参加者に係る金利スワップ清算基金所要額は、別表「金利スワップ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、金利スワップ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 金利スワップ清算基金所要額の算出に関する表</p> <p>1 各清算参加者に係る金利スワップ清算基金所要額は、金利スワップ清算基金算出日（<u>毎週最終当社営業日の前当社営業日（当社が通知により別に定める場合を除く。）</u>をいう。以下同じ。）におけるストレス時想定損失負担額と1億円のうちいずれか大きい額とし、<u>当該額を当該金利スワップ清算基金算出日からその直後の金利スワップ清算基金算出日の前日まで適用</u>する。</p> <p>2 (略)</p> |