

店頭商品デリバティブ取引等清算業務に関する業務方法書運用要綱

(目的)

第1条 この店頭商品デリバティブ取引等清算業務に関する業務方法書運用要綱（以下「本要綱」という。）は、株式会社日本商品清算機構（以下「当社」という。）が制定した店頭商品デリバティブ取引等清算業務に関する業務方法書（以下「業務方法書」という。）に基づき、当社が定める事項について規定することを目的とする。

(清算委託者)

第2条 業務方法書第2条第1項第13号に規定する当社が定める要件は、清算取次口座に係る登録が当社において完了した者であることとする。

(OTC清算参加者契約)

第3条 業務方法書第2条第1項第15号及び第14条に規定する当社が定める様式は、様式第1号の様式とする。

(清算受託契約)

第4条 業務方法書第2条第1項第16号及び第39条に規定する当社が定める様式は、様式第2号の様式とする。

(債務引受けの受付時間)

第5条 業務方法書第5条第1項に規定する当社が定める債務引受けの受付時間は、当社の営業日（業務方法書第7条に規定する休止日を除く。）の午前8時30分から午後6時30分までとする。

(OTC清算資格の取得申請)

第6条 業務方法書第10条第1項に規定するOTC清算資格の取得申請は、OTC清算資格の取得申請者が、次の各号に掲げる事項を記載した当社所定のOTC清算資格取得申請書を当社に提出して行うものとする。

- (1) 商号又は名称（英文の商号又は名称を含む。）
- (2) 本店又は主たる事務所の所在地
- (3) 代表者の氏名
- (4) 損失の危険の管理及び法令等の順守並びに支払不能処理に関する業務執行体制

- 2 前項のOTC清算資格取得申請書には、次に掲げる書類を添付しなければならない。ただし、当社が必要と認めた場合は、次の各号に掲げる書類について一部を省略することができる。
- (1) 申請者の概要に関する書面
 - (2) 登記事項証明書又はこれに代わる書類（OTC清算資格取得申請書の提出日（以下この項において「提出日」という。）前三月以内に作成されたもの。）
 - (3) 提出日前二月以内の日を基準日として作成された純資産額に関する調書（商品先物取引法施行規則（以下「省令」という。）に様式第1号として規定する書類をいう。以下同じ。）又は原則として提出日前六月以内に金融商品取引法若しくは銀行法等の規定により提出した有価証券報告書、四半期報告書若しくは業務報告書等に基づき作成された純資産額に関する調書
 - (4) 収支状況において安定的収益が見込めることを証する書面並びに直前三事業年度における会社法第435条第2項に基づき作成する計算書類、事業報告書及びこれらの附属明細書、金融商品取引法第24条に基づき作成する有価証券報告書、金融商品取引法第46条の3に基づき作成する事業報告書又は銀行法第19条に基づき作成する業務報告書
 - (5) 申請者の定款の写し
 - (6) 取得申請者の代表者（OTC清算参加者契約に署名又は記名押印する予定の代表者に限る。）の印鑑証明書又は当社が認めるこれに代わる書類
 - (7) 役員全員の誓約書
 - (8) 役員全員の履歴書
 - (9) 役員全員の住民票の写し、又は運転免許証若しくは健康保険証等役員本人の住所を確認することができる書面の写し
 - (10) 役員全員の身分証明書及び登記されていないことの証明書
 - (11) 主要株主の状況等に関する調書
 - (12) OTC清算参加者契約書
 - (13) OTC清算参加者代表者選任届出書
 - (14) 支払不能処理対応責任者選任届出書
 - (15) 決済業務責任者選任届出書
 - (16) OTC取引清算業務に関する連絡員届出書
 - (17) 決済銀行届出書
 - (18) 組織図等
 - (19) 業務分掌等
 - (20) その他当社が取得申請者の審査を行うにあたり必要と認める書類

(審問に関する手続き)

第7条 業務方法書第18条第2項(第32条において準用する場合を含む。)の審問の手続きは、次の各号に定めるところによる。

- (1) 当社は、あらかじめ審問の事項及び期日をもその対象とするOTC清算参加者に対して通知するものとする。
- (2) 当該OTC清算参加者は、審問の際に陳述を行うことができるものとし、当社は審問の事項、陳述内容その他の事項について記録を作成するものとする。

(清算手数料)

第8条 業務方法書第19条に規定する清算手数料は、次に掲げる区分ごとの手数料とする。

- (1) 登録手数料
新規に清算約定が成立したときに発生する手数料
- (2) 解約手数料
合意結了、合意解除又は強制解約により、清算約定が期限前終了したときに発生する手数料
- (3) 決済手数料
清算約定を決済したときに発生する手数料

2 清算手数料の額は、前項に規定する区分ごとに、売り買いそれぞれ1枚あたり90円とする。

3 清算手数料の支払いは、発生都度計算し月末締めで翌月にOTC清算参加者に請求のうえ、当該OTC清算参加者が第29条に規定する決済銀行に設ける口座(以下「決済口座」という。)から請求した月の14日(ただし、当日が休業日である場合には、繰り下げるものとする。)の午後2時までに口座振替により行うものとする。ただし、決済銀行システム障害等やむを得ない事情があるときは、当社が都度定める方法によるものとする。

(届出及び報告事項)

第9条 業務方法書第21条、第22条及び第41条に規定する当社への届出及び報告は、当社が指定するときまでに、当社所定の様式に当社が必要と認める書類を添付して行うものとする。

2 業務方法書第22条第13号に定める事業報告書は、省令第116条に基づき作成する書類又は次の区分に応じ、それぞれ次に定める書類を、毎事業年度終了後三月以内に提出すること。

- (1) 金融商品取引法第24条に規定する有価証券報告書を作成している者

同報告書

- (2) 金融商品取引法第46条の3に基づき事業報告書を作成している者（前号に掲げる者を除く。） 金融商品取引業等に関する内閣府令第172条に規定する事業報告書
 - (3) 銀行法第19条に基づき業務報告書を作成している者（第1号又は第2号に掲げる者を除く。） 同報告書
 - (4) 会社法第435条第2項に基づき計算書類及び事業報告書並びにこれらの附属明細書を作成している者（第1号、第2号又は第3号に掲げる者を除く。） 会社法第435条第2項に基づき作成する各事業年度に係る計算書類等
 - (5) 第1号から第4号までに掲げる者以外の者 各事業年度に係る貸借対照表、損益計算書、その他当社が必要と認める書類
- 3 業務方法書第22条第14号において、当社が定める書類は次の各号に掲げるものとする。ただし、信用格付機関による格付等により相当の信用力を有すると当社が認める者は、第2号の書類の提出を要しないものとすることができる。
- (1) 純資産額に関する調書又は計算書類等
 - (2) 手元流動資金に関する届出書
- 4 前項に定める書類の作成基準日及び提出期限は以下のとおりとする。
- (1) 第1号の書類は、事業年度終了の日及び当該終了日の翌日から起算して六月目に当たる月の末日を作成基準日とし、基準日から三月以内
 - (2) 第2号の書類は、月末最終営業日を作成基準日とし、基準日から4営業日以内
- 5 第1項の規定にかかわらず、第3項第2号に規定する書類についてはJCHシステムを利用することにより、その作成及び提出を行うことができる。
- 6 OTC清算参加者のうち金融商品取引法第24条に規定する有価証券報告書及び同法第24条の4の7に規定する四半期報告書を作成する者で当社が認めた者は、報告書作成後三月以内に当社に当該報告書を提出することにより、第3項第1号及び第2号の書類の提出に代えることができる。
- 7 OTC清算参加者のうち事業年度の期間を三月ごとに区分した期間ごとに計算書類等又は現金及び預金勘定が確認可能な書類を作成する者で当社が認めた者は、書類作成後三月以内に当社に当該計算書類又は当該書類を提出することにより、第3項第2号の書類の提出に代えることができる。
- 8 第2項及び第6項に規定する有価証券報告書及び四半期報告書の提出について、当該報告書が金融商品取引法第27条の30の2に規定する開示用電子情報処理組織の使用により同法第27条の30の7第1項に規定する公衆

の縦覧に供された場合にあっては、当該報告書は当社に提出されたものとみなす。

(純資産額に係る要件確認)

第10条 当社は、OTC清算参加者が次の各号に掲げる基準に抵触したときは、原則として業務方法書第23条の規定に基づき次の各号に規定する期限までに報告又は資料の提出を請求するものとする。この場合において当該OTC清算参加者は、規定する期限までに提出しなければならない。

(1) OTC清算参加者の有価証券報告書又は四半期報告書における純資産額若しくはその他計算書類等における純資産額のうちいずれかの額(以下「必要純資産額」という。)に対する比率が150パーセントを下回ったときは、毎月末を基準日とする純資産額に関する調書を基準日の翌月の第5営業日までに当社に提出するものとする。

(2) OTC清算参加者の純資産額(純資産額に関する調書、有価証券報告書又は四半期報告書若しくはその他計算書類等における額をいう。)の必要純資産額に対する比率が120パーセントを下回ったときは、次のイからへまでに規定する書類を提出するものとする。なお、提出の時限等必要な事項については当社がその都度定める。

イ 毎営業日現在の手元流動資金に関する届出書

ロ 収支改善計画

ハ 資金繰り計画

ニ 支払予定及び結果一覧

ホ 月央現在における貸借対照表及びその他計算書類等

へ 上記イからホまでのほか財務状況の確認のために当社が指定する資料・証明等

2 当社は、当該OTC清算参加者の前項第1号の規定における純資産額の必要純資産額に対する比率が2か月間連続して150パーセントを上回ることとなった等の理由により、当社が前項に規定する報告又は資料の提出について必要がないと認めるときは、当該報告又は資料の提出を終了させるものとする。

3 前2項の規定にかかわらず、当社が必要と認めた場合には、別途報告又は資料の提出を求めることができる。

(OTC清算資格の喪失申請)

第11条 業務方法書第24条のOTC清算資格の喪失申請は、OTC清算資格を喪失しようとするOTC清算参加者が、次に掲げる事項を記載した当社

所定のOTC清算資格喪失申請書を当社に提出して行うものとする。

- (1) 商号又は名称（英文の商号又は名称を含む。）
 - (2) 本店又は主たる事務所の所在地
 - (3) 代表者氏名
 - (4) OTC清算資格の喪失申請理由
- 2 前項のOTC清算資格喪失申請書には、OTC清算資格の喪失にあたり当社が必要と認める書類を添付しなければならない。

(OTC清算資格の喪失時期)

第12条 業務方法書第25条第1項に規定する当社が定める時点は、当社が日時についてその都度定める。

(清算受託契約に係る誓約書)

第13条 業務方法書第39条第2項に規定する当社が定める誓約書は、様式第3号の様式によるものとする。

(OTC清算参加者契約の契約書等の保管)

第14条 当社は、OTC清算参加者契約の契約書及び業務方法書第39条第2項の誓約書（以下本条において「OTC清算参加者契約書等」という。）を、OTC清算参加者又は清算委託者（以下本条において「情報授受者」という。）が清算取次原取引に係る情報を清算受託契約の相手方である清算委託者又はOTC清算参加者から受領し、又は当該清算委託者又は当該OTC清算参加者に提供することについて当該清算取次原取引の相手方である他のOTC清算参加者又は他の清算委託者が同意していることを証する書面として、情報授受者のためにも保管するものとする。

- 2 前項の規定によるOTC清算参加者契約書等の保管の方法、OTC清算参加者契約書等に関する情報授受者からの照会に対する対応その他の必要な事項は、当社が通知又は公示により定める。

(清算受託契約の締結に係る承認申請)

第15条 業務方法書第40条に規定する清算受託契約の締結に係る承認申請は、当社所定の様式に必要な書類を添付して行うものとする。

(債務の引受け等の申込み方法等)

第16条 業務方法書第44条第1項に規定する当社が定める方法は、当社所定の様式に必要な書類を添付して行うものとする。

(債務の引受けに係る条件等)

第17条 業務方法書第45条第1項に規定する当社が定める条件は、次に掲げる要件のすべてを満たすこととする。

- (1) 業務方法書第4条に規定する適格OTC取引であること。
- (2) 業務方法書第5条に規定する申込期間において申込みがあったものであること。
- (3) 契約値段が実勢価格を著しく乖離していないこと。

2 業務方法書第45条第1項及び第51条第1項に規定する当社が定める時点は、当社が同項の規定により債務引受要件の充足を確認し、その旨を当社が決定した時点とする。

3 業務方法書第45条第7項又は第51条第8項の規定に基づき、当社が引き受けた債務の履行をしない場合は、業務方法書第30条第2項及び第3項の規定を準用するものとする。

(清算約定の内容等)

第18条 業務方法書第46条第1項に規定する当社が定める基本契約は、当社が定めた「株式会社日本商品清算機構において債務引受けされる適格OTC取引に関する基本契約書」とする。

2 業務方法書第46条第2項に規定する当社が定める内容は、当社が公示により定める。

3 業務方法書第46条第3項に規定する必要な読替えその他の事項は、当社が公示により定める。

(清算約定の合意終了の申込み等)

第19条 業務方法書第48条第1項に規定する清算約定の合意終了は、当社所定の様式により申し込むものとする。

2 業務方法書第48条第1項の規定による清算約定の合意終了の申込み及び当該清算約定の反対清算約定の合意終了の申込みは、それぞれ当該合意終了の実行日（以下「合意終了実行日」という。）の前営業日午後4時までにを行うものとし、双方の申込みに係る合意終了は、いずれも合意終了実行日の午後4時に成立するものとする。

3 OTC清算参加者が当社に清算約定の合意終了の申込みをした場合において、合意終了実行日の前営業日の午後4時までに、当該清算約定の反対清算約定の当事者である他のOTC清算参加者から当該反対清算約定について合意終了の申込みがされなかった場合には、当該合意終了の申込みは当然に効

力を失うものとする。

- 4 業務方法書第48条第3項に規定する合意終了に係る期限前終了手数料は、当該清算約定の当事者であるOTC清算参加者間で合意した値段を最終清算値段とみなして算出した決済差金に相当する額とし、当該期限前終了手数料の授受は、当社が定めるところによるものとする。

(清算約定の合意解除の申込み)

第20条 業務方法書第49条第1項に規定する清算約定の合意解除は、当社所定の様式により申し込むものとする。

- 2 業務方法書第49条第1項の規定による清算約定の合意解除の申込み及び当該清算約定の反対清算約定の合意解除の申込みは、それぞれ当該合意解除の実行日（以下「合意解除実行日」という。）の前営業日午後4時までに行うものとし、双方の申込みに係る合意解除は、いずれも合意解除実行日の午後4時に成立するものとする。
- 3 OTC清算参加者が当社に清算約定の合意解除の申込みをした場合において、合意解除実行日の前営業日の午後4時まで、当該清算約定の反対清算約定の当事者である他のOTC清算参加者から当該反対清算約定について合意解除の申込みがされなかった場合には、当該合意解除の申込みは当然に効力を失うものとする。

(清算取次ぎの委託)

第21条 業務方法書第50条第1項の規定に基づき、清算取次ぎの委託を行う場合に通知すべき当社が定める事項は次に掲げるすべての事項とする。

- (1) 相手方OTC清算参加者（当該相手方が清算委託者である場合には、当該清算委託者及び清算委託者が清算取次ぎを委託したOTC清算参加者。）の商号又は名称
- (2) 清算取次原取引の内容
- (3) その他当社が必要と認める事項

(清算取次原取引の要件)

第22条 業務方法書第50条第3項第4号に規定する当社が定める条件は、次のすべての要件とする。

- (1) 業務方法書第5条に規定する申込期間において債務の引受けの申込みを行ったものであること。
- (2) 契約値段が実勢価格を著しく乖離していないこと。

(清算取次原取引と同一である条件)

第23条 業務方法書第50条第3項第5号に規定する当社が定める制限は、清算取次口座ごとのリスクにかかわる制限とする。

(清算取次ぎの委託の撤回申込み時刻)

第24条 業務方法書第50条第4項に規定する当社が定める時刻は、午後6時30分とする。

(清算取次ぎの委託終了時の清算約定(委託分)の取扱い)

第25条 業務方法書第51条第4項に規定する当社が定める場合は、清算受託契約の定めるところによりすべての清算取次ぎの委託が終了した場合とする。

- 2 業務方法書第51条第4項に規定する当社が定める時点は、清算取次ぎの委託の終了についてOTC清算参加者から当社に届出があった日の翌営業日とする。

(資金決済の方法)

第26条 業務方法書第70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。

- (1) 決済差金
- (2) 業務方法書第48条に規定する清算約定の終了に係る期限前終了手数料
- 2 業務方法書第70条第1項に規定する当社が定める方法は、決済日の午後2時までに決済口座からの口座振替又は決済口座への振込みにより行うものとする。ただし、当社が必要と認める場合は、当社がその都度定める方法により授受するものとする。
- 3 業務方法書第70条第2項に規定する差引計算は、第1項各号に掲げる金銭の総受取額と総支払額の差引計算とする。

(清算約定(委託分)の移管の申請時刻等)

第27条 業務方法書第80条第3項に規定する申請を行おうとするOTC清算参加者は、当社所定の当該清算約定(委託分)の移管に係る申請書に当社が必要と認める書類を添付して提出するものとする。

- 2 当社は、業務方法書第80条第4項に基づき移管を承認した場合には、移管の対象となる清算約定及び移管すべき時刻を定め、移管元清算参加者及び移管先清算参加者に対して通知する。
- 3 当社は、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、前項で定めた時刻までに移管を行うことが不可能又は困難であると当社が認める場合は、当該時刻を改めて定めるものとする。この場合においては、当社は、あらかじめ当該改めて定めた時刻を移管元清算参加者及び移管先清算参加者に対して通知する。

(最終損失確定時の補填方法)

第28条 当社は、業務方法書第96条第1項に規定する補填を行う場合は、業務方法書第95条に規定する方法に準じて補填を行うものとする。

(決済銀行)

第29条 業務方法書第100条第1項に規定する決済銀行は、次のとおりとする。

みずほ銀行小舟町支店

りそな銀行日本橋支店

りそな銀行船場支店

三井住友銀行大阪西支店

- 2 業務方法書第100条第2項の規定を適用する場合にOTC清算参加者が清算を行うべき金融機関は、当該OTC清算参加者の決済銀行以外の金融機関（前項に掲げる金融機関以外の金融機関を含む。）であって、OTC清算参加者があらかじめ当社に届け出た金融機関とする。この場合、業務方法書第100条第1項に規定する清算を、OTC清算参加者は当社が指定する決済銀行への振込みにより行うものとし、当社は決済口座への振込みにより行うものとする。

(決済銀行システム障害時等における特例措置)

第30条 業務方法書第100条第2項を適用する場合において、OTC清算参加者が決済銀行に資金を集中させていること等により当該決済銀行以外の金融機関を通じた清算が困難なことを理由として、当社に納入又は預託すべき金額の全部又は一部を納入又は預託できない旨を、当該決済銀行における当該OTC清算参加者の口座残高（他の金融機関から当該決済銀行あて送金中の金額を含む。次項において同じ。）を添付して、当社がその都度指定する時刻までに申請し、かつ、当社が当該申請を適切であると認めるときは、当社は、業務方法書第101条第1項の規定に基づき当該OTC清算参加者が当社へ納入又は預託すべき金額の全部又は一部を当社が指定する日まで猶予する。

- 2 前項の当社が猶予する額（次項において「猶予額」という。）は、当該決済

銀行における当該OTC清算参加者の口座残高を上限に、当該OTC清算参加者が当社に納入又は預託すべき金額のうち、当該申請した額の範囲内で当社が指定する額とする。

- 3 猶予額に関して、当社に金融機関の金利負担が生じたときは、当社の請求に基づき当該OTC清算参加者はこれを負担しなければならない。

(システム障害時等における決済時限の繰延べ等)

第31条 業務方法書第101条第1項に規定する決済日の繰り延べ等に関し、当社は、必要な措置をその都度定めるものとする。

(OTC取引清算業務に関する必要事項の決定)

第32条 当社は、本業務方法書等において定める事項に係る事務手続等について、通知又は公示により定めることができる。

(申込み方法)

第33条 第16条、第19条及び第20条の申込みを行う方法は、書面を送付する方法、ファクシミリ装置を用いて送信する方法又は電子メールを送信する方法とする。

(本要綱の改廃)

第34条 本要綱の改廃は、代表取締役社長の決裁をもって行うものとする。

附 則

本要綱は、平成26年5月16日から実施する。

附 則

第6条（OTC清算資格の取得申請）、第9条（届出及び報告事項）及び第23条（清算取次原取引と同一である条件）の変更規定は、平成28年7月21日から実施する。

(様式第1号)

OTC清算参加者契約書

平成 年 月 日

株式会社日本商品清算機構
代表取締役社長 ○○ ○○ 殿

所在地
商号又は名称
代表者名 印

○○○○○（以下「当法人」といいます。）は、貴社の定めた店頭商品デリバティブ取引等清算業務に関する業務方法書（以下「業務方法書」といいます。）第14条の規定に基づき、あらかじめ本業務方法書等の内容を確認及び了承のうえ、このOTC清算参加者契約書（以下「本契約」といいます。）を貴社に提出します。

なお、本契約において使用する用語は、本契約に別段の定めがある場合を除くほか、業務方法書において使用される用語の例によるものとします。

1. 当法人は、貴社が行うOTC取引清算業務、本業務方法書等の定めるところにより成立する清算約定その他本業務方法書等の定める事項に関し、本業務方法書等（本業務方法書等が本業務方法書等の定めるところにより変更された場合には、当該変更後の本業務方法書等）の定めに従い、かつこれを遵守します。
2. 当法人は、次に掲げる事項に同意します。
 - (1) 本業務方法書等の定めが現在又は将来の清算約定に係る権利義務その他業務方法書第1条第1項各号に掲げる事項に適用されること。
 - (2) 本業務方法書等の定めが、本契約の一部を構成すること。
 - (3) 本業務方法書等が本業務方法書等の定めるところにより変更された場合には、当該変更の日以降、本契約の内容も当該変更に応じて当然に変更されること。
 - (4) 本業務方法書等に基づいて貴社が行う、OTC清算資格の取消し、債務の引受けの停止その他の措置に従うこと。
 - (5) OTC清算資格を喪失する場合（貴社によるOTC清算資格の取消しの

措置によって喪失する場合を含みます。)には、本業務方法書等に基づき、その喪失について一切の責任を負い、貴社、他のOTC清算参加者、当法人との間で清算受託契約を締結した清算委託者に対し、一切迷惑をかけること。

- (6) 当法人以外のOTC清算参加者と清算受託契約を締結した清算委託者と当法人との間のOTC取引に係る清算取次原取引について、当該清算委託者が当該OTC清算参加者に対して当該清算取次原取引に係る情報を提供し、当該OTC清算参加者がこれを受領すること。
 - (7) 貴社が、本契約の契約書を、前号に掲げる事項について当法人が同意していることを証する書面として同号のOTC清算参加者又は清算委託者のためにも保管し、また、当該OTC清算参加者又は当該清算委託者に対し、当該契約書又はその内容を、法令上必要な限度において、開示すること。
 - (8) 本契約は、本業務方法書等に別段の定めがある場合を除き、日本法に準拠するものとし、日本法に従って解釈されること。
3. 本契約は、当法人がOTC清算資格を喪失したときに、当事者から別段の意思表示を要することなく、当然に終了するものとします。ただし、その終了時点で清算約定その他貴社と当法人の間に権利義務又は本業務方法書等の規定に基づくその他の権利義務が残存している場合には、当法人は、当該権利義務に関する限度で、なお本業務方法書等の定めに従い、かつこれを遵守します。

以 上

OTC清算受託契約書

〇〇〇〇（以下「甲」という。）及び〇〇〇〇（以下「乙」という。）は、乙の委託に基づいて甲が行うOTC取引を清算対象取引とする清算取次ぎに関し、業務方法書等を承諾のうえ、次のとおり合意し、このOTC清算受託契約（以下「本契約」という。）を締結する。

第1章 総則

（目的）

第1条 乙は、本契約の定めるところによりOTC取引を清算対象取引とする清算取次ぎを甲に委託し、甲はこれを受託する。

（定義）

第2条 本契約において使用する用語は、商品先物取引法（昭和25年法律第239号）及び業務方法書等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。

- (1) 「清算機構」とは、株式会社日本商品清算機構をいう。
- (2) 「委託清算約定」とは、乙の清算取次ぎの委託に基づき、甲と清算機構の間に成立する清算約定をいう。
- (3) 「期限の利益喪失事由」とは、第23条第1項各号に掲げる事由をいう。
- (4) 「期限前終了金額」とは、第24条の規定によりすべての委託清算約定が終了した場合に甲乙間で授受すべき金銭をいう。
- (5) 「業務方法書」とは、清算機構が行うOTC取引を対象取引とした債務の引受けを行う業務に関し、清算機構が定める店頭商品デリバティブ取引等清算業務に関する業務方法書（業務方法書が改正された場合には、当該改正後の規則を含む。）をいう。
- (6) 「業務方法書等」とは、業務方法書及び業務方法書に基づいて清算機構が定める規則（名称の如何を問わない。また、規則が改正された場合には、当該改正後の規則を含む。）をいう。
- (7) 「営業日」とは、休業日以外の日をいう。

（誓約書等の差入れ）

第3条 乙は、本契約の締結後直ちに、本契約及び業務方法書等を遵守する旨

の清算機構所定の誓約書その他業務方法書等に定める書面（以下「誓約書等」という。）を、甲を経由して清算機構に提出するものとする。

- 2 甲は、乙から前項の誓約書等を受領した場合には、直ちに、当該誓約書等を清算機構に差し入れるものとする。

第2章 清算取次ぎの委託

（清算取次ぎの委託）

第4条 乙は、甲に対して清算取次ぎの委託をしようとする場合には、業務方法書等の定めるところにより、清算取次ぎの委託の基となる清算取次原取引における相手方のOTC清算参加者（当該相手方が清算委託者である場合には、当該清算委託者が清算取次ぎを委託したOTC清算参加者。以下「指定相手方」という。）及び当該清算委託者その他業務方法書等の定める事項を甲に通知するものとする。

- 2 甲は、前項の通知の到達後遅滞なく、前項に定める事項を清算機構に対して通知し、債務の引受けを申し込むものとする。ただし、前項の通知に係る清算取次原取引が次のいずれかに該当する場合は、清算機構に対する通知及び申し込みを行わない。
 - （1）前項の通知が業務方法書等の定める条件を満たさない場合
 - （2）清算取次ぎの委託の制限（業務方法書等の定める制限に限る。）について甲乙間に別段の合意がある場合（当該合意の内容が清算機構所定の方法により清算機構に届け出られている場合に限る。）において、前項の通知が当該合意に反するとき

（委託清算約定の成立）

第5条 前条第2項に基づき甲による清算機構への通知が行われ、かつ、指定相手方が、前条第2項の規定による申込みに係る通知を清算機構に行い、清算機構が債務引受要件の充足を確認することができた場合は、乙の計算において、甲と指定相手方との間で清算取次原取引と業務方法書等の定める条件を同一とする適格OTC取引が成立する。

- 2 前項に規定する適格OTC取引が成立した場合、業務方法書等に定める時点をもって、乙の清算取次ぎの委託に基づき甲が指定相手方に対し負担する債務を清算機構に免責的に引き受けさせ、甲は清算機構に引き受けさせた当該債務と同一内容の債務を新たに清算機構に対し負担し、かつ、指定相手方は、乙の清算取次ぎの委託に基づき甲に対し負担する債務を清算機構に免責的に引き受けさせ、指定相手方は清算機構に引き受けさせた当該債務と同一

内容の債務を新たに清算機構に対し負担することにより、委託清算約定が成立するものとする。

- 3 甲は、清算機構から委託清算約定が成立した旨の通知を受けた場合には、遅滞なく、その旨及び委託清算約定の内容を乙に通知しなければならない。

(委託清算約定に係る損益の帰属等)

第6条 委託清算約定に係る損益は、すべて乙に帰属する。

- 2 甲は、委託清算約定に関し、清算機構から金銭等（O T C 証拠金を除く。）を受領した場合には、当該金銭等を乙に引き渡すものとする。
- 3 乙は、委託清算約定に関し、甲が清算機構に対して金銭等（O T C 証拠金及び清算手数料を除く。）の支払義務を負担する場合には、当該金銭等を甲に支払うものとする。
- 4 前2項の規定による金銭等の授受の時期及び方法については、本契約に別段の定めがある場合を除くほか、甲乙間の合意により定める。

(委託清算約定に関する乙の指図)

第7条 乙は、甲に対して、本契約及び業務方法書等の定めるところにより、委託清算約定に関する合意結了及び合意解除の申込みその他の事項に係る指図を行うことができる。

(資金決済に係る金銭の授受)

- 第8条 乙は、甲が委託清算約定について資金決済に係る金銭を清算機構に交付すべき場合には、当該決済金額に相当する金銭を、清算機構への交付時限までの甲が定める時限までに、甲が定める方法により甲に交付する。
- 2 甲は、清算機構から委託清算約定について資金決済に係る金銭を受領した場合には、当該決済金額に相当する金銭を、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。

(清算取次口座)

第9条 甲は、委託清算約定の内容、委託清算約定に係るO T C 証拠金その他本契約及び業務方法書等に基づいて乙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。

(手数料等)

第10条 甲は、甲乙間の合意により、乙に対し、清算取次ぎの受託その他本

契約に基づく義務の履行に関し、当該合意に基づく報酬、手数料その他の金銭の支払いを請求することができる。

第3章 OTC証拠金

(OTC取引証拠金の預託義務)

第11条 乙は、委託清算約定に係るOTC取引証拠金維持額（次の各号に掲げる証拠金を合算した金額。ただし、甲乙間に別段の合意がある場合には、当該合意により算出される額とOTC取引証拠金維持額のいずれか大きい額。以下同じ。）以上のOTC取引証拠金を甲に差し入れるものとする。

(1) 乙の委託清算約定に係る当初証拠金

(2) 乙の委託清算約定に係る変動証拠金

2 委託清算約定に係るOTC取引証拠金維持額は、業務方法書等の定めるところにより、清算機構が算出するものとする。

3 甲は、清算機構から乙の清算取次ぎの委託に基づく委託清算約定に係るOTC取引証拠金維持額の通知を受けた場合には、遅滞なく当該額を乙に通知するものとする。

(OTC取引証拠金の預託方法等)

第12条 乙による清算機構に対するOTC取引証拠金の預託は、業務方法書等の定めるところにより、甲を代理人とする方法により行うものとする。

2 乙は、本契約をもって、乙に代わって清算機構に対するOTC取引証拠金の預託を行うこと及びその返還を請求することを甲に委託し、甲はこれを受託する。

3 甲は、乙からOTC取引証拠金として差し入れを受けた金銭又は充用有価証券の全部を、業務方法書等の定めるところにより、乙の代理人として、清算機構に預託しなければならない。

4 乙は、清算機構に対する乙のOTC取引証拠金の預託及びその返戻については、甲以外の者を代理人としないものとし、また、甲を解任しないものとする。

5 清算機構及び甲は、乙からOTC取引証拠金として預託を受けた金銭及び充用有価証券その他の金銭に対して、その利息を支払わない。

(差換預託)

第13条 前2条の規定にかかわらず、甲は、あらかじめ乙の書面による同意を得て、乙からOTC委託証拠金の預託を受けることができる。

- 2 前項の場合において、甲は、乙からOTC委託証拠金として金銭又は充用有価証券の預託を受けた場合には、OTC取引証拠金として、当該金銭又は充用有価証券の時価評価額の合計額以上の金銭又は充用有価証券を自己の負担で清算機構に預託しなければならない。
- 3 甲は、乙からOTC委託証拠金として預託を受けた金銭及び充用有価証券その他の金銭に対して、その利息を支払わない。

(OTC証拠金の預託時限)

第14条 乙は、各営業日において、甲にOTC証拠金として差し入れ又は預託した金銭の額及び充用有価証券の充用価格の合計額が乙のOTC取引証拠金維持額に不足する場合には、甲が指定する日時までに、その不足額以上の額を、甲に差し入れ又は預託するものとする。

(OTC証拠金の返還請求権)

第15条 清算機構に対するOTC取引証拠金に関する返還請求権は、次の各号に掲げる者が、当該各号に定める金額に相当する部分について有するものとする。

(1) 乙

乙が清算機構に預託した甲委託分のOTC取引証拠金(直接預託分)の金銭の額及び充用有価証券の時価評価額並びに甲が清算機構に預託した甲委託分のOTC取引証拠金(差換預託分)の金銭の額及び充用有価証券の時価評価額のうち乙が甲に預託したOTC委託証拠金の金銭の額及び充用有価証券の時価評価額を限度として業務方法書等で定める額の合計額から、乙が清算取次ぎの委託に関して甲に対して負担する未履行債務(当該清算取次ぎの委託の終了に伴って生じる債務のうち未履行であるものを含む。)の額を控除した額(第3項ただし書きに基づき、乙が清算機構に直接返還請求権を行使する場合であって、乙が直接預託分として充用有価証券にてOTC取引証拠金を清算機構に預託し、この未履行部分に相当する額があるときは、当該充用有価証券を清算機構が適当と認めた方法により換金した額から当該未履行部分に相当する額及び換金に要した額を控除した額とする。この場合において、乙は清算機構との間に委任契約が成立することについてあらかじめ同意する。)

(2) 甲

乙が清算機構に預託した甲委託分のOTC取引証拠金(直接預託分)の金銭の額及び充用有価証券の時価評価額並びに甲が清算機構に預託した甲委託分のOTC取引証拠金(差換預託分)の金銭の額及び充用有価証券の時価評価額の合計額から、甲が委託清算約定に関して清算機構に対して負担する未履行債

- 務（甲の支払不能その他の事由による委託清算約定の処理に伴って生じる債務のうち未履行であるものを含む。）の額及び第1号の額の合計額を控除した額
- 2 乙は、OTC証拠金の返還請求権の額がOTC取引証拠金維持額を上回る場合には、その超過額を限度として、業務方法書等の定めるところにより、清算機構に対し、OTC証拠金の返還を請求することができる。
 - 3 乙によるOTC取引証拠金の返還請求権の行使は、業務方法書等の定めるところにより、甲を代理人とする方法により行うものとする。ただし、清算機構が甲の支払不能を認定した場合には、乙によるOTC取引証拠金の返還請求権の行使は、業務方法書等の定めるところにより、清算機構に対し直接行うものとする。
 - 4 甲は、清算機構から乙が返還請求権を有するOTC取引証拠金として返戻を受けた金銭又は充用有価証券の全部を、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返還する。
 - 5 第2項の規定にかかわらず、乙は、甲に対してOTC委託証拠金の返還請求権を行使することができる場合には、清算機構に対して、当該OTC委託証拠金に対応するOTC取引証拠金の返還請求権を行使することができない。ただし、清算機構が甲の支払不能を認定した場合は、この限りでない。
 - 6 前各項に規定するOTC証拠金の返還請求権の行使の方法、被担保債務に対する充当の方法その他の事項に関し、業務方法書等に別段の定めがある場合には、当該定めによる。

（充用有価証券）

第16条 充用有価証券の種類、充用価格及び預託の方法その他充用有価証券に関する事項は、業務方法書等の定めるところによる。

（期限の利益喪失事由が発生している場合等のOTC証拠金の返還請求権の取扱い）

第17条 乙は、次に掲げる場合には、すべての清算取次ぎの委託に基づく清算約定の決済が完了するまでの間、清算機構及び甲に対し、OTC証拠金の返還請求権を行使することができない。

（1）乙について期限の利益喪失事由が発生し、継続している場合

（2）第24条の規定によりすべての清算取次ぎの委託が終了した場合

2 乙は、清算機構が甲の支払不能を認定した場合には、すべての委託清算約定の決済が完了するまでの間、清算機構及び甲に対し、OTC証拠金の返還請求権を行使することができない。

第4章 債務の引受けの停止措置時の取扱い

(債務の引受けの停止措置)

第18条 清算機構が業務方法書に基づき、甲に対し甲を当事者とする清算対象取引又は清算取次ぎの委託の基となる清算取次原取引に係る債務の引受けの全部若しくは一部の停止その他清算機構が必要かつ適当と認める次の各号に掲げる措置を行う場合には、甲は遅滞なく、その旨及び内容を乙に通知しなければならない。

- (1) 業務方法書第29条に基づく措置
- (2) 業務方法書第30条第2項に基づく措置（ポジション保有状況の改善指示が乙の委託清算約定である場合に限る。）
- (3) 業務方法書第83条及び84条に基づく措置

2 乙は、甲から前項第2号に規定する措置について通知を受けた場合は、甲が指定する日までにポジションの保有状況を改善するために委託清算約定の合意終了等を行うものとする。

第5章 委託清算約定の移管等

(会社分割又は事業譲渡の場合の未決済約定の引継ぎ)

第19条 甲は、他のOTC清算参加者に分割により事業を承継させ、又は事業を譲渡する場合であって、清算機構の承認を受けて、当該他のOTC清算参加者に当該事業の承継又は事業の譲渡に係る未決済の清算約定（乙の清算取次ぎの委託に基づく清算約定である場合に限る。）を引き継がせる場合には、あらかじめ乙の同意を得るものとする。

(委託清算約定の移管)

第20条 乙は、業務方法書等に基づき、本契約に基づく委託清算約定について、移管（当該委託清算約定を他のOTC清算参加者（以下「移管先清算参加者」という。）に引き継がせることをいう。以下同じ。）を行わせることができる。

2 乙は、前項の規定により移管を行おうとする場合には、次の各号に掲げる手続を行うものとする。

- (1) 移管先清算参加者との間で清算受託契約を締結し、清算機構所定の誓約書等を、移管先清算参加者を經由して清算機構に提出すること。
- (2) 甲及び移管先清算参加者の承諾を得ること。

- 3 甲及び移管先清算参加者が前項第2号の承諾を行ったときは、清算機構に対し、当該委託清算約定の移管に係る申請を清算機構に行うものとする。
- 4 前項の申請を清算機構が適当と認めるときは、清算機構が定めるところにより、当該委託清算約定の移管を行うものとする。この場合において、甲は、当該移管が行われた旨を乙に通知するものとする。
- 5 前項の移管が行われた場合には、当該委託清算約定に係る清算機構と甲の間における権利義務が将来に向かって消滅すると同時に、清算機構と移管先清算参加者との間において消滅した当該委託清算約定に係る権利義務と同一の権利義務が新たに発生するものとする。
- 6 第4項の移管が行われた場合には、乙と甲の間における清算取次ぎの委託が将来に向かって消滅すると同時に、乙と移管先清算参加者との間における清算取次ぎの委託が新たに発生するものとする。

(OTC取引証拠金の取扱い)

第21条 前条第4項の規定に基づき乙の委託清算約定の移管が行われた場合は、甲が清算機構に預託していた乙に係るOTC取引証拠金（乙が返還請求権を有する部分に限る。以下次条において同じ。）について、当該委託清算約定の移管が行われた日に移管先清算参加者を代理人として清算機構に預託したものとみなす。

(OTC取引証拠金に係る返還請求権の特例)

第22条 前条の規定に基づき移管先清算参加者を代理人として預託したものとみなされる委託清算約定に係るOTC取引証拠金の返還請求権の行使は、当該移管先清算参加者が代理人としてこれを行行使するものとする。

第6章 当事者支払不能時の取扱い

第1節 乙の支払不能等

(期限の利益喪失事由)

第23条 次に掲げるいずれかの事由が発生した場合、乙についての期限の利益喪失事由を構成するものとする。

(1) 支払債務又は引渡債務の不履行

乙が履行期日までに本契約に基づく支払債務又は引渡債務を履行しない場合において、甲による不履行の通知が乙に対して行われた後1現地営業日（通知の宛先として指定される場所において商業銀行が一般業務（外国為替及び外

貨預金の取扱を含む。)を行う日をいう。)以内に当該不履行が解消されない場合

(2) 約束違反及び約束の履行の拒絶

乙が本契約に基づいて履行すべき義務(前号の支払債務又は引渡債務を除く。)を履行しない場合において、甲による不履行の通知が乙に対して行われた後30日以内に当該不履行が解消されない場合

(3) 倒産等

イ 乙が解散した場合(合併に伴うものを除く。)

ロ 乙が債務超過(乙が日本法に基づき設立又は組成された者である場合には、破産法(平成16年法律第75号)に規定する債務超過をいう。)となった場合、支払不能(乙が日本法に基づき設立又は組成された者である場合には、破産法に規定する支払不能をいう。)となった場合、期限の到来した債務(第1号の支払債務若しくは引渡債務を除く。)の支払いを停止した場合(乙が日本法に基づき設立又は組成された者である場合には、破産法において支払の停止に該当する場合をいう。)又は一般的に支払う能力がないことを書面で認めた場合

ハ 乙が債権者との間で、又は債権者の利益のために、包括的な譲渡、債務整理又は和解を行った場合

ニ 乙について、破産若しくは支払不能に関する法律若しくは債権者の権利に影響を与えるその他の同様の法律に基づき、支払不能若しくは破産の決定その他の救済を求める手続の開始に係る申立てがなされた場合(乙について、破産手続、再生手続、更生手続、特別清算又は外国倒産処理手続(外国の法令上これらに相当する手続を含む。)の開始又は承認の申立てがなされた場合を含む。)又は解散若しくは清算の申立てがなされた場合

ホ 乙において解散、公的管理又は清算の決議が行われた場合

ヘ 乙が、自ら若しくはその資産の主要な部分について、管財人、保全管理人その他これに類する者(以下「管財人等」という。)の選任を申し立てた場合又は乙若しくはその資産の主要な部分について管財人等が選任された場合

ト 乙の担保権者が、乙の資産の主要な部分を占有し、又は乙の資産の主要な部分に対して強制執行、差押え、強制管理若しくはその他の法的手続の申立てをした場合であって、かかる占有又は申立てがあった日から15日以内に、担保権者が占有を解除し、又は申立てが却下され、若しくは取り下げられなかったとき

チ 乙について、上記イからトまでの事由と同様の効果を有する事由が発生した場合

リ 乙が、上記イからチまでのいずれかを助成する行為し、又は同意、承認若しくは黙認した場合

- 2 前項各号に掲げる期限の利益喪失事由に関し、甲乙間において前項各号に掲げる事由の一部を適用しないものとし、又は当該事由以外の他の事由を期限の利益喪失事由として追加する旨の別段の合意がある場合には、当該合意に従う。この場合、当該合意により期限の利益喪失事由とされた事由を本契約における期限の利益喪失事由とする。
- 3 前2項の規定にかかわらず、第1項第3号ニに掲げる事由については、甲乙間で合意する場合、次に掲げる事由に代えることができる。
 - 「① 乙が、破産若しくは支払不能に関する法律若しくは債権者の権利に影響を与えるその他の同様の法律に基づき、支払不能若しくは破産の決定その他の救済を求める手続（以下「法的倒産手続」という。）の開始に係る申立てを行った場合若しくは乙が設立若しくは組織された地域若しくはその本社若しくは本店の管轄地に所在し、乙に対する倒産、会社更生若しくは規制に関して主たる管轄権を有する規制当局者、監督者若しくは同様の公務員（以下「規制当局者等」という。）によって、法的倒産手続の開始に係る申立てがなされた場合又は乙自ら若しくは規制当局者等によって、解散若しくは清算の申立てがなされた場合
 - ② 乙について、乙及び規制当局者等以外の者により、法的倒産手続の開始に係る申立てがなされた場合又は解散若しくは清算の申立てがなされた場合であって、かつ支払不能若しくは破産決定、救済命令若しくは解散若しくは清算命令に至ったとき又は当該申立てがなされてから15日以内に却下、取消、執行停止若しくは差止がなされなかったとき」

（期限の利益喪失事由が発生した場合における清算取次ぎの委託の終了）

- 第24条 甲は、乙について期限の利益喪失事由が発生し、継続している場合には、清算取次ぎの委託の期限前終了日（本条の定めるところによりすべての清算取次ぎの委託が委託清算約定の終了日の到来によらずに終了する日をいう。以下同じ。）を指定することができる。期限前終了日の指定は、該当する期限の利益喪失事由を記載した20日以内の事前通知を乙に送付することにより、その効力を生じるものとする。ただし、甲乙間において、期限の利益喪失事由の全部又は一部について、あらかじめ一定の日を期限前終了日として指定する旨の別段の合意がある場合には、当該合意に従う。
- 2 期限前終了日時点におけるすべての清算取次ぎの委託は、甲又は乙から別段の意思表示を要することなく、期限前終了日において当然に終了する。
 - 3 前2項の規定にかかわらず、乙について前条第1項第3号ニに掲げる期限

- の利益喪失事由が発生した場合、すべての清算取次ぎの委託は、甲又は乙から別段の意思表示を要することなく、当該期限の利益喪失事由が発生する直前において当然に終了するものとし、その終了の日を期限前終了日とする。
- 4 甲又は乙は、前2項の規定により清算取次ぎの委託が終了する場合には、あらかじめ、又はその終了後遅滞なく、清算機構に対し届出を行うものとする。
 - 5 第2項又は第3項の規定によりすべての清算取次ぎの委託が終了した場合、当該各委託清算約定は、甲の自己の計算による清算約定として清算機構との間で存続するものとする。
 - 6 第2項又は第3項の規定によりすべての清算取次ぎの委託が終了した場合、甲及び乙は、当該各清算取次ぎの委託に関して期限前終了金額を授受するものとする。この場合において、当該期限前終了金額は、当該委託清算約定について期限前終了日における清算値段に基づき算出される値洗損益金通算額及び決済差金通算額の合計額に相当する額から乙が負担すべきものであって甲が必要と認めた額を差し引いた額とし、当該金額が正数の場合には甲から乙に期限前終了金額を支払い、当該金額が負数の場合には乙から甲に期限前終了金額を支払う。
 - 7 甲は、期限前終了日以降可能な限り速やかに、前項に規定する期限前終了金額の算出を行うものとし、当該期限前終了金額を算出した場合には、当該期限前終了金額の明細（前項の規定に従い算出した期限前終了金額の算出に利用した情報の内容を含む。）について、乙に対して通知するものとする。
 - 8 甲及び乙が前条第3項の規定により同条第1項第3号ニに掲げる事由を変更する旨の合意をした場合、第3項の規定は次のとおり読み替えられるものとする。

「前2項の規定にかかわらず、甲は、乙について前条第1項第3号ニに掲げる期限の利益喪失事由が発生し、継続している場合には、当該事由の発生日から20日間（以下本項において「期限前終了日指定期間」という。）に限り、清算取次ぎの委託の期限前終了日を指定することができる。この場合の期限前終了日の指定方法及びその効力は前2項の規定に従う。甲が期限前終了日指定期間内に期限前終了日の指定を行わなかった場合、すべての清算取次ぎの委託は、甲又は乙から別段の意思表示を要することなく、当該期限前終了日指定期間の満了時において当然に終了する。」

（清算取次ぎの委託終了時におけるOTC証拠金等の返還）

第25条 前条第2項又は第3項の規定によりすべての清算取次ぎの委託が終

了した場合、甲は、乙から預託を受けたOTC証拠金を直ちに乙に返還するものとする。ただし、次条の規定により当該OTC証拠金に係る債権債務が清算される場合を除き、乙は、第17条第1項の規定に基づき、すべての清算取次ぎの委託に基づく清算約定の決済が完了するまでの間、甲に対し、当該OTC証拠金の返還を請求することができない。

- 2 前項の場合において、OTC証拠金のうち充用有価証券については、甲は、甲乙間に別段の合意がある場合を除き、当該充用有価証券の返還に代えて、期限前終了日における当該充用有価証券の時価に相当する金銭を返還するものとする。

(清算取次ぎの委託終了時における債権債務の一括清算)

第26条 第24条第2項又は第3項の規定によりすべての清算取次ぎの委託が終了した場合、期限前終了日において甲乙間に存在するすべての本契約に基づく金銭債務（同条第6項の規定による清算取次ぎの委託の終了に伴う期限前終了金額の支払債務、前条の規定によるOTC委託証拠金の返還債務、未払いの決済差金の支払債務その他甲乙間の一切の金銭債務を含む。）は、次に定めるところにより清算されるものとする。

- (1) 第24条第2項又は第3項の規定により終了したすべての清算取次ぎの委託について甲から乙に支払うべき期限前終了金額の総額その他期限前終了日において存在する甲の乙に対する金銭債務（前条の規定によるOTC委託証拠金の返還債務を除き、以下「期限前終了日甲負担債務」という。）と、当該清算取次ぎの委託について乙から甲に支払うべき期限前終了金額の総額その他期限前終了日において存在する乙の甲に対する金銭債務（以下「期限前終了日乙負担債務」という。）とを差引計算する。
- (2) 前号の規定による差引計算の結果、期限前終了日乙負担債務がある場合には、その金額から乙が甲に預託したOTC委託証拠金（OTC委託証拠金が充用有価証券である場合において前条の規定により甲が充用有価証券の時価に相当する金銭を返還するものでないときは、その換価処分等の後の金銭）の額を差し引く。その結果、期限前終了日乙負担債務の額が負数となる場合には、甲は、その負数の絶対値に相当する金額を直ちに乙に返還する債務を負うものとする。
- (3) 前号の規定による差引計算の結果、なお期限前終了日乙負担債務がある場合には、その金額から乙が清算機構に預託したOTC取引証拠金（OTC取引証拠金が充用有価証券である場合には、甲による換価処分等の後の金銭）の額を差し引く。その結果、期限前終了日乙負担債務の額が負数となる場合には、乙は、その負数の絶対値に相当する金額に限り、甲に対し、

清算機構から交付を受けたOTC取引証拠金の返還請求権を行使することができる。

- (4) 前号の規定による差引計算の結果、なお期限前終了日乙負担債務がある場合には、その金額をもってすべての清算取次ぎの委託に基づく清算約定の終了に伴う乙の甲に対する債務（以下本条において「乙最終債務」という。）とし、乙最終債務に係る債権を甲の乙に対する債権とする。
- (5) 第1号の規定による差引計算の結果、期限前終了日甲負担債務がある場合には、その絶対値の金額及び前条の規定によるOTC委託証拠金の返還債務の合計額をもってすべての清算取次ぎの委託の終了に伴う甲の乙に対する債務（以下本条において「甲最終債務」という。）とし、甲最終債務に係る債権を乙の甲に対する債権とする。

第2節 甲の支払不能

（甲の支払不能による委託清算約定の終了）

第27条 清算機構が甲の支払不能を認定した場合、委託清算約定は、清算機構又は甲から別段の意思表示を要することなく、甲について清算機構が支払不能を認定した日において当然に終了する。

（未決済約定の承継）

第28条 乙は、前条の規定により委託清算約定が終了した場合には、業務方法書等の定める期間内に限り、業務方法書等の定めに従い、承継清算参加者（本項に規定する承継清算参加者をいう。）を通じて清算機構に清算機構所定の承継申込書を差し入れることにより、次に掲げる権利義務（以下「未決済約定」という。）を一括して他のOTC清算参加者（以下「承継清算参加者」という。）に承継（業務方法書等の定めるところにより、清算機構、承継清算参加者及び乙の間で未決済約定を新たに発生させるとともに、それに伴う金銭の授受及び権利義務の処理を行うことをいう。以下本節において同じ。）させることができる。

- (1) 甲及び清算機構の間の委託清算約定に係る権利義務（前条の規定により委託清算約定が終了する直前のもの）と業務方法書等の定める条件が同一となる権利義務
- (2) 甲及び乙の間の清算取次ぎの委託に係る権利義務（前条の規定により委託清算約定が終了する直前のもの）と業務方法書等の定める条件が同一となる権利義務

2 甲及び乙は、前項の規定により承継清算参加者が未決済約定を承継した場

合には、当該承継の時点で、第15条の規定により乙が返還請求権を有するOTC取引証拠金が承継清算参加者を代理人として清算機構に預託されたOTC取引証拠金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。

- 3 乙は、第1項の規定により清算機構に対して未決済約定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。
- 4 承継清算参加者が未決済約定を承継した場合、甲乙の間の清算取次ぎの委託に係る権利義務（甲の支払不能が認定された時点で弁済期が到来している甲の債務を除く。）及びOTC取引証拠金に係る権利義務（第2項の規定により承継清算参加者を代理人として清算機構に預託されたものとみなされる部分に限る。）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。

(未決済約定の承継が行われなかった場合の清算取次ぎの委託の一括清算等)

第29条 第27条の規定により委託清算約定が終了した場合において、前条の規定による未決済約定の承継が行われなかったときは、甲及び乙は、次項に定めるところにより、当該委託清算約定の終了に伴う期限前終了手数料に相当する額の金銭の授受を行うものとする。

- 2 業務方法書等の定めるところにより清算機構が甲の支払不能を認定した日における、委託清算約定に係る値洗損益金通算額と決済差金通算額の合計額に相当する額その他乙が負担すべきものであって甲が必要と認めた額を、当該委託清算約定に係る期限前終了手数料とする。
- 3 第27条の規定により委託清算約定が終了した場合において、前条の規定による未決済約定の承継が行われなかったときは、乙は、業務方法書等の定めるところにより、OTC取引証拠金の返還請求権の行使を、清算機構に対し直接行うものとする。ただし、第17条第2項の規定に基づき、すべての委託清算約定の決済が完了するまでの間、当該OTC取引証拠金の返還請求権を行使することができない。
- 4 前項の規定に基づき、乙が甲に預託したOTC委託証拠金の額に対応するOTC取引証拠金の返還請求権の行使を清算機構に対し直接行う場合は、清算機構の定めるところにより、甲が清算機構に預託したOTC取引証拠金（差換預託分）における充用有価証券は換価処分され、乙が甲に預託したOTC委託証拠金が金銭又は充用有価証券のいずれであるかにかかわらず、金銭でのみ返還が行われるものとする。この場合において、乙は、甲がOTC取引証拠金（差換預託分）として預託した充用有価証券の相場の変動等により、

返還請求権を有する額全額の返還を受けられない場合があることについて、乙はあらかじめ同意する。

- 5 第27条の規定により委託清算約定が終了した場合において、乙は、第2項に規定する乙の債務を直ちに弁済するものとする。

第3節 他のOTC清算参加者の支払不能による未決済約定の承継等

(他の清算参加者の支払不能による未決済約定の承継)

- 第30条 清算機構が他のOTC清算参加者（乙との間で清算受託契約を締結しているOTC清算参加者に限る。以下「支払不能清算参加者」という。）の支払不能を認定し、支払不能清算参加者が乙の計算において行っていた清算約定が終了した場合において、乙が甲に対して当該清算約定その他業務方法書等の定める権利義務（以下「支払不能清算参加者の未決済約定」という。）の承継（業務方法書等の定めるところにより、清算機構、甲及び乙の間で支払不能清算参加者の未決済約定を新たに発生させるとともに、それに伴う金銭の授受及び権利義務の処理を行うことをいう。以下本条において同じ。）の申込みをし、甲がこれを承諾した場合には、甲は、業務方法書等の定めるところにより、支払不能清算参加者の未決済約定を承継する。
- 2 甲は、前項の規定により支払不能清算参加者の未決済約定を承継する旨を承諾し、かつ乙から業務方法書等の定めるところにより承継申込書の差し入れを受けた場合には、業務方法書等の定める期間内に、清算機構に対して、当該承継申込書（甲が当該承継の申込みを受けた旨及び当該承諾をした旨、乙が清算機構に承継の申込みをする旨並びに甲が清算機構に承継の申込みをする旨が記載されていることを要する。）を提出しなければならない。
 - 3 第1項の規定により甲が支払不能清算参加者の未決済約定を承継した場合、承継した支払不能清算参加者の未決済約定を本契約における委託清算約定及び清算取次ぎの委託とみなして、本契約の規定を適用する。
 - 4 甲及び乙は、第1項の規定により甲が支払不能清算参加者の未決済約定を承継した場合には、当該承継の時点で、乙と支払不能清算参加者の間の清算受託契約の規定により乙が返還請求権を有するOTC取引証拠金が甲を代理人として清算機構に預託されたOTC取引証拠金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。

(引受人との間で成立したものとみなされる清算対象取引)

- 第31条 乙が支払不能清算参加者との間で行った清算取次原取引又は乙が支払不能清算参加者の清算委託者との間で行った清算取次原取引（当該清算取

次原取引を基とする清算約定について業務方法書等の規定に基づく承継が行われなかった場合に限る。)を基とする反対清算約定について、業務方法書等に定めるところにより、清算機構が引受人を選定し引き受けさせた場合は、甲及び乙は、乙と当該引受人との間において、清算取次原取引が成立したものとみなされることについてあらかじめ同意する。

第7章 雑則

(委託手数料)

第32条 乙は、乙の清算取次ぎの委託に基づく委託清算約定が成立及び消滅した場合その他甲が定める場合においては、甲の定めるところにより、甲に委託手数料を支払うものとする。

(充用有価証券等の換価処分の特例)

第33条 甲は、乙から差し入れ又は預託を受けた充用有価証券のうち、振替により乙に返還する場合であって、甲がその責めに帰することができない事由によって当該振替により返還することができないときは、当該充用有価証券を換価処分し、金銭によって返還することができる。この場合において、税負担及び換価費用は乙の負担とし、乙は当該換価処分に対し異議を申し立てることができない。

(本契約の合意解約)

第34条 本契約は、甲乙協議のうえ、合意により解約することができる。

2 前項の規定によるほか、甲又は乙は、解約を希望する日から○営業日以上前に、相手方に対して書面により解約の意思を申し出ることにより、本契約を解約することができる。

3 甲は、前2項の規定により本契約を解約しようとする場合には、あらかじめ清算機構に対する届出を行うものとする。この場合、第1項の規定による解約の場合は解約しようとする日の3営業日前までの日までに、第2項の規定による解約の場合は甲が相手方に対し書面により解約の意思を申し出た又は申し出を受けた後遅滞なく(ただし、第2項の規定による解約が、本契約を解約することができる条件をあらかじめ定めている場合においては、解約の意思を申し出た後直ちに、かつ、解約を行おうとする日の前日まで)、当該届出を行うものとする。

4 第1項及び第2項の規定による本契約の解約までに成立した清算取次ぎの委託に基づく清算約定に関しては、引き続き本契約を適用する。

- 5 第1項及び第2項の規定にかかわらず、第3項の規定による届出が清算機構に到達するまでの間は、本契約の解約は、その効力を生じないものとする。

(本契約の強制解約等)

第35条 甲は、乙について期限の利益喪失事由が発生し、継続している場合には、乙に対して20日以内の書面による通知をすることにより、直ちに本契約を解約することができる。ただし、甲乙間において、期限の利益喪失事由の全部又は一部が発生した場合には、甲から乙に対して書面による通知を送付することなく、当然に本契約を終了させる旨の合意がある場合には、当該合意に従う。

- 2 清算機構が甲の支払不能を認定した場合、本契約は、当該認定の時点におけるすべての清算取次ぎの委託に基づく清算約定の清算が完了した時点をもって、甲又は乙から別段の意思表示を要することなく、当然に終了する。
- 3 甲は、前2項の規定により本契約が終了する場合には、あらかじめ、又はその終了後遅滞なく、清算機構に対する届出を行うものとする。
- 4 第1項及び第2項の規定にかかわらず、前項の規定による届出が清算機構に到達するまでの間は、本契約の解約は、その効力を生じないものとする。
- 5 第1項の規定により本契約が終了した場合において、その終了時点で清算取次ぎの委託に基づく清算約定の清算が完了していない場合には、当該清算取次ぎの委託に基づく清算約定及びその清算に関しては、引き続き本契約を適用する。

(報告)

- 第36条 乙は、甲が請求したときは、清算取次ぎの委託に基づく清算約定に関して必要な事項を甲に対して遅滞なく報告しなければならない。
- 2 乙は、期限の利益喪失事由が発生した場合には、甲に対し、直ちに書面をもってその旨の報告をしなければならない。

(債権譲渡等の禁止)

第37条 甲及び乙は、本契約に基づいて有する債権を、第三者に対して譲渡、質入れその他の処分をしてはならない。

(秘密保持)

第38条 甲及び乙は、本契約に関して業務上知り得た相手方の業務上の秘密（一般に知られておらず、他人に知られないことについて客観的に相当の利益を有する事実をいう。）を保持するものとし、他の目的のために利用しては

ならない。

2 甲及び乙は、次に掲げる場合その他の正当な理由がある場合を除き、前項の秘密を第三者に漏らしてはならない。

- (1) 相手方当事者の事前の書面による同意を得た場合
- (2) 裁判所、監督官庁その他公的機関若しくは商品取引所の命令若しくは要請又は法令の規定に基づき、開示又は提供を求められた場合
- (3) 本契約の履行又は自らの権利を保全するために必要な範囲で、弁護士、公認会計士、税理士等の専門家に開示又は提供する場合
- (4) 清算機構に対して報告し、又は清算機構の監査に応じる場合

(届出事項の変更届出)

第39条 乙は、商号若しくは名称、代表者、甲に届け出た印章若しくは署名鑑又は住所若しくは事務所の所在地その他の事項に変更があった場合には、甲に対して、直ちに書面をもってその旨届け出なければならない。

(免責事項)

第40条 天災地変等の不可抗力により、乙の請求に係るOTC証拠金の返還その他の債務の履行が遅延した場合に生じた損害については、甲及び清算機構はその責を負わないものとする。

2 前項の事由によるOTC証拠金の紛失、滅失、毀損等の損害についても甲及び清算機構はその責を負わないものとする。

3 甲が、諸届その他の書類に使用された印影又は署名を届出の印鑑又は署名鑑と相当の注意をもって照合し、相違ないものと認めて取り扱ったうへは、それらの書類につき偽造、変造その他の事故があっても、そのために生じた損害について甲はその責を負わないものとする。

(通知の効力)

第41条 本契約に関する通知その他の甲乙間の通信は、次の各号に掲げる方法により、乙が甲に届け出た住所若しくは事務所宛てに、又は電子通信システム若しくは電子メールの詳細に従って行われ、当該各号に定める時点（現地営業日（通知の宛先として指定される場所において商業銀行が一般業務（外国為替及び外貨預金の取扱を含む。）を行う日という。以下本項において同じ。）でない場合又は現地営業日の営業終了後である場合には翌現地営業日）で効力を生じる。ただし、第23条又は第24条に関する通知その他の甲乙間の通信は、第5号及び第6号に掲げる方法以外の方法により行われることを要する。

- (1) 書面で手渡し又は送付する方法 到達日
 - (2) テレックスで送信する方法 受取人のアンサーバックが受領された日
 - (3) ファクシミリで送信する方法 受取人の資格を有する従業員が判読可能な状態で受領した日
 - (4) 内容証明若しくは書留郵便又はこれらと同等の方法で送付する方法 これらが配達された日又は配達を試みられた日
 - (5) 電子通信システムにより送信する方法 受信された日
 - (6) 電子メールにより送信する方法 配信された日
- 2 乙が甲に届け出た住所又は事務所に宛てて行われた通知その他の甲乙間の通信が、乙の責に帰すべき事由により延着し、又は到達しなかった場合には、当該通知は、通常到達すべき時に到達したものとみなす。

(標準時)

第42条 本契約において使用される年月日時は、本契約に別段の定めがあるものを除くほか、すべて日本標準時を意味するものとする。

(電磁的方法による報告等)

第43条 乙は、甲の承諾を得た場合には、第36条第2項の規定による書面による報告又は第39条の規定による書面による届出（印章又は署名鑑の変更に係るものを除く。）に代えて、当該報告又は届出を行うための書面に記載すべき事項を電子情報処理組織を使用する方法その他の情報通信の技術を利用する方法により提供することができる。この場合において、乙は、書面により当該報告又は届出を行ったものとみなす。

(覚書等の締結)

第44条 甲及び乙は、本契約及び業務方法書等に矛盾又は抵触しない限度において、本契約又は本契約に基づく清算取次ぎの委託に関する事項（遅延損害金に関する事項、振込手数料の負担に関する事項その他本契約に定めのない事項を含む。）について、覚書その他の合意書を締結することができる。

(定めのない事項)

第45条 清算取次ぎの委託に関し、本契約に定めのない事項については、前条の甲乙間の覚書その他の合意書の定めによるほか、業務方法書等に従うものとする。

(優先関係)

更することができる。

(注4) 本則の規定中「甲乙間の合意」又は「甲乙間に別段の合意がある場合」との文言のある箇所については、第44条の規定により別途覚書を締結する方法のほか、本契約への規定又は別紙を参照する等の方法により本契約中に当該合意の内容を定めることができる。

(様式第3号)

誓約書

平成〇〇年〇〇月〇〇日

株式会社日本商品清算機構
代表取締役社長 〇〇 〇〇 殿

所在地
商号又は名称
代表者名 印

〇〇〇〇〇〇（以下「当法人」といいます。）は、貴社の定めた店頭商品デリバティブ取引等清算業務に関する業務方法書（以下「業務方法書」といいます。）第39条第2項の規定及び〇〇〇〇（以下「本〇ＴＣ清算参加者」といいます。）との間で締結した平成〇〇年〇〇月〇〇日付清算受託契約第3条第1項の規定に基づき、あらかじめ本業務方法書等の内容を確認及び了承のうえ、本〇ＴＣ清算参加者を經由して、この誓約書（以下「本誓約書」といいます。）を貴社に提出します。

なお、本誓約書において使用する用語は、本誓約書に別段の定めがある場合を除くほか、業務方法書において使用される用語の例によるものとします。

1. 当法人は、貴社が行う〇ＴＣ取引清算業務、本〇ＴＣ清算参加者との間における清算取次ぎの委託その他本業務方法書等の定める事項に関し、本業務方法書等（本業務方法書等が本業務方法書等の定めるところにより変更された場合には、当該変更後の本業務方法書等）及び本〇ＴＣ清算参加者との間で締結した清算受託契約の定めに従い、また、これらを遵守します。
2. 当法人は、次に掲げる事項に同意します。
 - (1) 本業務方法書等及び本〇ＴＣ清算参加者との間で締結した清算受託契約の定めが、現在又は将来の〇ＴＣ証拠金に係る権利義務その他業務方法書第1条第1項各号に掲げる事項に適用されること。
 - (2) 本業務方法書等及び本〇ＴＣ清算参加者との間で締結した清算受託契約の定めが本業務方法書等の定めるところにより変更された場合には、本誓約書の内容も当該変更に応じて当然に変更されること。
 - (3) 本〇ＴＣ清算参加者以外の〇ＴＣ清算参加者と清算受託契約を締結した

清算委託者と当法人との間のOTC取引を清算取次原取引とする清算取次ぎの委託において、当該清算委託者が当該OTC清算参加者に対して当該清算取次原取引に係る情報を提供し、当該OTC清算参加者がこれを受領すること。

- (4) 貴社が、本誓約書を、前号に掲げる事項について当法人が同意していることを証する書面として同号のOTC清算参加者又は清算委託者のためにも保管し、また、当該OTC清算参加者又は当該清算委託者に対し、本誓約書又はその内容を、法令上必要な限度において、開示すること。

以 上