

OTC 清算預託金に関する取扱要綱

(目的)

第1条 この OTC 清算預託金に関する取扱要綱（以下「本要綱」という。）は、店頭商品デリバティブ等取引清算業務に関する業務方法書（以下「OTC 業務方法書」という。）第72条第1項に規定する OTC 一般清算預託金の額、同第73条に規定する OTC 一般清算預託金の預託方法、同第75条第1項に規定する OTC 一般清算預託金の管理、同第75条第2項に規定する OTC 一般清算預託金の果実、同第78条第1項に規定する OTC 一般清算預託金の返戻、同第79条に規定する OTC 清算資格喪失の際の OTC 一般清算預託金の返戻に関し必要な事項を定める。

(OTC 一般清算預託金の預託額等)

第2条 取得申請者が資格予定期日の前営業日までに当社に預託しなければならない OTC 一般清算預託金の額は、500 万円とする。

2 当社は、OTC 清算参加者の OTC 一般清算預託金の預託額を OTC 一般清算預託金算出日（1月、4月、7月及び10月の最終営業日をいう。以下同じ。）に見直しを行い、当該 OTC 一般清算預託金の額として OTC 一般清算預託金算出日の翌々の第1営業日（以下「適用開始日」という。）から、その次の OTC 一般清算預託金の算出日の属する月の翌月の最終営業日まで適用する。

3 OTC 一般清算預託金の額は、前項に定める OTC 一般清算預託金算出日において、当社が被る可能性があるものとして算出したリスク相当額を OTC 清算参加者の清算約定の割合に応じて按分した額（当社が別に定める方式により算出した額とし、第1項に定める額を下回らないものとする。）とする。

4 当社は、OTC 一般清算預託金算出日の6営業日後までに前項に定める OTC 一般清算預託金の預託額を OTC 清算参加者に通知する。

5 OTC 清算参加者は、第2項に定める見直しにより OTC 一般清算預託金に過不足が生じたときは、適用開始日までにこれを預託しなければならない。

(OTC 一般清算預託金の預託及び返戻方法)

第3条 OTC一般清算預託金（金銭に限る。）の預託及び返戻方法は、OTC清算参加者が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第28条に規定する決済銀行に設ける口座（「決済口座」という。）からの口座振替により行うものとする。

2 当社が特に必要と認めた場合にあつては、前項の規定にかかわらず、前項の口座振替によらない預託及び返戻方法をとることができるものとする。

3 OTC 一般清算預託金（充用有価証券に限る。）の預託及び返戻方法は、店頭商品デリバティブ取引等清算業務に係る充用有価証券に関する取扱要綱に定めるもの

とする。

(OTC 一般清算預託金の預託及び返戻申請手続き等)

第4条 OTC 清算参加者が、OTC 一般清算預託金（金銭に限る。）の預託及び返戻の申請を行う場合にあつては、当社に預託しようとする又は当社から返戻を受けようとする営業日の午前10時までに、当社が定める様式により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付する方法により行うものとする。

2 当社が特に必要と認めた場合にあつては、前項の規定にかかわらず、前項に定める申請以外の申請方法を行うことができる。

3 OTC 一般清算預託金（充用有価証券に限る。）の預託及び返戻の申請は、店頭商品デリバティブ取引等清算業務に係る充用有価証券に関する取扱要綱に定める。

(OTC 一般清算預託金の管理)

第5条 当社は、OTC 一般清算預託金の金銭による預託総額が、当社が別に定める一定額に達するまで決済性預金にて保管する。

(OTC 一般清算預託金の果実)

第6条 OTC 業務方法書第75条第2項に規定する配分の対象となる果実は、当社が OTC 一般清算預託金（金銭に限る。）の運用によって3月1日から翌年2月の最終営業日まで（以下「計算期間」という。）に実際に得た果実（以下「果実」という。）とする。

(配分計算)

第7条 当社は、前条に定める果実の額を、計算期間のすべての月の最終営業日におけるすべての OTC 清算参加者の預託額の累計を十二で除して得た額で除して得た値に、計算期間のすべての月の最終営業日における OTC 清算参加者ごとの預託額の累計を十二で除して得た額を乗じて得た額を、OTC 清算参加者に対し配分するものとする。

2 前項に定める OTC 一般清算預託金の果実の配分計算によって得た額に一円未満の端数があるときは、当該端数を切り捨てるものとし、果実の配分の結果余剰額がある場合はこれを翌計算期間の果実の額に加算する。

(OTC 清算資格の喪失に係る処理)

第8条 OTC 清算参加者の清算資格の喪失により、前条に定める OTC 一般清算預託金の果実の配分に伴う返戻が行えない場合には、代表取締役社長の指示に基づき処理するものとする。

(本要綱の改廃)

第9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。