

## 店頭商品デリバティブ取引等清算業務に係る 取引証拠金等に関する規則

### (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係る取引証拠金等に関する規則（以下「本規則」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、店頭商品デリバティブ取引に基づく債務の引受けを行う業務及びこれに附帯する業務（以下「OTC取引清算業務」という。）におけるOTC取引証拠金について必要な事項を定めることを目的とする。

### (OTC清算参加者の当初証拠金の算出対象となる清算約定)

第2条 業務方法書第56条第1項に定める清算約定（自己分）並びに清算約定（委託分）に係る当初証拠金は、次の各号に規定する清算約定を対象として算出するものとする。

- (1) 算出の対象となる清算約定（自己分）とは、毎営業日午後6時30分の時点までに業務方法書第45条に基づき、当社が債務の引受けを行った清算約定（自己分）とする。
- (2) 算出の対象となる清算約定（委託分）とは、毎営業日午後6時30分の時点までに業務方法書第45条に基づき、当該OTC清算参加者に係る清算約定（委託分）として、当社が債務の引受けを行った清算約定（委託分）とする。

### (清算委託者の当初証拠金の算出対象となる清算約定)

第3条 業務方法書第57条第1項に定める清算委託者に係る当初証拠金は、毎営業日午後6時30分の時点までに業務方法書第51条に基づき、当該清算委託者に係る清算約定として当社が債務の引受けを行った清算約定を対象として算出するものとする。

### (OTC清算参加者の変動証拠金の算出対象となる清算約定)

第4条 業務方法書第58条第1項に定める清算約定（自己分）並びに清算約定（委託分）に係る変動証拠金は、次の各号に規定する清算約定を対象として算出するものとする。

- (1) 算出の対象となる清算約定（自己分）とは、毎営業日午後6時30分の

時点までに業務方法書第45条に基づき、当社が債務の引受けを行った清算約定（自己分）のうち決済差金の授受が行われていない清算約定とする。

- (2) 算出の対象となる清算約定（委託分）とは、毎営業日午後6時30分の時点までに業務方法書第45条に基づき、当該OTC清算参加者に係る清算約定（委託分）として、当社が債務の引受けを行った清算約定（委託分）のうち決済差金の授受が行われていない清算約定とする。

#### **(清算委託者の変動証拠金の算出対象となる清算約定)**

第5条 業務方法書第59条に定める清算委託者に係る変動証拠金は、毎営業日午後6時30分の時点までに業務方法書第51条に基づき、当該清算委託者に係る清算約定として当社が債務の引受けを行った清算約定のうち決済差金の授受が行われていない清算約定を対象として算出するものとする。

#### **(OTC取引証拠金の預託及び返戻方法)**

第6条 業務方法書第62条に定めるOTC取引証拠金（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29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っては、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 業務方法書第62条に定めるOTC取引証拠金（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取引証拠金に係る預託及び返戻申請手続き等)**

第7条 業務方法書第69条各項に定めるOTC取引証拠金（金銭に限る。）の預託及び返戻の申請は、当社に預託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時までに当社所定の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 業務方法書第69条各項に定めるOTC取引証拠金（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ものとする。

#### **(清算委託者による返還請求権の行使)**

第8条 清算委託者は、業務方法書第68条第2項の規定に基づき当社に対しOTC取引証拠金のOTC取引証拠金維持額に対する超過額の返還を請求す

- る場合は、同条第4項の規定に基づき、OTC清算参加者を代理人として行わなければならない。
- 2 業務方法書第68条第3項に定める当社が定める場合は、清算受託契約に基づき、すべての清算取次ぎの委託が終了した場合とする。この場合において、当社は、清算委託者から預託を受けたOTC取引証拠金の全部を、当該清算委託者との間で同項の清算受託契約を締結しているOTC清算参加者に返戻するものとする。
  - 3 OTC清算参加者は、当該清算委託者が清算受託契約書の定めるところにより清算取次ぎの委託に関して当該OTC清算参加者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。）がある場合には、前項の規定により当社から返戻を受けた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、清算受託契約の定めるところにより、当該充用有価証券の充用価格の時価評価額（第2項に規定するすべての清算取次ぎの委託が終了した日の時価等をいう。）に相当する金銭又は当該充用有価証券の換価処分後の金銭）を当該未履行債務に充当し、その残額を当該清算委託者に返還する。
  - 4 業務方法書第68条第4項ただし書きに定める清算委託者によるOTC取引証拠金の返還請求権の行使は、当社が必要と認める事項を当社に申請させるものとし、当該申請を適当と認めた時は、当社の本店所在地においてその支払いを行うものとする。なお、当該返還請求権の行使は、当該清算委託者に係る未決済約定がすべて決済された日以後においてできるものとする。

#### **（OTC取引証拠金の預託方法の変更等）**

第9条 当社は、業務方法書第101条又は第102条の規定に基づき、清算約定の決済等の決済時限の繰延べ又は清算の条件を定めることとした場合は、業務方法書第62条に定めるOTC取引証拠金の預託に関して、その履行の時限及び期日の変更並びに当該変更に伴う必要な措置を行うことができる。

#### **（本規則の改廃）**

第10条 本規則の改廃は、代表取締役社長の決裁をもって行うものとする。

## 附 則

本規則は、平成26年5月16日から実施する。