

正文は英文とします。

(参 考 訳)



国際スワップ・デリバティブズ協会により 2013年3月22日に公表された

ISDA 2013年3月DF追加条項¹

¹ 本2013年3月DF追加条項は、下記の最終規則上の要請に対応する目的で作成された。

(1) CFTC、最終規則「スワップ・ディーラーおよび主要スワップ参加者に係る、コンファメーション、ポートフォリオ照合、ポートフォリオ・コンプレッションおよびスワップ取引関連ドキュメンテーションの必要要件」(77 Fed. Reg. 55904、2012年9月11日)

(2) CFTC、最終規則「スワップ清算集中義務のエンドユーザーの適用除外」(77 Fed. Reg. 42559、2012年7月19日)

(3) CFTC、最終規則「商品取引所法第2条(h)に基づく清算集中義務の決定」(77 Fed. Reg. 74284、2012年12月13日)

目次

2013年3月DFスケジュール1	
用語定義.....	2
2013年3月DFスケジュール2	
一般条件.....	11
第1部 一般的表明および合意.....	11
第2部 コンファメーション.....	12
第3部 清算集中.....	12
第4部 エンドユーザーの適用除外.....	13
第5部 秩序ある清算の権限.....	15
2013年3月DFスケジュール3	
リスク評価の計算および紛争解決.....	16
第1部 商品取引所法第4条s(j)との関係におけるリスク評価の計算	16
第2部 商品取引所法第4条s(j)との関係におけるリスク評価の紛争解決	17
第3部 その他の評価との関係.....	18
2013年3月DFスケジュール4	
ポートフォリオ照合.....	19
第1部 照合要請日.....	19
第2部 一方当事者によるポートフォリオ・データの送付.....	19
第3部 ポートフォリオ・データの交換.....	20
第4部 不整合極度額未満の評価の差額.....	21
第5部 SDRデータとの照合.....	21
第6部 その他のポートフォリオ照合手続.....	22



国際スワップ・デリバティブズ協会

ISDA 2013年3月DF追加条項

(2013年3月22日公表)

(International Swaps and Derivatives Association, Inc. (以下、「ISDA」という。)) 公表の) 本ISDA2013年3月DF追加条項 (以下、「2013年3月DF追加条項」という。) に対する以下のスケジュールは、ある契約 (以下、かかる契約を「対象契約」という。) に関して、本2013年3月DF追加条項のいずれかのスケジュール (以下、かかる各スケジュールを「2013年3月DFスケジュール」という。) を対象契約に組み入れる旨を関連当事者が書面の合意で示すことにより、組み入れられることができるものである。このような方法で対象契約に組み入れられた各2013年3月DFスケジュールは、当該対象契約において別段の定めのない限り、当該対象契約に適用される。本2013年3月DF追加条項の表題および脚注は、情報を提供する目的および参照の簡便性の目的においてのみ挿入されたものであり、本2013年3月DF追加条項の解釈に影響を与えず、また、解釈上考慮されない。

2013年3月DFスケジュール1 用語定義

以下の用語は、本2013年3月DF追加条項において用いられる場合に以下の意味を有する。本2013年3月DF追加条項に定める定義と対象契約に定める定義の間に矛盾がある場合、参照することにより対象契約に組み入れられた2013年3月DFスケジュールに定める用語を解釈する目的においては、本2013年3月DF追加条項に定める定義が優先するものとし、対象契約のその他の用語を解釈する目的においては、当該対象契約に明示的な別段の定めのない限り、対象契約に定められる定義が優先するものとする。

「アクティブ・ファンド」(**Active Fund**)とは、(i)第三者サブアカウントではなく、(ii)2012年11月1日までの12ヵ月間に毎月平均200件以上のスワップを締結した、1940年投資顧問法第202条(a)に定められる「私募ファンド」を意味する。本定義の(ii)との関係において、「スワップ」とは、CFTCがCFTC規則23および50に基づく実施スケジュールとの関係で定義されるスワップを意味し、米国財務長官が商品取引所法第1条a(47)(E)に基づく権限により「スワップ」としての規制から除外する外国為替スワップおよび外国為替フォワードを除くものとするがこれに限らない。

「本件契約」(**Agreement**)とは、ある対象契約に組み入れられた本2013年3月DF追加条項の規定や、かかる規定における定義された用語に従い、当該対象契約(随時修正または補足される)を意味する。

「年次」(**Annually**)とは、各暦年に1回の頻度を意味する。

「適用ポートフォリオ照合遵守日」(**Applicable Portfolio Reconciliation Compliance Date**)とは、適用あるCFTCの解釈およびその他のCFTC規則を含む、CFTC規則23.502およびCFTC規則23.502の適用範囲に関して適用ある法律に基づき、CFTCスワップ組織がカウンターパーティーに関して遵守を求められる日を意味する。疑義を避けるために付言すると、両当事者がCFTCスワップ組織である場合、適用ポートフォリオ照合遵守日は、いずれかのCFTCスワップ組織が他方当事者に関して遵守を求められる最初の日を意味するものとする。

「適用STRD遵守日」(**Applicable STRD Compliance Date**)とは、適用あるCFTCの解釈およびその他のCFTC規則を含む、CFTC規則23.504およびCFTC規則23.504の適用範囲に関して適用のある法律に基づき、CFTCスワップ組織がカウンターパーティーに関し

て遵守を求められる日を意味する。疑義を避けるために付言すると、両当事者がCFTCスワップ組織である場合、適用STRD遵守日は、いずれかのCFTCスワップ組織が他方当事者に関して遵守を求められる最初の日を意味するものとする。

「**カテゴリー1組織**」 (**Category 1 Entity**) とは、(i)スワップ・ディーラー、(ii)主要スワップ参加者、(iii)有価証券関連スワップ・ディーラー、(iv)主要有価証券関連スワップ当事者、または(v)アクティブ・ファンド²を意味する。

「**カテゴリー2組織**」 (**Category 2 Entity**) とは、(i)商品取引所法第1条a(10)およびこれに基づくCFTC規則に定める商品ファンド、(ii)アクティブ・ファンドを除く、1940年投資顧問法第202条(a)に定める「私募ファンド」、または(iii)銀行業務もしくは1956年銀行持株会社法第4条(k)に定める「本質的に金融の性質を有する」業務に主として従事する者を意味するが、いずれの場合も、第三者サブアカウント³ではない組織とする。

「**商品取引所法**」 (**CEA**) とは、改正を含む商品取引所法を意味する。

「**CFTC**」 (**CFTC**) とは、米国商品先物取引委員会を意味する。

「**CFTC規則**」 (**CFTC Regulations**) とは、CFTCが公表する規則、規制、指令、および解釈（改正を含む）を意味する。

「**CFTCスワップ組織**」 (**CFTC Swap Entity**) とは、(i)両当事者が2013年3月DF追加条項との関係で書面にて「CFTCスワップ組織」として合意した当事者（当該合意時に「スワップ・ディーラー」もしくは「主要スワップ参加者」としてCFTCに（正式にまたは暫定的に）登録されているか否かは問わない）、または(ii)「スワップ・ディーラー」もしくは「主要スワップ参加者」としてCFTCに（正式にまたは暫定的に）登録されたもしくは登録される当事者で通知手続に従い他方当事者に当該登録を通知した当事者、を意味する。

「**一括清算条項**」 (**Close-Out Provision**) とは、(i)両当事者が早期終了に伴う支払を決定する手順に書面にて（本件契約の一部を構成するかどうかを問わない）合意したスワップに関しては、かかる手順を示した規定、および(ii)両当事者が早期終了に伴う支払を決定する手順に書面にて（本件契約の一部を構成するかどうかを問わない）合意していないスワップに関しては、かかるスワップが準拠していると仮定して2002年版ISDA

² CFTC 規則 50.25。

³ CFTC 規則 50.25。

マスター契約第6条(e)項(ii)号(1)を意味する。

「コモディティ・オプション」 (**Commodity Trade Option**) とは、CFTC規則32.3(a)に基づき締結されたコモディティ・オプションを意味する。

「カウンターパーティー」 (**Counterparty**または**CP**) とは、CFTCスワップ組織の取引相手である本件契約の当事者を意味する。疑義を避けるために付言すると、本件契約の両当事者がCFTCスワップ組織である場合、各CFTCスワップ組織は、本2013年3月DF追加条項との関係ではカウンターパーティーでもある。

「対象金融会社」 (**Covered Financial Company**) とは、合衆国法典第12編第5381条(a)(8)ドッド・フランク法第201条(a)(8)に定められる「対象金融会社」を意味する。

「信用補完契約」 (**Credit Support Agreement**) とは、担保の提供または移転を規律する両当事者間の書面による契約（もしあれば、本件契約の一部を構成するか否かを問わない）、または1つもしくは複数のスワップに関連するその他の信用補完を意味する。

「クレジット・サポート・コール」 (**Credit Support Call**) とは、信用補完契約の条件に基づいてなされる担保の提供もしくは移転または1つもしくは複数のスワップに関連するその他の信用補完の要求または要請を意味する。

「CSA評価」 (**CSA Valuation**) とは、あるスワップおよびリスク評価日に関して、紛争の場合には本2013年3月DF追加条項のスケジュール3第2部の条件の適用を受け、CSA評価手順に従って決定されるスワップの評価（もしあれば）を意味し、かかるスワップの評価がリスク評価代理人にとって正の値の場合にはプラスの数字で、かかるスワップの評価がリスク評価代理人にとって負の値の場合にはマイナスの数字で表記される。

「CSA評価手順」 (**CSA Valuation Process**) とは、両当事者によって書面で（本件契約の一部を構成するか否かを問わない）合意された、担保もしくはその他の信用補完の提供または移転との関係において、スワップまたはスワップ・ポートフォリオを含み得る1つまたは複数の取引の評価を決定するための手順（もしあれば）を意味する。疑義を避けるために付言すると、かかる書面は、ISDAクレジット・サポート・アネックスまたはその他の書面による契約の形式であってもよい。

「日次」 (**Daily**) とは、各共通営業日に1回の頻度を意味する。

「データ送付日」 (**Data Delivery Date**) とは、本2013年3月DF追加条項の第4.2条または第4.3条（場合に応じて）に従い決定される共通営業日を意味する。

「データ照合」 (**Data Reconciliation**) とは、両当事者間のスワップの当事者自らの帳簿および記録と、当事者が受領または入手したポートフォリオ・データおよび適用ある範囲におけるSDRデータとの比較を意味し、不整合に関しては、かかる不整合を特定および解決する手順を意味する。データ照合には、第三者ポートフォリオ照合サービスまたはシステム・エンジンなどのシステムに基づく手段により実行される体系的な、個別取引ごとの、および分野ごとの照合手順を含むことがある（ただし、これを含む必要はなく、これに限定されないものとする）。

「DCO」 (**DCO**) とは、商品取引所法第1条a(15)およびCFTC規則に定義される「デリバティブ清算機関」を意味する。

「不整合」 (**Discrepancy**) とは、(i)スワップに関して受領したポートフォリオ・データおよびそのスワップのために入手したSDRデータに関しては、当該ポートフォリオ・データまたはSDRデータにおける主要条件と、当事者自らの記録上の対応する主要条件との不整合を意味し、(ii)スワップに関して受領したポートフォリオ・データに関しては、当該ポートフォリオ・データで報告される評価と、当事者自らが算出したスワップの評価（商業的に合理的な結果を導くために誠実かつ商業的に合理的な手続を用いて同じ共通営業日付で算出）の差額が不整合極度額を超える場合に、当該差額を意味する。

「不整合極度額」 (**Discrepancy Threshold Amount**) とは、あるスワップに関して、当該スワップの両当事者による評価の絶対額のうち大きい方の数字の10%と等しい金額を意味する。

「ドッド・フランク法」 (**Dodd-Frank Act**) とは、ドッド・フランク・ウォール街改革および消費者保護法（改正を含む）を意味する。

「FDIA」 (**FDIA**) とは、1950年連邦預金保険法（改正を含む）を意味する。

「FDIC」 (**FDIC**) とは、連邦預金保険公社を意味する。

「金融会社」 (**Financial Company**) とは、合衆国法典第12編第5381条(a)(11)ドッド・フランク法第201条(a)(11)に定められる「金融会社」を意味する。

「当初清算集中義務決定」 (**Initial Mandatory Clearing Determination**) とは、特定の金利スワップおよびクレジット・デフォルト・スワップについては、CFTC規則39.5⁴ (改正を含む)においてこれらのスワップの清算業務を行いうるDCOでの清算集中が義務付けられるという趣旨の規則決定に関して、当初2012年12月12日に連邦官報に公表された、商品取引所法第2条(h)に基づくCFTCによる決定を意味する。

「預金保険対象機関」 (**Insured Depository Institution**) とは、合衆国法典第12編第1813条に定める「預金保険対象機関」を意味する。

「共通営業日」 (**Joint Business Day**) とは、各当事者に関して現地営業日である日を意味する。

「現地営業日」 (**Local Business Day**) とは、2013年3月DF追加条項の規定で用いられ、ある当事者に関して、当該当事者が2013年3月DF追加条項情報において指定した1つまたは複数の都市において商業銀行が一般業務 (外国為替市場におけるディーリングおよび外貨預金業務を含む) の営業を行なっている日を意味する。当事者が2013年3月DF追加条項情報において都市を指定しない場合、かかる当事者は、他方当事者が2013年3月DF追加条項情報において指定した都市を指定したものとみなされる。いずれの当事者も2013年3月DF追加条項情報において都市を指定しない場合、両当事者はニューヨークを指定したものとみなされる。

「主要有価証券関連スワップ当事者」 (**Major Security-Based Swap Participant**) とは、証券取引法第3条(a)(67)およびこれに基づく規則3a67-1に定められる「主要有価証券関連スワップ当事者」を意味する。

「主要スワップ参加者」 (**Major Swap Participant**) とは、商品取引所法第1条a(33)およびこれに基づくCFTC規則1.3(hhh)に定められる「主要スワップ参加者」を意味する。

「2013年3月DFスケジュール」 (**March 2013 DF Schedule**) とは、本2013年3月DF追加条項の導入部において定義された意味を有するものとする。

「2013年3月DF追加条項情報」 (**March 2013 DF Supplement Information**) とは、両当事者が2013年3月DF追加条項情報として書面にて合意した情報または表明を意味し、本2013年3月DF追加条項第2.3条に従いもしくは両当事者が合意したその他の方法により、随時修正または補足される。

⁴ 77 Fed. Reg. 74284, 2012年12月13日。

「**2013年3月DF追加条項規則**」 (**March 2013 DF Supplement Rules**) とは、次の連邦官報の公表物に記載され、随時修正および補足されるCFTC規則23.500から23.505、CFTC規則50.50、およびCFTC規則50.4を意味する。(i)CFTC、最終規則「スワップ・ディーラーおよび主要スワップ参加者に係る、コンファメーション、ポートフォリオ照合、ポートフォリオ・コンプレッションおよびスワップ取引関係ドキュメンテーションの必要要件」(77 Fed. Reg. 55904、2012年9月11日)、(ii)CFTC、最終規則、「スワップ清算集中義務のエンドユーザーの適用除外」(77 Fed. Reg. 42559、2012年7月19日)、(iii)CFTC、最終規則「商品取引所法第2条(h)に基づく清算集中義務の決定」(77 Fed. Reg. 74284、2012年12月13日)。

「**主要条件**」 (**Material Terms**) とは、CFTCがCFTC規則23.502との関係で定義した意味を有するものとする。

「**月次**」 (**Monthly**) とは、各暦月に1回の頻度を意味する。

「**通知手続**」 (**Notice Procedures**) とは、(i)当事者への通知または情報の送付に関して本件契約に定められる手続、(ii)当事者間で随時書面にて合意されるその他の手続、および(iii)当事者および特定の情報または通知の種類に関して、他方当事者がその他の認められた手続を指定した場合は、当該手続を意味する。

「**当事者**」 (**Party**) とは、対象契約の当事者を意味する。

「**ポートフォリオ・データ**」 (**Portfolio Data**) とは、当該データを提供するまたは提供せねばならない当事者に関し、照合可能な様式および雛型で記録された両当事者間のすべての残存するスワップの条件に関連する情報(疑義を避けるために付言すると、計算または計算方法を含む必要はない)を意味し、各当事者が合理的と考える範囲および水準の詳細を有し、当該当事者がこれらのスワップごとに算出するその時点の評価を記載しかつこれを含むが、これに限らない。当事者がデータ送付日に提供するポートフォリオ・データを構成する情報は、(i)適用される共通営業日の直前に当事者がスワップの取引終了時点の時価評価を算出する時点(この目的のために当該当事者は書面で指定する)において、かつ、(ii)評価の場合には、商業的に合理的な結果を導くために誠実かつ商業的に合理的な手続を用いて、準備されなければならない。

「**四半期ごと**」 (**Quarterly**) とは、3暦月に1回の頻度を意味する。

「再計算日」(Recalculation Date)とは、関連する紛争の原因となるリスク評価が算出されたリスク評価日を意味する。但し、かかる紛争が解決される前に、1つまたは複数のリスク評価日が発生した場合、当該紛争に関する「再計算日」は最後のかかるリスク評価日を意味する。

「参照マーケット・メイカー」(Reference Market-makers)とは、(i)リスク評価代理人が与信の提供または追加を決定する際に一般に適用する基準を満たす最上位の信用力を有するディーラーの中から、かつ(ii)現実的に可能な限り同じ都市に営業所を有するかかるディーラーの中から、リスク評価代理人が誠実に選択した関連する市場における主要な4社のディーラーを意味する。

「リスク・エクスポージャー」(Risk Exposure)とは、あるスワップおよびリスク評価日に関して、紛争の場合には本2013年3月DF追加条項のスケジュール3第2部の適用を受け、当該スワップ(その他のスワップを含まない)が当該リスク評価日に終了した場合に、一括清算条項に基づきリスク評価時点において(もしあれば)、カウンターパーティーがリスク評価代理人に支払うべき金額(プラスの数字で表記)またはリスク評価代理人がカウンターパーティーに支払うべき金額(マイナスの数字で表記)を意味する。但し、(i)いずれの当事者が事由発生当事者または期限の利益喪失当事者であるかによって本件契約が異なる計算方法を規定する場合、かかる計算は再構築取引に対して支払われる金額を算出する際の市場仲値の推計を用いて決定され、また、(ii)かかる計算には弁護士費用および現金払いの経費は含まれない。

「リスク評価」(Risk Valuation)とは、あるスワップおよびリスク評価日に関して、(i)リスク評価代理人またはその代理が決定するCSA評価が存在する場合には、かかるCSA評価を、また、(ii)リスク評価代理人またはその代理が決定するCSA評価が存在しない場合には、当該スワップおよびリスク評価日に関してリスク評価代理人またはその代理が決定するリスク・エクスポージャーを意味する。但し、本2013年3月DF追加条項第3.1条に従い、当該スワップおよびリスク評価日に関してカウンターパーティーが提供するCSA評価を用いることをリスク評価代理人が選択した場合には、カウンターパーティーが提供したかかるCSA評価を意味する。

「リスク評価代理人」(Risk Valuation Agent)とは、いずれかのリスク評価日およびスワップに関して、(i)一方当事者のみがCFTCスワップ組織である場合には、かかる当事者を、(ii)両当事者がCFTCスワップ組織であり、両当事者が当該スワップに関連する信用補完契約を締結していない場合には、両当事者がその日に関するリスク評価代理人として書面で合意した当事者を(但し、その日が一方当事者にとってのみの現地営業日

である場合には、当該当事者をその日に関するリスク評価代理人とする)、(iii)両当事者がCFTCスワップ組織であり、両当事者が当該スワップに関連する1つまたは複数の信用補完契約を締結している場合には、かかる信用補完契約に基づきその日にクレジット・サポート・コールを行なう資格を有する当事者を意味する。但し、(a)その日に双方のCFTCスワップ組織がクレジット・サポート・コールを行なう資格を有するときは、一方のCFTCスワップ組織のみが当該コールを行なう資格を有していた直近のリスク評価日にかかる信用補完契約に基づきクレジット・サポート・コールを行なう資格を有していた当事者をリスク評価代理人とし、(b)いずれのCFTCスワップ組織もクレジット・サポート・コールを行なう資格を有していない日において、その日が一方当事者にとってのみの現地営業日である場合には、その当事者をリスク評価代理人とし、それ以外の場合には、一方のCFTCスワップ組織のみが当該コールを行なう資格を有していた直近のリスク評価日にかかる信用補完契約に基づきクレジット・サポート・コールを行なう資格を有していた当事者をリスク評価代理人とする。

「リスク評価日」 (**Risk Valuation Date**) とは、あるスワップに関して、CFTCスワップ組織であるいずれかの当事者にとっての各現地営業日を意味する。

「リスク評価時点」 (**Risk Valuation Time**) とは、あるスワップおよびいずれかの日に関して、リスク評価代理人がカウンターパーティー宛のリスク評価の通知に記載した都市に関する直前の現地営業日の取引終了時点の意味する。

「SDR」 (**SDR**) とは、商品取引所法第1条a(48)およびCFTC規則に定義される「スワップ・データ蓄積機関」を意味する。

「SDRデータ」 (**SDR Data**) とは、SDRから入手される主要条件のデータを意味する。

「証券取引法」 (**SEA**) とは、改正を含む1934年証券取引法を意味する。

「SEC」 (**SEC**) とは、米国証券取引委員会を意味する。

「有価証券関連スワップ・ディーラー」 (**Security-Based Swap Dealer**) とは、証券取引法第3条(a)(71)およびこれに基づく規則3a71-1に定義される「有価証券関連スワップ・ディーラー」を意味する。

「スワップ」 (**Swap**) とは、商品取引所法第1条a(47)およびこれに基づく規則に定義され、本件契約によって規律されまたは規律されることになる「スワップ」を意味する。

但し、本2013年3月DF追加条項において、コモディティ・オプションはスワップとはされない。また、「スワップ」という用語には、米国財務長官が商品取引所法第1条a(47)(E)に基づく権限により「スワップ」としての規制から除外した本件契約によって規律されまたは規律されることになる外国為替スワップおよび外国為替フォワードが含まれる。疑義を避けるために付言すると、「スワップ」にはDCOにより清算されたスワップは含まれない。

「スワップ・ディーラー」 (**Swap Dealer**) とは、商品取引所法第1条a(49)およびこれに基づくCFTC規則1.3(ggg)に定義される「スワップ・ディーラー」を意味する。

「第三者サブアカウント」 (**Third-Party Subaccount**) とは、(1)実質的な所有者またはスポンサーから独立した無関係の立場であり、(2)口座の実質的な所有者がスワップを清算する際に必要なドキュメンテーション作成の責任を有する運用会社が管理する口座を意味する。

「取引事由」 (**Transaction Event**) とは、スワップの権利もしくは義務の締結、終了、譲渡、ノベーション、交換、移転、修正、移譲、または消滅を含み、両当事者間で新たなスワップを生じさせる、または両当事者間のスワップの取引条件を変更させる結果となる事由を意味する。

「評価」 (**Valuation**) とは、CFTC規則23.500に定められる意味を有する。

「週次」 (**Weekly**) とは、1暦週に1回の頻度を意味する。

2013年3月DFスケジュール2

一般条件

本2013年3月DFスケジュール2は、CFTCスワップ組織および別のCFTCスワップ組織を含むその他の当事者の契約において組み入れることができる。

本2013年3月DFスケジュール2が契約に組み入れられ、かつ当該契約に定められた組み入れるための条件が満たされたことを当該契約の両当事者が明記した場合、当該契約において本2013年3月DFスケジュール2が完全に組み入れられたものとして、本2013年3月DFスケジュール2はかかる契約の一部を構成するものとみなす。

第1部 一般的表明および合意

2.1. 各当事者は、他方当事者に対し、各取引事由の日において、(i)当該当事者が自らまたは代理により他方当事者に提供したすべての2013年3月DF追加条項情報（表明を除く）はあらゆる重要な点において真正、正確、および完全であること、および(ii)2013年3月DF追加条項情報または本2013年3月DF追加条項においてなされた表明はいかなる重要な点においても不正確または誤解を生じさせるものではないことを表明する（かかる表明は取引事由が発生する度に繰り返されたものとみなす）。2013年3月DF追加条項情報は、参照することによりここに組み入れられる⁵。

2.2. 各当事者は、他方当事者が1つまたは複数の2013年3月DFスケジュールを本件契約に組み入れることに合意したこと、および、両当事者がかかる組み入れた日またはそれ以降の日にスワップを締結した場合、他方当事者が2013年3月DF追加条項情報ならびに当該当事者またはその代理によって2013年3月DF追加条項情報および2013年3月DF追加条項において提供された表明に依存してスワップを締結することを認める。上記にかかわらず、各当事者は、スワップの取消しその他の方法により終了させる根拠を当事者に与えるデフォルト事由、終了事由、またはその他の類似する事由が、(i)2013年3月DF追加条項情報もしくは本2013年3月DF追加条項においてのみなされた表明が重要な点において不正確であるまたは誤解を生じさせるという理由、または(ii)本2013年3月DF追加条項においてのみ定められる誓約もしくは合意の違反という理由のみによって、本件契約または当事者間のその他の契約において発生しないことに合意する。但し、本第2.2条のいかなる定めも、法律または本件契約もしくはその他の契約に基づく当事者の表明または違反に関するその他の権利または救済手段を損なうものではないとする。疑義を避けるために付言すると、本第2.2条は、上記(i)もしくは(ii)で定める事由を生じさせ得るまたは構成し得る事由または条件に関連する違反を含め、2013年3月DF追加条項情報

⁵ CFTC 規則 23.402(d)および 23.504(b)(5)。

または本2013年3月DF追加条項においてのみ提供または規定されているものではない表明、保証、誓約、または合意の違反に適用される当事者の権利または救済手段（もしあれば）は、これを変更しないものとする。

2.3. 各当事者は、(i)以前に当該当事者が自らまたは代理により提供した2013年3月DF追加条項情報（表明を除く）に対する重要な変更と、(ii)2013年3月DF追加条項情報または本2013年3月DF追加条項において当該当事者が自らまたは代理により提供した表明が重要な点において不正確であるまたは誤解を生じさせることになるか否かを、通知手続に従い、他方当事者に書面にて速やかに通知することに合意する。1つまたは複数の2013年3月DFスケジュールにおいてなされた重要な点において不正確または誤解を生じさせる何らかの表明が、最後に表明が繰り返された日以降の日に繰り返された場合、当該表明は、通知する当事者が通知手続に従い他方当事者に通知することにより、適時に修正されるものとする⁶。

第2部 コンファメーション

2.4. 両当事者が書面にて別段の合意をしていない限り、本件契約に基づくスワップまたは別の種類の取引のコンファメーションは、各当事者が書面にて取引条件を送付することにより作成できることに、各当事者は合意する。但し、(i)各当事者が交付した取引条件は他方当事者が送付した取引条件と合致すること、および(ii)取引条件は、各当事者がかかる取引条件を確認することが可能な方法にて各当事者から他方当事者に送付されるか、または両当事者に対してかかる取引条件の合致を確認する第三者の代理人もしくはサービス・プロバイダーに各当事者から送付されることを条件とする（いずれの場合もテレックス、電子メッセージシステム、電子メール、その他の手段による）。いずれの場合も、かかるコンファメーションはいかなる目的においても本件契約の拘束力を有する補完文書として十分である。上記は、拘束力を有するコンファメーションを作成するためのその他の合意された方法を制限せず、かつ、取引を確認するために本段落に記載された方法を用いる合意として解釈されないものとする⁷。

第3部 清算集中

2.5. 各当事者は、ここに、DCOがスワップを引き受けた時点で以下の事実を通知される。

- a. CFTCスワップ組織とカウンターパーティーの間の当初のスワップは消滅すること。
- b. CFTCスワップ組織とカウンターパーティーの間の当初のスワップは、DCOとの間の同方向および逆方向のスワップに置き換わること。
- c. スワップのすべての取引条件は、DCOの規則に基づき制定された清算対象のスワ

⁶ 同上。

⁷ CFTC 規則 23.501。

ップの商品条件と一致すること⁸。

2.6. 第2.8条に定める場合を除き、(i)CFTCが当初清算集中義務決定の対象とした種類のスワップを両当事者が締結した場合、かつ(ii)カテゴリー1組織とカテゴリー1組織以外のカウンターパーティーとの間ではなく、カテゴリー1組織同士の間のかかる種類のスワップに清算集中が義務付けられる期間に当該スワップが締結された場合、カウンターパーティーは、当該スワップの締結時に自らがカテゴリー1組織ではないことを表明したものとみなす。

2.7. 第2.8条に定める場合を除き、(i)CFTCが当初清算集中義務決定の対象とした種類のスワップを両当事者が締結した場合、かつ(ii)カテゴリー1組織とカテゴリー1組織またはカテゴリー2組織以外のカウンターパーティーとの間ではなく、カテゴリー1組織同士の間またはカテゴリー1組織とカテゴリー2組織の間のかかる種類のスワップに清算集中が義務付けられる期間に当該スワップが締結された場合、カウンターパーティーは当該スワップの締結時に自らがカテゴリー1組織でもカテゴリー2組織でもないことを表明したものとみなす。

2.8. カウンターパーティーは、スワップの締結に関連して、(i)自らがCFTCスワップ組織である場合、(ii)かかるスワップの締結前に(a)通知手続に従い自らがカテゴリー1組織もしくは(第2.7条の場合に限り)カテゴリー2組織であることをCFTCスワップ組織に書面にて通知した場合、もしくは(b)かかるスワップをDCOにて清算するようにCFTCスワップ組織に指示した場合、または(iii)自らがカテゴリー1組織もしくは(第2.7条の場合に限り)カテゴリー2組織であり得るにもかかわらず、かかる締結時に、商品取引所法第2条(h)(7)およびCFTC規則50.50または適用されるCFTCガイダンス(規則制定もしくはその他の方法による)に基づく適用除外規則に従ってスワップが清算集中義務の対象にならない場合、第2.6条または第2.7条に基づきカテゴリー1組織またはカテゴリー2組織としてのステータスに関する表明を行なったとはみなされない。

第4部 エンドユーザーの適用除外

2.9. カウンターパーティーは、商品取引所法第2条(h)に基づき清算集中義務の対象となるスワップを、商品取引所法第2条(h)(7)およびCFTC規則50.50に基づく適用除外規則に従って清算しないことを選択する場合、当該スワップの締結前にかかる選択をCFTCスワップ組織に書面にて通知するものとする。かかる通知は、複数のスワップを対象とする継続的な通知(2013年3月DF追加条項情報またはその他に指定される)または取引ご

⁸ CFTC 規則 23.504(b)(6)。

との通知であってもよい⁹。カウンターパーティーは、かかる通知を交付し、当該スワップを締結することにより、商品取引所法第2条(h)(7)およびCFTC規則50.50に基づく清算集中義務付けの適用除外を受ける資格を有すること、および以下を表明するとみなされる。

a. 当該スワップの締結の365日前までに、CFTC規則50.50(b)(1)(iii)に指定された情報をCFTC規則50.50(b)(2)に従って行なった年次の届出において報告したこと、かかる情報は重要な変更を反映する必要に応じて修正されてきたこと、かかる適用除外を申告したスワップが当該年次の届出に含まれていること、ならびに当該届出におけるこれらの情報はすべての重要な点において真正、正確および完全であること、または、

b.

(1)上記第2.9条(a)に記載された年次の届出においてCFTC規則50.50(b)(1)(iii)に指定された情報を報告していないことを、当該スワップの締結前に通知手続に従いCFTCスワップ組織に書面にて通知したこと、

(2)CFTC規則50.50(b)(1)(iii)に指定されたすべての情報をCFTCスワップ組織に提供し、かつ、かかる情報はすべての重要な点において真正、正確および完全であり、また、かかる適用除外を申告したスワップが含まれていること、

(3) (A)商品取引所法第2条(h)(7)(C)(ii)、(h)(7)(C)(iii)、もしくは(h)(7)(D)または関連するCFTC規則において定める適用除外または例外規定にかかわらず、商品取引所法第2条(h)(7)(C)(i)に定められる「金融組織」ではないこと、(B)小規模銀行として商品取引所法第2条(h)(7)(C)(ii)およびCFTC規則50.50(d)における「金融組織」の定義の適用除外を受ける資格を有すること、(C)商品取引所法第2条(h)(7)(C)(iii)に従い「金融組織」の定義から除外されること、または(D)商品取引所法第2条(h)(7)(D)に従い清算集中義務の適用除外を受ける資格を有すること、

(4)CFTC規則50.50(c)の定めに従い当該スワップを経済的リスクのヘッジまたは軽減目的で用いていること、および

(5)清算対象外のスワップの締結に伴う金融関連の義務を一般に履行すること¹⁰。

2.10. (i)CFTCスワップ組織およびカウンターパーティーが、商品取引所法第2条(h)に基づく清算集中義務決定の対象であり、カウンターパーティーが商品取引所法第2条(h)(7)およびCFTC規則50.50に定められる清算集中義務の適用除外規定に従い清算しないことを選択したスワップを締結し、かつ(ii)カウンターパーティーが上記第2.9条(1)および(2)に定められる条件を満たした場合、スワップがCFTCまたはSDRへの報告義務の対象

⁹ CFTC 規則 23.505(a)(2)。

¹⁰ CFTC 規則 50.50 および 23.505(a)。

であり、かつCFTCスワップ組織がCFTC規則45.8に定める「報告カウンターパーティー」である場合には、CFTCスワップ組織は、CFTC規則50.50(b)(1)(iii)に指定された情報を関係するSDRに報告するものとする¹¹。

2.11. 本件契約または両当事者間の非開示、守秘もしくは類似の契約において矛盾する定めがあるかにかかわらず、カウンターパーティーが特定のスワップに関して商品取引所法第2条(h)(7)(A)およびCFTC規則50.50に基づくスワップ清算集中義務付けの適用除外を選択した場合、各当事者は、ここに、2013年3月DF追加条項規則が要求する範囲において当該選択に係る情報を開示することに同意する。各当事者は、本第2.11条に基づきなされる開示には、当事者の身元（名称、識別番号などに基づく）を含む取引情報のSDRおよび関連する規制当局に対する開示を含むがこれに限らないことを認める。さらに、規制上の報告義務に従うため、SDRが、1つまたは複数の規制当局が規制する国際的な取引情報蓄積機関のサービスに、かかる規制された国際的な取引情報蓄積機関がCFTCに登録されたSDRと同等の守秘義務条項の対象となっていることを条件に、従事できることを認める。疑義を避けるために付言すると、適用ある非開示、守秘、銀行秘密保護、またはその他の法律が、スワップおよび2013年3月DF追加条項規則により開示が必要とされる類似情報の非開示を要求するものの、当事者の同意によりかかる要求の放棄を認めるときはその範囲において、本項に定める同意および確認は、それらのその他適用ある法律との関係で、各当事者による同意となるものとする。

第5部 秩序ある清算の権限

2.12. 適用STRD遵守日以降に、各当事者は通知手続に従い、預金保険対象機関または金融会社に該当するか否か、または該当しなくなったか否かを他方当事者に通知することに合意する¹²。

2.13. 各当事者は、当事者が(i)対象金融会社または(ii)FDICが財産保全管理人として任命された預金保険対象機関である場合（以下、「対象当事者」という。）には、ここに、以下の事実を通知される。

a. 両当事者の合意にもかかわらず、ドッド・フランク法タイトルIIまたはFDIAに基づく一定の制約が、FDICが財産保全管理人として任命されたという理由により、非対象当事者がいずれかのスワップを終了、清算、またはネットィングする権利に適用される可能性があること。

b. FDICは、合衆国法典第12編第5390条(c)(9)(A)または合衆国法典第12編第1821条(e)(9)(A)ドッド・フランク法第210条(c)(9)(A)に基づき、対象当事者のスワップを移転す

¹¹ CFTC 規則 50.50。

¹² CFTC 規則 23.504(b)(5)(iv)。

る一定の権利を有する可能性があること¹³。

¹³ CFTC 規則 23.504(b)(5)(iii)。

2013年3月DFスケジュール3 リスク評価の計算および紛争解決

本2013年3月DFスケジュール3は、CFTCスワップ組織および別のCFTCスワップ組織を含むその他の当事者の契約において組み入れることができる。

本2013年3月DFスケジュール3が契約に組み入れられ、かつ当該契約に定められた組み入れるための条件が満たされたことを当該契約の両当事者が明記した場合、当該契約において本2013年3月DFスケジュール3が完全に組み入れられたものとして、本2013年3月DFスケジュール3はかかる契約の一部を構成するものとみなす。

第1部 商品取引所法第4部s(j)との関係におけるリスク評価の計算¹⁴

各当事者は以下に合意する。

3.1. 適用STRD遵守日後に取引事由が発生した各スワップに関するリスク評価代理人（またはその代理）は、各リスク評価日に、当該スワップのリスク評価を計算する。但し、カウンターパーティーが、リスク評価代理人が商品取引所法第4条s(j)に関連するCFTC規則23.504(b)の要求を満たすことができると誠実に判断したCSA評価手順に従い、当該スワップおよび当該リスク評価日に関するCSA評価をリスク評価代理人に提供した場合には、リスク評価代理人は、かかるCSA評価を当該スワップのリスク評価として取り扱うことを選択できる。

3.2. リスク評価代理人（またはその代理）は、リスク評価日後の共通営業日またはそれ以前の日、通知手続に従ってカウンターパーティーから書面による要求の送付を受けた場合、本2013年3月DFスケジュール3第3.1条に従い、当該リスク評価日に関して決定したリスク評価をカウンターパーティーに通知する。両当事者が別段の合意をしていない限り、リスク評価代理人は、スワップを評価するために用いる可能性のある評価モデルに関するいかなる守秘、専有情報も、カウンターパーティーに開示する義務を負わない。

3.3. リスク評価は、両当事者が信頼できると合意した、(i)通知手続に従ったリスク評価代理人からカウンターパーティーへの書面による通知、(ii)両当事者が合意したCSA評価の送付のための手段、または(iii)通知手続に従いカウンターパーティーに交付された書面による通知に指定されたURLまたはそれを通じてアクセス可能な安全なウェブ・ページへの掲示、のいずれかの方法によって通知することができる。

¹⁴ CFTC 規則 23.504(b)(4)(i)および(ii)。

3.4. 各リスク評価は、商業的に合理的な結果を導くために誠実かつ商業的に合理的な手続を用いて行われるリスク評価代理人（またはその代理）により決定される。

第2部 商品取引所法第4部s(j)との関係におけるリスク評価の紛争解決¹⁵

各当事者は以下に合意する。

3.5. カウンターパーティーは、リスク評価代理人によるリスク評価の計算に異議を申し立てたい場合、当該リスク評価の通知を受けた日の翌共通営業日の取引終了時点以前に、通知手続に従いリスク評価代理人に書面にて通知するものとする。かかる通知には、リスク評価代理人がリスク評価をカウンターパーティーに交付した関連する日時点におけるカウンターパーティーによるすべてのスワップのリスク評価の計算が含まれるものとする。カウンターパーティーは、商業的に合理的な結果を導くために誠実かつ商業的に合理的な手続を用いて計算しなければならない。

3.6. カウンターパーティーがリスク評価代理人によるリスク評価の計算に異議を申し立て、両当事者が書面にて（本件契約の一部を構成するか否かを問わない）CSA評価の決定に用いられる評価の紛争解決手順に合意した場合、当該リスク評価の紛争の解決には、当該手順が適用される（当該リスク評価の紛争がCSA評価の紛争であり、紛争の対象となる各スワップについてのみCSA評価について異議が申し立てられ、かつカウンターパーティーが紛争申立当事者であると仮定されるものとする）。

3.7. カウンターパーティーがリスク評価代理人によるリスク評価の計算に異議を申し立て、両当事者が書面にて（本件契約の一部を構成するか否かを問わない）CSA評価の決定に用いられる評価の紛争解決手順に合意していない場合、当該リスク評価に関して以下の手順が適用される。

a. 両当事者は紛争を解決するために互いに協議する。

b. 両当事者が適時に紛争を解決できない場合、リスク評価代理人は、参照マーケット・メイカーに4つの現実の仲値のクォーターションを求め、取得したクォーターションを算術平均することにより、再計算日時点のリスク評価を再計算する。但し、4つのクォーターションが取得できない場合は、4未満のクォーターションを用いることが可能であり、クォーターションが1つも取得できない場合は、リスク評価代理人による当初のリスク評価が用いられる。

3.8. 本2013年3月DFスケジュール3第3.7条に基づく再計算に伴い、リスク評価代理人は、リスク評価代理人にとっての当該再計算の日の次の現地営業日の取引終了時より前に、当該再計算結果をカウンターパーティーに通知し、当該再計算を、適用あるリスク評価

¹⁵ CFTC 規則 23.504(b)(4)(ii)。

日におけるリスク評価とするものとする。

第3部 その他の評価との関係

3.9. 両当事者は、ここに定めるリスク評価の算出および紛争に関する手順は、商品取引所法第4条s(j)におけるリスク管理の要求をCFTCスワップ組織（両当事者がCFTCスワップ組織である場合には各当事者）が遵守するために、関連する各スワップの時価を決定する目的に限定して用いられることに合意し、これを確認する。カウンターパーティーは、リスク評価代理人が算出したリスク評価に異議を申し立てないとしても、その他の目的においてリスク評価の正確性を認めたことにはならない。

3.10. 本2013年3月DFスケジュール3第2部に記載される手順を用いた紛争中のリスク評価の解決は、商品取引所法第4条s(j)におけるリスク管理の要求をCFTCスワップ組織が遵守する以外の目的においては、いずれの当事者も拘束しない。本2013年3月DF追加条項に定めるリスク評価の計算または当該リスク評価に関する時価評価に異議を申し立てる権利は、CSA評価の計算またはCSA評価に関する紛争に関する両当事者のいかなる合意にも影響せず、また、CSA評価に異議を申し立てる権利の放棄を構成しないことに、各当事者は合意する。CSA評価に関する紛争の解決は、リスク評価に関する紛争の解決と異なり得る。両当事者は、商品取引所法第4条s(e)に基づくマージン規制の適用により、当該規制およびCFTCスワップ組織による商品取引所法第4条s(j)におけるリスク管理の要求を遵守する関係で、両当事者間でスワップの時価評価の計算に関する追加の合意が必要になる可能性があり、また、両当事者による本2013年3月DFスケジュール3を組み入れる合意は、いかなる意味においてもマージンの時価評価の計算またはその紛争の解決に関してここに定める手順を適用する合意を構成しないことを認める。

3.11. 本2013年3月DF追加条項における他の定めにかかわらず、両当事者は、(i)リスク評価の計算および／または(ii)両当事者間の紛争解決のためのその他の手続について、いずれの場合も本2013年3月DF追加条項に定める手続に対する追加であるか代替であるかを問わず、誠実に合意することができる。

2013年3月DFスケジュール4

ポートフォリオ照合¹⁶

本2013年3月DFスケジュール4は、CFTCスワップ組織および別のCFTCスワップ組織を含むその他の当事者の契約において組み入れることができる。

本2013年3月DFスケジュール4が契約に組み入れられ、かつ当該契約に定められた組み入れるための条件が満たされたことを当該契約の両当事者が明記した場合、当該契約において本2013年3月DFスケジュール4が完全に組み入れられたものとして、本2013年3月DFスケジュール4はかかる契約の一部を構成するものとみなす。

第1部 照合要請日

4.1. 適用ポートフォリオ照合遵守日以降随時、CFTCスワップ組織は、カウンターパーティーに通知（以下、「照合要請日通知」という。）を交付し、当該CFTCスワップ組織によるポートフォリオ照合の実行頻度に関する2013年3月DF追加条項規則を遵守するために（当該CFTCスワップ組織の誠実な考えとして）両当事者がデータ照合を実行することが必要であると表明することができる。照合要請日通知には、(i)CFTCスワップ組織が必要であると考えるポートフォリオ照合の頻度（「日次」、「週次」、「四半期ごと」、「年次」、または2013年3月DF追加条項規則が要求するその他の頻度とすることができる）、および(ii)第4.2条が適用される場合には1つまたは複数のデータ送付日が、記載される。

第2部 一方当事者によるポートフォリオ・データの送付

4.2. (i)一方の当事者がCFTCスワップ組織ではなく、かつ(ii) CFTCスワップ組織が各データ送付日にポートフォリオ・データをカウンターパーティーに送付し、カウンターパーティーがかかるデータを確認することに両当事者が書面にて合意した場合、第4.5条には服しつつ、以下が適用される。

a. 照合要請日通知には、1つまたは複数のデータ送付日を記載すること。但し、初回のデータ送付日は当該通知がカウンターパーティーに交付された日から2共通営業日目の日より前に到来してはならないものとし、また、初回のデータ送付日より前に、カウンターパーティーが1つまたは複数の異なるデータ送付日を要求した場合、両当事者は関係するデータ送付日に合意するものとする。

b. 各データ送付日に、CFTCスワップ組織（またはその代理）は、ポートフォリオ・データをカウンターパーティー（またはその代理）に検証目的において提供すること。本第4.2条との関係において、ポートフォリオ・データは、(i)通知手続に従い提供され

¹⁶ CFTC 規則 23.502(b)。

た場合、または(ii)CFTCスワップ組織とカウンターパーティーがかかる目的で合意した第三者サービス・プロバイダーに提供された場合に、カウンターパーティーに提供されたものとみなされる（かつ、カウンターパーティーは、ポートフォリオ・データを受領したものとみなされる）。

c. 各データ送付日またはそれ以降合理的に実行可能な限り速やかに、かつ、データ送付日のカウンターパーティーにとっての2現地営業日後の日の取引終了時よりも前に、カウンターパーティーは、CFTCスワップ組織が送付した関連する各スワップに関するポートフォリオ・データを自らの帳簿および記録ならびに各スワップの評価に照らして確認し、関連するポートフォリオ・データを追認するか否か、または不整合を特定したか否かをCFTCスワップ組織に通知すること。カウンターパーティーは、提供されたポートフォリオ・データに関して特定されたすべての不整合をCFTCスワップ組織に通知するものとする。

d. カウンターパーティーがポートフォリオ・データにおける主要条件または評価に関する何らかの不整合をCFTCスワップ組織に通知した場合、各当事者はすべてのこれらの不整合を適時に解決する目的で互いに協議することに合意すること。

第3部 ポートフォリオ・データの交換

4.3. (i)両当事者がCFTCスワップ組織であるか、または(ii) CFTCスワップ組織およびカウンターパーティーが各データ送付日にポートフォリオ・データを互いに送付することに両当事者が書面にて合意した場合、第4.5条には服しつつ、いずれの場合においても、以下が適用される。

a.両当事者は、照合要請日通知に記載されたポートフォリオ照合の頻度に叶う1つまたは複数のデータ送付日に合意するため、誠実に交渉すること。但し、日次の照合が必要であると照合要請日通知に記載されている場合は、各共通営業日がデータ送付日を構成するものとする。

b. 各当事者（またはその代理）は、各データ送付日に、ポートフォリオ・データを他方当事者に提供すること。本第4.3条との関係において、ポートフォリオ・データは、(i)通知手続に従って提供された場合、または(ii)CFTCスワップ組織とカウンターパーティーがかかる目的で合意した第三者サービス・プロバイダーに提供された場合に、他方当事者に提供されたものとみなされる（かつ、他方当事者はかかるポートフォリオ・データを受領したものとみなされる）。

c. 各当事者がポートフォリオ・データを提供した各データ送付日またはそれ以降合理的に実行可能な限り速やかに、いずれの当事者も当該ポートフォリオ・データに関するデータ照合を実行できること。

d. (i)一方の当事者がCFTCスワップ組織ではなく、かつ、(ii)いずれかの当事者がポートフォリオ・データにおけるスワップの主要条件またはその評価に関する不整合を他方

当事者に通知した場合、各当事者はかかる不整合を適時に解決する目的で互いに協議することに合意すること。

e. (i)両当事者がCFTCスワップ組織であり、かつ、(ii)いずれかの当事者がポートフォリオ・データにおけるスワップの主要条件に関する不整合を他方当事者に通知した場合、各当事者はかかる不整合を即座に解決する目的で互いに協議することに合意すること。

f. (i)両当事者がCFTCスワップ組織であり、かつ、(ii)いずれかの当事者がポートフォリオ・データにおける評価に関する不整合を他方当事者に通知した場合、各当事者はかかる評価の不整合を可能な限り速やかに、但しいかなる場合でも5共通営業日以内に、解決する目的で互いに協議することに合意すること。

第4部 不整合極度額未満の評価の差額

4.4. 両当事者はここに、不整合極度額未満のスワップに関する評価の差額はCFTC規則23.502との関係において「不整合」とみなされないものとし、いずれの当事者も、本2013年3月DFスケジュール4に基づき、かかる差額についての他方当事者への通知や、かかる差額を解決するための他方当事者との協議を要求されないものとするに合意する。

第5部 SDRデータとの照合

4.5. CFTC規則23.502の要求を満たすために両当事者間のスワップに関する自らの帳簿および記録をSDRデータと照合することに両当事者が書面にて合意した場合、以下が適用される。

a. データ交換日またはそれ以降合理的に実行可能な限り速やかに、各当事者は、SDRデータに照らして、ポートフォリオ・データとして他方当事者から提供されたであろう主要条件に当該SDRデータが関連する範囲において、データ照合を実行するものとする。いずれかの当事者が当該SDRデータに対するアクセスを持たない場合、または、かかる当事者が、第4.2条または第4.3条に記載された適用ある期間において適時のデータ照合の実行を可能とする方法で当該データを関連するSDRから取得することが技術的もしくは事務的に現実的でないと判断する場合、かかる当事者は、関係するデータ交換日までにまたはそれ以降合理的に実行可能な限り速やかに、他方当事者に通知するものとする。

b. 第4.2条および第4.3条の定めにかかわらず、いずれの当事者も、ポートフォリオ・データがSDRに報告された主要条件のデータから構成されている場合、データ送付日に当該ポートフォリオ・データを他方当事者に提供する義務を負わないものとする。但し、一方の当事者が、第4.5条(a)の記載通りに対応するSDRデータに照らして適時にデータ照合を実行できないと他方当事者に通知した場合、両当事者は、合理的に実行可能な限り速やかに、第4.2条(b)または第4.3条(b)の適用のある方の記載通りに、関係する

ポートフォリオ・データを提供するものとする。

c. いずれかの当事者がSDRデータにおいて不整合を特定した場合、かかる当事者は直ちに当該不整合を他方当事者に通知するものとする。各当事者は、当該不整合を即座に（両当事者がCFTCスワップ組織である場合）または適時に（一方の当事者がCFTCスワップ組織ではない場合）解決する目的で、他方当事者と協議することに合意する。

d. 各当事者は、合理的な要求を受けた場合、(i)かかる当事者が両当事者間のスワップに関する主要条件データを報告したSDR、および(ii)データがアクセスされる可能性のある特定のSDRに関する変更を、他方当事者に通知することに合意すること。

e. 当事者は、通知手続に従い、書面の通知により当該通知の有効日時点で本第4.5条を終了させることを他方当事者に伝えることにより、本第4.5条にはさらなる効力はなく、両当事者はそれぞれ本第4.5条に基づくすべての義務から解放および免責されるという趣旨にて、本第4.5条を終了させることが可能なこと。両当事者は、かかる通知の発効日は、通知手続に従い当該通知が交付された日の2共通営業日後の日であることに合意する。

第6部 その他のポートフォリオ照合手続

4.6. 両当事者が、照合要請日通知に記載された頻度で複数のデータ送付日に合意した場合、当該通知を交付したCFTCスワップ組織は、当該データ送付日が有効である期間内において、2013年3月DF追加条項規則に従い記載された頻度にてポートフォリオ照合を実行する必要があるかどうかをカウンターパーティーに通知しなければならない。かかる通知には、(i)CFTCスワップ組織が必要であると考えられるポートフォリオ照合の新たな頻度（「日次」、「週次」、「四半期ごと」、「年次」、または2013年3月DF追加条項規則が要求するその他の頻度とすることができる）、および(ii)第4.2条が適用される場合であれば、1つまたは複数の新たなデータ送付日が記載されるものとする。かかる通知が交付された時点で、以前に合意されたデータ送付日にポートフォリオ・データを提供する両当事者の義務は終了し、かかる通知が第4.2条および第4.3条に関する新たな照合要請日通知を構成するものとする。

4.7. 本2013年3月DF追加条項における他の定めにかかわらず、両当事者は、(i)ポートフォリオ・データの交換、提供、および／もしくは照合、ならびに／または(ii)両当事者間の不整合の解決に関するその他の手続に、いずれの場合も本2013年3月DF追加条項に定める手続に対する追加であるか代替であるかを問わず、誠実に合意することができる。本2013年3月DFスケジュール4のいかなる規定も、いずれかの当事者が適用ある法律、本2013年3月DFスケジュール4以外の本件契約の条件、またはその他の契約に基づき有する異議申立権または照合を要求する権利を損なわないものとする。