

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

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プロトコルに関する質問書¹

¹本 2013年3月 DFプロトコルに関する質問書は、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)
- (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)

2013年3月22日付

ISDA2013年3月DFプロトコルに関する質問書

説明: プロトコル契約に定める方法でプロトコル契約を批准したPCA本人またはPCA代理人は、既存のプロトコル対象契約を補完するために、および／またはISDA2013年3月DFプロトコル・マスター契約の様式による新たなプロトコル対象契約を締結するために、本質問書を完成および署名し、プロトコル契約に定められる方法によって交付することができます。

本質問書は、PCA本人が自らのためにこれを作成および交付すること、または、PCA代理人が1または複数のPCA本人の代理として作成および交付することができます。本質問書をプロトコル契約に定められる方法で他のPCA本人またはPCA代理人に交付することによって、交付者はかかるPCA本人またはPCA代理人とのプロトコル対象契約の締結および／または補完に合意することができます。既存のプロトコル対象契約が、当初、1または複数のPCA本人を代理してPCA代理人により締結された場合は、(PCA本人ではなく)当該PCA代理人のみが、当該プロトコル対象契約を補完するために本質問書およびプロトコル契約を使用できます。

PCA本人が自らのために本質問書を作成および交付する場合、(i)かかる当事者は自らがPCA本人であることをPCA本人回答表の列1に明示しなければならず、また、(ii)自らのために当該当事者によって締結された既存のプロトコル対象契約を補完するために、および／または自らのためにISDA2013年3月DFプロトコル・マスター契約を締結するためにのみ、本質問書は効力を有します。PCA代理人が1または複数のPCA本人の代理として本質問書を作成および交付する場合、(i)PCA代理人はPCA本人回答表の列1にそれぞれのPCA本人の名称を列挙しなければならず、(ii)列挙されたPCA本人の代理としてISDA2013年3月DFプロトコル・マスター契約を締結するために、および／または列挙されたPCA本人の代理としてPCA代理人によって締結されたプロトコル対象契約を補完するためにのみ、本質問書は効力を有します。疑義を避けるために付言すると、複数のPCA本人の代理としてPCA代理人が本質問書を作成している場合は、本質問書はPCA本人回答表の列1に列挙された各PCA本人に関する個別の質問書として取り扱われるものとします。

本質問書の第2部セクション6から8および第3部セクション5(b)に対する回答は、本質問書に直接記入でき、また、スペースが足りない場合は別紙に記載することも

できます。本質問書のその他のすべてのセクションに対する回答は、PCA 本人回答表に記入してください。

第 1 部: 定義

本質問書において、次の用語は以下に定められる意味を有する。

「商品取引所法」(CEA)とは、商品取引所法(改正を含む)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。

「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。

「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。

「DF スケジュール」(DF Schedule)とは、DF 追加条項のスケジュールを意味する。

「DF 追加条項」(DF Supplement)とは、国際スワップ・デリバティブズ協会によって 2013 年 3 月 22 日に公表された ISDA2013 年 3 月 DF 追加条項を意味する。

「既存スワップ契約」(Existing Swap Agreement)とは、あるスワップに関して、(i)当該スワップの締結時に存在し、(ii)両当事者の支払義務に関する条件をとくに規定し、かつ、(iii)書面による合意、口頭での合意、行動指針等をもってかかるスワップを規律する旨を両当事者が決定した、書面による契約を意味する。

「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。

「金融組織」(Financial Entity)とは、商品取引所法第 2 条(h)(7)(C)(ii)およびこれに基づく CFTC 規則または商品取引所法第 2 条(h)(7)(C)(iii)に定められる適用除外もしくは例外規定にかかわらず、商品取引所法第 2 条(h)(7)(C)(i)において定められる金融組織たる者を意味する²。

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

² 商品取引所法第 2 条(h)(7)(C)(i)では、(i)スワップ・ディーラー、(ii)有価証券関連スワップ・ディーラー、(iii)主要スワップ参加者、(iv)主要有価証券関連スワップ当事者、(v)商品ファンド、(vi)1940 年投資顧問法第 202 条(a)に定められる私募ファンド、(vii)1974 年従業員退職所得保障法セクション 3 の(3)および(32)に定められる従業員給付制度、および(viii)銀行業務または 1956 年銀行持株会社法第 4 条(k)に定められ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、清算集中義務との関係で、「金融組織」と定義している。

「LEI/CICI」(LEI/CICI)とは、CFTC規則45.6の要件を満たす「法主体識別番号」、または、かかる法主体識別番号が利用可能となるまで、CFTCにより提供されるその他の識別番号を意味する。

「PCA 代理人」(PCA Agent)とは、1または複数のPCA本人の代理としてプロトコル対象契約を締結した者を意味する。

「PCA 本人」(PCA Principal)とは、プロトコル対象契約に基づく1または複数のスワップの本人または本人となりうる当事者であり、かつ、PCA 本人回答表の列1においてPCA本人として明示されている者を意味する。

「PCA 本人回答表」(PCA Principal Answer Sheet)とは、本質問書のアネックスAの実質様式によるスプレッドシートを意味する。

「ポートフォリオ・データ」(Portfolio Data)とは、DF追加条項に定められる意味を有する。

「プロトコル契約」(Protocol Agreement)とは、国際スワップ・デリバティブズ協会によって2013年3月22日に公表されたISDA2013年3月DFプロトコル契約を意味する。

「プロトコル対象契約」(Protocol Covered Agreement)とは、(i) ISDA2013年3月DFプロトコル・マスター契約、または(ii)少なくとも一方がCFTCスワップ組織である二当事者の間の書面によるその他の契約で、(A)両当事者に適用ある実施日において存在し、(B)各当事者がそれぞれ本人として締結したまたは締結しうる1つまたは複数のスワップの取引の条件を規律するもの、を意味する。

「リスク評価」(Risk Valuations)とは、DF追加条項に定められる意味を有する。

「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。

「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る「スワップ」を意味する。但し、本質問書において、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で清算されたスワップは含まない。

本質問書で用いる定義されていない大文字で始まる用語は、プロトコル契約に定められる意味を有する。

第2部: PCA 本人情報および地位の表明

本質問書第2部は、各PCA本人またはその代理による回答が必要な質問によって構成されます。質問に対する回答は、別段の記載がない限り、PCA 本人回答表に記入してください。

1. LEI/CICI³

本質問に回答する際には、PCA 本人の LEI/CICI を、PCA 本人回答表の該当する行の列2 に記入してください。

PCA 本人の LEI/CICI は何ですか？

2. CFTC スワップ組織

「CFTC スワップ組織」という用語は、プロトコル契約において、スワップ・ディーラーまたは主要スワップ参加者として CFTC に登録されている、またはまもなく登録される予定の PCA 本人を表すために使用されています。DF 追加条項において、「CFTC スワップ組織」に適用される合意は、登録されたスワップ・ディーラーまたは主要スワップ参加者に対してのみ適用され、「カウンターパーティー」に適用される合意は、登録されたスワップ・ディーラーまたは主要スワップ参加者の取引相手である当事者に対してのみ適用されます。プロトコル契約では、PCA 本人が登録前でも CFTC スワップ組織として指定され得るようにし、さらに、登録完了時には関連の義務の効力を発生させられるように、DF 追加条項に基づく合致 PCA 本人の義務は、合致 PCA 本人のうち少なくとも一方がスワップ・ディーラーまたは主要スワップ参加者として CFTC に実際に登録されていることを前提条件とする旨を定めています。

質問書を作成する各当事者は、関係する PCA 本人が、プロトコル対象契約に適用される DF 追加条項との関係で、CFTC スワップ組織であるか否かを示す必要があります。本質問書における CFTC スワップ組織としての指定は、PCA 本人が、商品取引所法および適用ある CFTC 規則に定義される「スワップ・ディーラー」または「主要スワップ参加者」である旨、またはかかる当事者として登録されている旨の PCA 本人による表明となるわけではありません。但し、スワップ・ディーラーまたは主要スワップ参加者として登録することはないだろうと誠実に信じる当事者は、プロトコル対象契約に適用される DF 追加条項の条件との関係で、CFTC スワップ組織として指定されるべきではありません。DF 追加条項において、当初 CFTC スワップ組織ではない合致当事者は、スワップ・ディーラーまたは主要スワップ参加者として CFTC に登録された旨の書面による通知を取引相手に交付することによって、後にその地位を CFTC スワップ組織に変更することができます。

本質問に「はい」と回答する場合、プロトコル対象契約に適用される DF 追加条項においては、PCA 本人が CFTC スワップ組織であることを選択することになります。

³ CFTC 規則 45.6

本質問に回答する際には、PCA 本人回答表の該当する行の列 3 に、適宜「はい」または「いいえ」を記入してください。

PCA 本人は CFTC スワップ組織ですか？

3. 金融組織⁴

「金融組織」という用語は、CFTC 規則 23.501 に定めるコンファメーションの作成に関するさまざまな要件および期限を充足する「スワップ取引関係ドキュメンテーション」を作成すべき主体を決定する目的のほか、商品取引所法および CFTC 規則においてさまざまな目的で使用されています。よって、質問書を作成する各当事者は、自らが知る限りにおいて、関連の PCA 本人が金融組織であるか否かを示す必要があります。

本質問に回答する際には、PCA 本人回答表の該当する行の列 4 に、適宜「はい」または「いいえ」を記入してください。回答者は、ISDA2012 年 8 月 DF プロトコルの参加者はその関連の「質問書」においても、商品取引所法第 2 条(h)(7)(C)(i)および CFTC 規則に定義される「金融組織」であるか否かを示すよう求められたことに留意してください。ここで提供された情報は、以前の質問書において提供された情報（もしある場合）を更新するものとみなされます。

PCA 本人は、自らの知る限りにおいて、金融組織ですか？

4. 金融会社⁵

スワップ取引関係ドキュメンテーションには、CFTC 規則 23.504(b)(5)(i)-(ii)に従い、各当事者が金融会社であるか否かを示す記載が含まれている必要があります。本質問に回答することにより、「2013 年 3 月 DF 追加条項情報」として、かかる記載が PCA 本人の合致 PCA に組み入れられることとなります。

本質問に回答する際には、PCA 本人回答表の該当する行の列 5 に、適宜「はい」または「いいえ」を記入してください。

PCA 本人は金融会社ですか？

5. 預金保険対象機関⁶

スワップ取引関係ドキュメンテーションには、CFTC 規則 23.504(b)(5)(i)-(ii)に従い、各当事者が預金保険対象機関であるか否かを示す記載が含まれている必要があります。本質問に回答することによ

⁴ 例えば、CFTC 規則 23.501 および 23.504(b)(4)を参照。

⁵ CFTC 規則 23.504(b)(5)(i)-(ii)

⁶ CFTC 規則 23.504(b)(5)(i)-(ii)

り、「2013年3月DF追加条項情報」として、かかる記載がPCA本人の合致PCAに組み入れられることとなります。

本質問に回答する際には、PCA本人回答表の該当する行の列6に、適宜「はい」または「いいえ」を記入してください。

PCA本人は預金保険対象機関ですか?

6. 通知交付用の電子メールアドレス

PCA本人は、リスク評価またはポートフォリオ・データに関する通知以外の、DF追加条項に基づく通知の交付用の電子メールアドレスをここに指定することができます。

電子メール: _____

7. リスク評価交付用の電子メールアドレス

PCA本人は、DFスケジュール3に基づくリスク評価の交付用の電子メールアドレスをここに指定することができます。

電子メール: _____

8. ポートフォリオ・データ提供用の電子メールアドレス

PCA本人は、DFスケジュール4に基づくポートフォリオ・データの提供用の電子メールアドレスをここに指定することができます。

電子メール: _____

第3部: PCA本人の選択事項

本質問書第3部は、別段の記載がない限り、各PCA本人またはその代理による回答が必要な質問から構成されます。質問に対する回答は、別段の記載がない限り、PCA本人回答表に記入してください。

1. 現地営業日

2013年3月DF追加条項との関係において、当事者に関する「現地営業日」は、本質問書においてまたは当事者によって「2013年3月DF追加条項情報」として合意されたその他のドキュメンテーションにおいて、当該当事者が指定した都市に基づいて決定されます。本質問に回答することにより、PCA本人について、都市を指定することができます。

本質問に回答する際には、PCA 本人回答表の該当する行の列 7 に、関連する都市の名称を記入してください。

現地営業日の基準となる都市はどこですか？

2. 非金融組織のDFスケジュール 3 に関する選択事項⁷

DF スケジュール 3（リスク評価の計算および紛争解決）の締結に関する以下の選択は、(i)CFTC スワップ組織として指定されておらず、(ii) 金融組織でもない PCA 本人のすべて、またはその代理により、なされる必要があります。本質問書において PCA 本人が CFTC スワップ組織として指定されている場合または金融組織として明記された場合は、プロトコル契約に基づき DF スケジュール 3（リスク評価の計算および紛争解決）が自動的に選択されたものとみなされます。

DF スケジュール 3 は、CFTC 規則 23.504(b)(4)のドキュメンテーション要件に関する一連の合意を定めています。CFTC 規則 23.504(b)(4)において、これらの要件は、スワップ・ディーラー、主要スワップ参加者および金融組織間のすべてのスワップ取引関係ドキュメンテーションに適用されるものの、金融組織に該当しない市場参加者とのスワップ取引関係ドキュメンテーションについては必須ではないことが定められています。

本質問に「はい」と回答する場合または無回答の場合、DF スケジュール 3（リスク評価の計算および紛争解決）を組み入れることにより、合致PCAの条件が補完されることを選択することになります。本質問に「いいえ」と回答する場合、DF スケジュール 3 を組み入れないことを選択することになります。プロトコル参加者は、本質問に「いいえ」と回答する前に、関連のPCA本人が金融組織でないことを確認してください。

本質問に回答する際には、PCA 本人回答表の該当する行の列 8 に、適宜「はい」または「いいえ」を記入してください。

PCA 本人は DF スケジュール 3 に合意しますか？

3. DFスケジュール 4 に関する選択事項⁸

- (a) DF スケジュール 4（ポートフォリオ照合）の締結に関する以下の選択は、CFTC スワップ組織として指定されていないすべての PCA 本人、またはその代理によってなされる必要があります。本質問書において PCA 本人が CFTC スワップ組織として指定されている場合は、プロトコル契約に基づき DF スケジュール 4（ポートフォリオ照合）が自動的に選択されたものとみなされます。

⁷ CFTC 規則 23.504(b)(4)

⁸ CFTC 規則 23.502

本質問に「はい」と回答する場合または無回答の場合、DF スケジュール 4（ポートフォリオ照合）を組み入れることにより、合致 PCA の条件が補完されることを選択することになります。本質問に「いいえ」と回答する場合、DF スケジュール 4（ポートフォリオ照合）を組み入れないことを選択することになります。

本質問に回答する際には、PCA 本人回答表の該当する行の列 9 に、適宜「はい」または「いいえ」を記入してください。

PCA 本人はスケジュール 4 に合意しますか？

- (b) DF スケジュール 4 の第 2 部（一方当事者によるポートフォリオ・データの送付）または第 3 部（ポートフォリオ・データの交換）に従ってポートフォリオの照合を行なうか否かに関する以下の選択は、(i)本質問書において CFTC スワップ組織として指定されておらず、かつ、(ii)本質問書において DF スケジュール 4 を選択した、すべての PCA 本人またはその代理によってなされる必要があります。PCA 本人が本質問書において CFTC スワップ組織として指定されており、かつ、CFTC スワップ組織として指定された他の PCA 本人と合致の場合は、プロトコル契約に基づき DF スケジュール 4 の第 3 部は自動的に選択されたものとみなされます。

スワップ・ディーラーまたは主要スワップ参加者ではない当事者は、CFTC ガイダンスに基づき、スワップ・ディーラーもしくは主要スワップ参加者から受領したポートフォリオ・データを確認すること、またはスワップ・ディーラーもしくは主要スワップ参加者とポートフォリオ・データを交換することにより、ポートフォリオ照合を行なえます。

本質問に「確認する」と回答する場合または無回答の場合、DF スケジュール 4 の第 2 部（一方当事者によるポートフォリオ・データの送付）に従ってポートフォリオの照合を行なうことを選択することになります。本質問に「交換する」と回答する場合、DF スケジュール 4 の第 3 部（ポートフォリオ・データの交換）に従ってポートフォリオの照合を行なうことを選択することになります。

本質問に回答する際には、PCA 本人回答表の該当する行の列 10 に、適宜「確認する」または「交換する」を記入してください。

PCA 本人はポートフォリオ・データを確認することまたは交換することに合意しますか？

- (c) DF スケジュール 4 の第 5 部（SDR データとの照合）に従ってスワップの一定の条件を照合するか否かに関する以下の選択は、(i)本質問書において CFTC スワップ組織として指定されている、または(ii)本質問書

において DF スケジュール 4 を選択した、すべての PCA 本人またはその代理によってなされる必要があります。

ポートフォリオ照合を行なう PCA 本人は、他方当事者またはその代理からの関連情報を直接提供することを要求する代わりに、当事者から SDR に報告されたデータに照らしてスワップの関連条件を照合することを選択できます。

本質問に「はい」と回答する場合、DF スケジュール 4 の第 5 部 (SDR データとの照合) に従ってスワップの一定の条件を照合することを選択することになります。本質問に「いいえ」と回答する場合または無回答の場合、DF スケジュール 4 の第 5 部の条件に合意しないことを選択することになります。

本質問に回答する際には、PCA 本人回答表の該当する行の列 11 に、適宜「はい」または「いいえ」を記入してください。

PCA 本人は SDR データとの照合に合意しますか?

4. エンドユーザーの適用除外の利用⁹

- (a) 以下の質問は、エンドユーザーの適用除外（以下に定義される。）を利用しうるすべての PCA 本人またはその代理によって、回答することができます。

商品取引所法第 2 条 (h)(1)によれば、清算集中義務決定の対象となるスワップ取引を行なうことは、一定の例外を除き、スワップ取引が登録または免除されたデリバティブ清算機関での清算に付されない限り、違法であるとされています。商品取引所法第 2 条(h)(7)および CFTC 規則 50.50 は、一定の当事者が利用可能な、商品取引所法第 2 条(h)(1)に規定された清算集中義務に関する例外（以下、「エンドユーザーの適用除外」という。）を定めています。エンドユーザーの適用除外を利用するためには、当事者は、これを利用する旨を必ず選択する必要があります。本質問は、PCA 本人が後に（特定のスワップに関してまたは一般的に）これに反する内容を取引相手に通知しない限り、清算集中義務の対象となるスワップ取引について常にエンドユーザーの適用除外を利用する旨の継続的選択を、取引相手に通知するために使用できます。疑義を避けるために付言すると、本質問に対する当事者の回答は、個別の当事者の特定のスワップに関して、エンドユーザーの適用除外を利用する権利または利用しない権利を何ら害するものではありません。

合致 PCA における PCA 本人が締結した商品取引所法第 2 条(h)に基づく清算集中義務の対象となる各スワップについて、本質問に「はい」と回答することにより、かかるスワップの実行前にこれと反する内容

⁹ CFTC 規則 50.50.

を書面で通知した場合を除き、PCA 本人は、エンドユーザーの適用除外を選択（かかる選択を、「継続的エンドユーザーの適用除外選択」という。）する旨を、本質問の受領者に対し通知したことになります。本質問に「いいえ」と回答する場合または無回答の場合、かかる通知を行わないことを選択することになります（また、その他何らの効果も生じません）。

本質問に回答する際には、PCA 本人回答表の該当する行の列 12 に、適宜「はい」または「いいえ」を記入してください。

継続的エンドユーザーの適用除外選択をしますか？

- (b) 以下の質問は、エンドユーザーの適用除外を利用しうるすべての PCA 本人またはその代理によって、回答することができます。

CFTC 規則 50.50 によれば、スワップの当事者がエンドユーザーの適用除外を利用することを選択した場合には（以下、かかる当事者を「選択当事者」という。）、当事者のうちの 1 人が、登録 SDR に対して、または次のような情報を受領する登録 SDR が存在しない場合は CFTC に対して、CFTC 規則 50.50 に指定された情報を提供するか、または提供されるようにしなければなりません。選択当事者は、CFTC 規則 50.50(b)(2)に基づく年次の届出（以下、「年次届出」という。）によって本情報を登録 SDR または CFTC に直接提供すること、またはこのデータを取引ごとに報告（以下、「取引届出」という。）させるようにすることができます。

ISDA2013 年 3 月 DF 追加条項では、選択当事者は、年次届出を行ったこと、または取引相手に年次届出を行っていないことを通知して取引相手に取引届出を行うに必要な情報を提供したことのいずれかを、関係するスワップの実行時点において表明したものとみなされます。以下の質問は、PCA 本人が後に（特定のスワップに関してまたは一般的に）これと反する内容を取引相手に通知しない限り、PCA 本人が清算集中義務の対象であるスワップについて年次届出を行わない旨を取引相手に通知するために使用することができます（以下、かかる通知を「年次届出の継続的非適用」という）。

本質問に回答する際には、PCA 本人回答表の該当する行の列 13 に、適宜「はい」または「いいえ」を記入してください。

年次届出の継続的非適用を受けますか？

- (c) 以下の質問は、エンドユーザーの適用除外を利用しうるすべての PCA 本人またはその代理によって、回答することができます。

ISDA2013 年 3 月 DF 追加条項では、年次届出を行っていないことを取引相手に通知した選択当事者は、取引届出を行う際に必要な情報を、

取引相手に提供したことを表明することとされています。以下の質問は、PCA 本人がかかるとする情報を提供するために使用することができます。

- (i) 選択当事者が金融組織である場合、CFTC 規則 50.50 により、選択当事者が商品取引所法第 2 条(h)(7)(C)(iii)に基づく適用除外（以下、「金融関係会社の適用除外」という。）を選択するか否かを、取引届出に明記する必要があります。

本質問に回答する際には、PCA 本人回答表の該当する行の列 14 に、適宜「はい」または「いいえ」を記入してください。

PCA 本人は金融関係会社の適用除外を選択しますか？

- (ii) 選択当事者が金融組織である場合、CFTC 規則 50.50 により、選択当事者が商品取引所法第 2 条(h)(7)(D)に基づく例外（以下、「ヘッジ関係会社の適用除外」という。）を選択するか否かを、取引届出に明記する必要があります。

本質問に回答する際には、PCA 本人回答表の該当する行の列 15 に、適宜「はい」または「いいえ」を記入してください。

PCA 本人はヘッジ関係会社の適用除外を選択しますか？

- (iii) 選択当事者が金融組織である場合、CFTC 規則 50.50 により、選択当事者が商品取引所法第 2 条(h)(7)(C)(ii)および CFTC 規則 50.50(d)に基づくエンドユーザーの適用除外との関係で問題となる「金融組織」の制定法上の定義から免除された組織（以下、「小規模銀行の適用除外」という。）であるか否かを、取引届出に明記する必要があります。

本質問に回答する際には、PCA 本人回答表の該当する行の列 16 に、適宜「はい」または「いいえ」を記入してください。

PCA 本人は小規模銀行の適用除外に基づく免除を受けていますか？

- (iv) CFTC 規則 50.50 により、選択当事者は、清算対象とならないスワップに関連する金融関連義務を通常どのように履行するのかを、取引届出に明記する必要があります。

本質問に回答する際には、PCA 本人回答表の該当する行の列 17 に、1 つまたは複数の以下の項目のアルファベットを適宜記入してください。

PCA 本人は、清算対象外のスワップに関連する金融関連義務を通常どのように履行していますか？

- (A) 書面による信用補完契約
- (B) 担保付または分別資産（信用補完契約その他に基づくマージンの差入れまたは受入れを含む）
- (C) 書面による第三者保証
- (D) 自らの利用可能な財源
- (E) 上記(A)から(D)以外の手段

- (v) CFTC 規則 50.50 により、選択当事者は、1934 年証券取引法第 12 条における登録された有価証券の発行体であるか否か、または、同法第 15 条(d)において報告書の届出が必要とされている

か否かを（以下、「SEC 発行体／報告者」という。）、「取引届出に明記する必要があります。」

本質問に回答する際には、PCA 本人回答表の該当する行の列 18 に、適宜「はい」または「いいえ」を記入してください。

PCA 本人は SEC 発行体／報告者ですか？

- (vi) 選択当事者が SEC 発行体／報告者である場合、CFTC 規則 50.50 により、選択当事者の SEC 中央インデックス・キー番号を取引届出に明記する必要があります。

本質問に回答する際には、PCA 本人回答表の該当する業の列 19 に、PCA 本人の SEC 中央インデックス・キー番号を記入してください。

PCA 本人の SEC 中央インデックス・キー番号は何ですか？

- (vii) 選択当事者が SEC 発行体／報告者である場合、CFTC 規則 50.50 により、商品取引所法第 2 条(h)(1)および(h)(8)に定める要件が免除されるスワップを締結するという判断が、選択当事者の適切な取締役会（またはそれに相当する組織）により確認および承認（以下、「選択の承認」という。）されたか否かを、取引届出に明記する必要があります。

本質問の回答は、PCA 本人回答表の該当する行の列 20 に、適宜「はい」または「いいえ」を記入してください。

PCA 本人は選択の承認を受領していますか？

5. ISDA2013 年 3 月 DF プロトコル・マスター契約に関する選択事項および情報

- (a) CFTC スワップ組織は、CFTC 規則 23.504 において、取引相手とスワップを締結する前にまたは締結と同時に「スワップ取引関係ドキュメンテーション」を確実に作成するように、書面による方針および手続を備えておく必要があります。当事者がスワップごとにかかる書類を確実に用意できるように、プロトコル契約第 4 条は、各 PCA 本人が「ISDA2013 年 3 月 DF プロトコル・マスター契約」の締結を選択できるようにしています。ISDA2013 年 3 月 DF プロトコル・マスター契約は、同契約のスケジュールに基づき、(i)既存スワップ契約が適用されず、かつ、(ii)当事者がデリバティブ清算機関での清算を意図していないスワップに適用されます。

本質問に「はい」と回答する場合、PCA 本人は、本質問書が交付された各取引相手と、ISDA2013 年 3 月 DF プロトコル・マスター契約を締結することを合意したことになります。本質問に「いいえ」と回答す

る場合または無回答の場合、本質問書が交付された各取引相手との間にISDA2013年3月DFプロトコル・マスター契約を締結する合意を構成しません。

本質問の回答は、PCA 本人回答表の該当する行の列21に、適宜「はい」または「いいえ」を記入してください。

PCA 本人は、ISDA2013年3月DFプロトコル・マスター契約を締結することに合意しますか？

- (b) PCA 本人が上記の質問に「はい」と回答した場合、各 ISDA2013年3月DFプロトコル・マスター契約との関係において、当該 PCA 本人の通知先に関する情報は以下の通りです。

名称: _____

住所: _____

電話: _____

ファックス: _____

Eメール: _____

電子メッセージシステム: _____

特別な指示: _____

本質問書を作成することにより、署名者は、PCA 本人または特定の PCA 本人の PCA 代理人として、(a)本質問書で提供した一切の情報はあらゆる重要な点において本質問書の日の時点で真正、正確、および完全であり、本質問書が交付された各取引相手はこれに依拠できること、(b)本質問書で示したとおり、DF スケジュールをもって合致 PCA を補完することを選択したこと、および(c)本質問書の第3部セクション 5(a)の質問に「はい」と回答した場合、ISDA2013年3月 DF プロトコル・マスター契約を締結することに合意したことを表明します。

[PCA本人またはPCA代理人の正式名称を挿入]¹⁰

署名: _____

氏名:

役職:

日付:

¹⁰ 1 または複数の PCA 本人の代理として行為する PCA 代理人である場合には、署名欄に次の文言を挿入してください。
「PCA 本人回答表の列1に列挙された顧客、投資家、ファンド、口座および/またはその他の本人の代理として行為する、」