

これは、1995 ISDA Credit Support Annex (Transfer – English Law)の日本語参考訳です。用語の一部について、この日本語参考訳と英国法以外を準拠法とする ISDA クレジット・サポート・アネックスの日本語参考訳との間で、当該準拠法に固有のニュアンスに鑑み、異なる日本語訳を用いている場合があります。

(双方差入型－所有権移転方式)¹

(英国法準拠ISDAマスター契約用)²

ISDA®

国際スワップ・デリバティブズ協会

及び

(「当事者A」)

(「当事者B」)

間の____年____月____日付

ISDAマスター契約

スケジュールへの

クレジット・サポート・アネックス

本アネックスは上記のISDAマスター契約を補足し、その一部分を構成し、同契約に従うものであり、またそのスケジュールの一部分である。マスター契約（マスター契約第1条(c)項、第2条(a)項、第5条及び第6条を含むがこれらに限られない。）に関して、本アネックスに定める信用補完の取決めは一件の取引を構成する（当該取引に関して、本アネックスはコンファメーションを構成する）。

¹ 本書は、本書の条項に基づき引渡された資産について質権その他の担保権を設定することを意図するものではない。質権その他の担保権の設定による担保の取決めの樹立を意図している場合は適宜、ISDAクレジット・サポート・ディード（英国法版）またはISDAクレジット・サポート・アネックス（ニューヨーク州法版）を使用することを検討すべきである。

² このクレジット・サポート・アネックスは英国法準拠のISDAマスター契約とあわせて使用するために作成されたものである。使用者は本書式及び本書式が企図する取決めの適切な使用方法及び効果について、法律顧問に相談すべきである。特に、クレジット・サポート・アネックスを英国法以外の準拠法に準拠させようとしている場合や、クレジット・サポート・アネックスをISDAマスター契約の他の部分の準拠法とは異なる法律に準拠させようとしている場合（例えば、クレジット・サポート・アネックスが英国法準拠でISDAマスター契約の残る部分がニューヨーク州法の場合など）は法律顧問に相談すべきである。

第1条 解釈

本アネックスまたはマスター契約の他の部分に別段の定義がない英文の大文字で始まる用語は、第10条に従い定められた意味を有する。本アネックスにおける条文への言及は本アネックスの条文を意味する。本アネックスとスケジュールの他の規定が矛盾する場合、本アネックスが優先し、また第11条と本アネックスの他の規定が矛盾する場合には、第11条が優先する。疑義を避けるため付言するが、本アネックスにおいて「引渡す」という場合、現金に関しては支払いを意味し、またその他の資産に関しては引渡すことを意味する。

第2条 信用補完義務

(a) **差入額** 第3条及び第4条に従い、譲受人から評価算出日またはその後直ちに請求があり、当該評価算出日の差入額が譲渡人の最低引渡額に等しいか、またはこれを上回っている場合には、譲渡人は譲受人に対して、引渡日現在で、少なくとも差入額（第11条(b)項(iii)号(D)により端数処理された後の金額とする。）に相当する評価額の適格信用補完物を引渡す。第11条(b)項に別段の定めがない限り、各評価算出日において譲渡人に適用される「差入額」は、

(i) 必要信用補完額が

(ii) 譲渡人に関する（譲受人が保有する）保有信用補完残高の評価算出日における評価額（評価算出日前に発生した差入額は算入、また返還額は除外（いずれの金額もその引渡しが無了であって、関連する決済日が評価算出日以降に到来するもの）して、調整を行なった額とする。）

を上回る金額に等しいものとする。

(b) **返還額** 第3条及び第4条に従い、譲渡人から評価算出日またはその後直ちに請求があり、当該評価算出日の返還額が譲受人の最低引渡額に等しいか、またはこれを上回っている場合には、譲受人は譲渡人に対して、引渡日現在で、返還額（第11条(b)項(iii)号(D)により端数処理された後の金額とする。）に実務上可能な限り近い評価額を有する同価値の信用補完物のうち譲渡人がかかる請求において指定するものを引渡すものとし、保有信用補完残高はかかる引渡しに従って減少するものとする。第11条(b)項に別段の定めがない限り、各評価算出日において譲受人に適用される「返還額」は、

(参考訳)

(i) 譲渡人に関する(譲受人が保有する)保有信用補完残高の評価算出日における評価額(評価算出日前に発生した差入額は算入、また返還額は除外(いずれもその引渡しが無了であって、関連する決済日が評価算出日以降に到来するもの)して、調整を行なった額とする。)が

(ii) 必要信用補完額

を上回る金額に等しいものとする。

第3条 引渡、計算及び交換

(a) 引渡 本アネックスに基づく適格信用補完物、同価値の信用補完物、利息金額または同価値の配当物の引渡しはすべて譲受人または譲渡人(該当する者)の指図に従い行なわれるものとし、

(i) 現金の場合には受取人が指定する一つまたは複数の銀行口座宛に送金する。

(ii) 記帳により引渡しが行なわれない、または当事者間で記帳によって引渡されないことについて合意した券面発行済の証券の場合、正式に発行された名義移転のための証書、譲渡税支払いの印紙等一切の、引渡人から受取人への法的に有効な所有権の移転を構成するために必要な書類を付して、受取人またはその口座に対して、証券現物を引渡す。

(iii) 当事者間で記帳によって引渡されることについて合意した証券の場合、受取人が指定する決済機関その他の法人に対して書面による指図(疑義を避けるために付言するが、テレックス、ファクシミリまたは電子通信システムで行なわれる指図も含まれる。)を行う。かかる指図とともに、引渡人から受取人への法的に有効な所有権の移転をもたらすに十分な形で、かかる指図の書面による写しを受取人に交付するものとする。

第4条に従い、かつ別段の定めがない限り、適格信用補完物または同価値の信用補完物の引渡請求が通知期限までに受領された場合、当該引渡しは当該請求が受領された日に関する決済日の営業終了時までに行われるものとする。また、通知期限以降に請求が受領された場合、当該引渡しはかかる請求が受領された日の翌日に関する決済日の営業終了時までに行われるものとする。

(b) 計算 第2条及び第4条(a)項に関する評価額及びエクスポージャーの計算はすべて、評価代理人が評価基準時刻にこれを行うものとする。評価代理人は各当事者(評価代理人が一方

ISDA©1995

(参考訳)

の当事者である場合には、相手方当事者) に対して、当該評価算出日 (第 4 条(a)項の場合には、計算日) の翌現地営業日の通知期限までに計算結果を通知するものとする。

(c) 交換

- (i) 第 1 1 条に別段の定めがない限り、譲渡人は、いずれの現地営業日にも通知により、譲受人に対して譲渡人の保有信用補完残高のうちのかかる通知に指定する適格信用補完物 (「原信用補完物」) に代えて、かかる通知に指定する適格信用補完物 (「新しい信用補完物」) を引渡したい旨申し出ることができる。
- (ii) 譲受人が譲渡人に対してかかる交換を承諾したことを通知した場合、(A)譲渡人は譲受人に対して、譲受人からの承諾通知 (電話による口頭の通知でもよい。) を受領した日の翌決済日に、譲受人に対して新しい信用補完物を引渡す義務があるものとし、(B)譲受人は譲渡人に対して、第 1 1 条(d)項に別段の定めがない限り、原信用補完物と同価値の信用補完物を譲受人が新しい信用補完物を受領した日の翌決済日 (「交換日」) までに引渡す義務があるものとする。但し、譲受人は引渡日における評価額が新しい信用補完物の同引渡日における評価額と実務上可能な限り近い (但し、いかなる場合にも上回らない。) 同価値の信用補完物を引渡す義務のみを負うものとする。

第 4 条 紛争の解決

(a) 計算または評価の争い 一方の当事者 (「異議当事者」) が(I)評価代理人による差入額もしくは返還額の計算、または(II)適格信用補完物もしくは同価値の信用補完物の引渡しにかかる評価額に合理的な異議をとる場合、

(1)異議当事者は相手方当事者及び評価代理人 (評価代理人が相手方当事者でない場合) に対して、(X)上記(I)の場合には第 2 条に基づく請求が受領された日、または(Y)上記(II)の場合には引渡日、の翌現地営業日の営業終了時まで通知し、

(2)上記(I)の場合には、第 2 条に基づく請求が受領された日の翌決済日の営業終了時まで、争いのない金額だけを相手方当事者に引渡すものとする。

(3)両当事者は紛争を解決するために相互に協議するものとする。そして

(参考訳)

(4)解決時間までに紛争が解決されない場合には、以下の通りとする。

(i) 差入額または返還額にかかる紛争の場合、第11条(c)項に別段の定めがない限り、評価代理人は以下の方法により再計算日付でエクスポージャー及び評価額を再計算するものとする。

(A)エクスポージャーのうち両当事者が争いのないものとして合意した取引に帰しうる部分の計算結果を使用する。

(B)レファレンス・マーケットメーカーからマーケット・クォーターションを計算するために実際に4件の市場の仲値によるクォーターションを求めて、得られたクォーターションの算術平均を出すことにより、エクスポージャーのうち争いのある取引に帰しうる部分を計算する。但し、ある取引につき4件のクォーターションが得られない場合、当該取引については4件未満のクォーターションを使用することができる。また、ある取引につき一切クォーターションが得られない場合、当該取引に関しては評価代理人の独自の計算結果を使用することができる。

(C)保有信用補完残高の評価額に争いがある場合、その計算については第11条(e)項(ii)号に定める手続きを使用する。

(ii) 適格信用補完物または同価値の信用補完物の引渡しの評価額にかかる紛争の場合、評価代理人は第11条(e)項(ii)号に従い引渡日における評価額を再計算する。

本条による再計算に続き、評価代理人は速やかに、但しいかなる場合も解決時間の翌現地営業日の通知期限までに各当事者（評価代理人が一方の当事者である場合には、相手方当事者）に通知する。該当する当事者は評価代理人によるかかる通知、または上記(3)号による紛争の解決後、第3条(a)項に従い、請求あり次第適切な引渡しを行う。

(b) 期限の利益喪失事由でないこと 当事者が、第4条(a)項が適用される紛争の対象となっている金額について引渡しを行なわなかった場合、この第4条に定める手続きが遂行されている間は、期限の利益喪失事由は構成しないものとする。疑義を避けるために付言するが、これら

(参考訳)

の手続きの完了をもって、当事者が第4条(a)項の最後の文に基づきなすべき引渡しを引渡期日に行なわなかった場合、マスター契約第5条(a)項(i)号が適用される。

第5条 所有権の移転、担保権でないこと、配当物及び利息金額

(a) **所有権の移転** 各当事者は、本アネックスの条項に基づき相手方当事者に引渡す適格信用補完物、同価値の信用補完物、同価値の配当物または利息金額に関する一切の権利、所有権、利益は、関連する決済システム内の全ての証券について通常の業務過程で存在することになる先取特権を除き、いかなる先取特権、請求権、担保権その他の負担もなく、また引渡人もしくはいかなる第三者によるその他のいかなる権利も付されることなく、受取人に付与されることに同意する。

(b) **担保権でないこと** 本アネックスは、本アネックスの条項に基づき一方の当事者から相手方当事者に引渡される現金その他の資産について、いずれかの当事者を受益者とするいかなる抵当権、担保権、先取特権、質権、制限物権またはその他の担保物権の設定も意図するものではなく、また設定するものではない。

(c) 配当物及び利息金額

(i) **配当物** 譲受人は譲渡人に対して、配当日の翌決済日までに当該配当物と種類、額面価格、銘柄、数量が同じ現金、証券その他の資産（「同価値の配当物」）を引渡す。但し、かかる引渡しは、評価代理人が計算し（この計算については計算日が評価算出日であるものとみなされる。）かかる引渡しによって差入額が発生または増加しない場合に限られる。

(ii) **利息金額** 第11条(f)項(iii)号に別段の定めがない場合、譲受人は譲渡人に対して、第11条(f)項(ii)号に定める時期に当該利息金額を引渡す。但し、かかる引渡しは評価代理人が計算し（この計算については計算日が評価算出日であるものとみなされる。）、かかる引渡しによって差入額が発生または増加しない場合に限られる。

第6条 債務不履行

当事者に関して期限の利益喪失事由の発生の結果として期限前終了日が指定された場合、または発生したとみなされる場合、保有信用補完残高の評価額に相当する金額（期限前終了日が評価

ISDA©1995

(参考訳)

算出日であるものとして計算される)は、マスター契約第6条(e)項に関して、(譲渡人が期限の利益喪失当事者であるかどうかにかかわらず、)譲渡人に対して支払うべき未払金額とみなされる。疑義を避けるために付言するが、マーケット・クォーテーションがマスター契約第6条(e)項に関して適用される支払基準である場合、本アネックスが構成する取引に関してマスター契約第6条(e)項に基づき決定されるマーケット・クォーテーションはゼロであるものとみなされる。また、マスター契約第6条(e)項に関して適用される支払基準が損失(Loss)である場合、マスター契約第6条(e)項に基づき本取引に関して決定される損失は、保有信用補完残高の評価額に相当する未払金額に限定されるものとする。

第7条 表明

各当事者は、相手方当事者に対して、当該当事者が本アネックスに基づき、相手方当事者に引渡す全ての適格信用補完物、同価値の信用補完物もしくは同価値の配当物の唯一の所有者であつて、あるいは、これらを一切の担保物権、先取特権、制限物権またはその他の制限(関連する決済システム内の全ての証券について通常の業務過程で存在することになる先取特権を除く。)を付すことなく引渡す権利を有していることを表明する(かかる表明は、当該当事者が適格信用補完物、同価値の信用補完物または同価値の配当物を引渡す各日付毎に繰り返しなされるものとみなされる。))。

第8条 費用

各当事者は、本アネックスに基づく自己の債務の履行に関する自己の経費及び費用(本アネックスに基づき当該当事者が行う義務ある引渡しに関して支払うべき一切の印紙税、譲渡税または同様の取引税もしくは課徴金を含む。)を支払うものとし、いずれの当事者も、相手方当事者に生じたかかる経費及び費用を負担する義務を負わない。

第9条 雑則

(a) 遅延利息

第4条(a)項に基づく紛争の対象となっている金額の場合を除き、譲受人が同価値の信用補完物、同価値の配当物または利息金額を期限に引渡さなかった場合には、譲受人は譲渡人に対して、同価値の信用補完物、同価値の配当物または利息金額の引渡しが必要とされた日(当日を含む。)から同価値の信用補完物、同価値の配当物または利息金額が引渡された日(当日を除く。)まで

ISDA©1995

(参考訳)

の期間につき、デフォルト・レートに引渡しを要する資産の関連する評価算出日現在の評価額を乗じた利息に相当する金額(法令により認められている範囲内とする。)を支払う義務を負う。かかる利息は実際の経過日数について各日複利計算により算定される。

(b) 誠実かつ商業的に合理的な方法

本アネックスに基づく全ての義務の履行(いずれかの当事者が行うあらゆる計算、評価及び決定を含むがこれらに限らない。)は、誠実にかつ商業的に合理的な方法で行われるものとする。

(c) 要求及び通知

本アネックスに基づき一方の当事者が行うあらゆる請求及び通知は、マスター契約第12条の定めにより行われるものとする。

(d) 特定事項に関する指定

本アネックスにおいて第11条で定められることとなっている事項は、一件または複数のコンファメーションその他の文書においても定めることができる。本アネックスはその旨に従って解釈されるものとする。

第10条 定義

本アネックスにおいて使用される場合、

「基準通貨(Base Currency)」とは、第11条(a)項(i)号に定める意味を有する。

「基準通貨相当額(Base Currency Equivalent)」とは、評価算出日における金額に関して、基準通貨で表示される場合においては、当該基準通貨の額をいうものとし、基準通貨以外の通貨に交換される場合においては、当該評価算出日において評価代理人が定めるスポットレートで当該基準通貨以外の通貨を購入するために必要な基準通貨の額をいう。

「必要信用補完額(Credit Support Amount)」とは、評価算出日において譲渡人に関して、(i)譲受人のエクスポージャーに、(ii)譲渡人に適用される一切の独立信用補完額(もしあれば)を加算し、(iii)譲受人に適用される一切の独立信用補完額(もしあれば)を差し引き、かつ(iv)譲渡人の極度額を差し引いた金額をいう。但し、必要信用補完額の計算の結果がゼロを下回る場合には、必要信用補完額はゼロとみなされる。

ISDA©1995

(参考訳)

「保有信用補完残高(Credit Support Balance)」とは、評価算出日において譲渡人に関して、本アネックスに基づき譲受人に引渡され、または譲受人が受領した全ての適格信用補完物の総額、並びに一切の配当物及びかかる適格信用補完物もしくは配当物の全ての代り金（第2条(b)項、第3条(c)項(ii)号または第6条に基づく減額後とする。）をいう。同価値の配当物または利息金額（もしくはこれらの一部）で第5条(c)項(i)号または(ii)号に従い引渡しが行なわれなかったものについては保有信用補完残高の一部となる。

「差入額(Delivery Amount)」とは、第2条(a)項に定める意味を有する。

「異議当事者(Disputing Party)」とは、第4条に定める意味を有する。

「配当物(Distributions)」とは、証券で構成される保有信用補完残高に含まれる適格信用補完物に関して、かかる適格信用補完物と同一の種類、額面価格、銘柄及び数量の証券の所持人が随時受領する権利を有する一切の元本、利息並びに現金またはその他の資産による支払金及び分配物をいう。

「配当日(Distribution Date)」とは、保有信用補完残高に含まれる現金以外の適格信用補完物に関して、かかる適格信用補完物の所持人が配当物を受領する権利を有するそれぞれの日、またはかかる日が現地営業日ではない場合には、その翌現地営業日をいう。

「適格信用補完物(Eligible Credit Support)」とは、一方の当事者に関して、第11条(b)項(ii)号においてかかる当事者についてその旨規定される信用補完物（もしあれば）をいう。かかる信用補完物には、証券に関連して（適用ある場合には）、該当する発行体によるかかる証券の全部または一部の償還代り金が含まれる。

「適格通貨(Eligible Currency)」とは、当該通貨が自由に流通している限りにおいては、第11条(a)項(ii)号において指定された通貨をいう。

「同価値の信用補完物(Equivalent Credit Support)」とは、保有信用補完残高に含まれる適格信用補完物に関連して、かかる適格信用補完物と同一の種類、額面価格、銘柄及び数量の適格信用補完物をいう。

「同価値の配当物(Equivalent Distributions)」とは、第5条(c)項(i)号に定める意味を有する。

(参考訳)

「交換日(Exchange Date)」とは、第 1 1 条(d)項に定める意味を有する。

「エクスポージャー(Exposure)」とは、評価算出日において一方の当事者に関して、紛争がある場合には第 4 条に従い、全取引（本アネックスにより構成される取引を除く。）が評価基準時刻付で終了するものとして、マスター契約第 6 条(e)項(ii)号(1)に従い、かかる当事者が相手方当事者から支払いを受け（正の数で表示される。）、またはかかる当事者が相手方に対し支払いをなす（負の数で表示される。）ことになる金額（もしあれば）をいう。但し、(i)かかる当事者が事由発生当事者ではないこと、及び(ii)基準通貨が終了通貨であることを前提とする。また、マーケット・クォーターションは、評価代理人が、かかる当事者の代わりに、代替取引（「マーケット・クォーターション」の定義の中でなされている定義による。）に関して支払われる金額の市場における仲値による評価を用いて決定する。

「独立信用補完額(Independent Amount)」とは、一方の当事者に関して、第 1 1 条(b)項(iii)号(A)においてその旨指定されている金額の基準通貨相当額をいう。金額が指定されていない場合にはゼロとする。

「利息金額(Interest Amount)」とは、利息計算期間に関して、関連する各通貨の現金で構成される保有信用補完残高の一部の元本金額に対し、当該各通貨について決定され、当該利息計算期間の各日について計算された利息額の基準通貨相当額の合計金額をいい、評価代理人によって当該各日につき以下の通り決定される。

- (x) 当該日の当該通貨による現金の額に、
- (y) 当該日に適用される利率を乗じて
- (z) 360（英ポンドの場合には 365）で除すものとする。

「利息計算期間(Interest Period)」とは、直近の利息金額の引渡しがあった現地営業日（当日を含む。）（利息金額が未だ引渡されていない場合には、現金による適格信用補完物または同価値の信用補完物が譲受人に引渡され、または譲受人により受領された現地営業日とする。）から、現在発生中の利息金額が引渡されることになる現地営業日（当日を除く。）までの期間をいう。

「利率(Interest Rate)」とは、適格通貨に関して、第 1 1 条(f)項(i)号においてその旨定める利率をいう。

(参考訳)

「現地営業日(Local Business Day)」とは、第 1 1 条(h)項に別段の定めがない限り、以下を意味する。

(i) 本アネックスに基づく現金その他の資産(証券を除く。)の引渡しに関しては、関連する口座の所在する地、及び、これと異なる場合には、当該支払いの通貨の主要な金融センター(もしあれば)において、商業銀行が営業(外国為替及び外貨預金取引を含む。)を行う日。

(ii) 本アネックスに基づく証券の引渡しに関しては、当該証券の引渡しについて両当事者が合意した決済システムが決済指図の受領及び執行のために稼動している日、または、当該証券の引渡しについてその他の方法を予定している場合には、当該目的のために両当事者が合意した地の商業銀行が営業(外国為替及び外貨預金取引を含む。)を行う日。

(iii) 本アネックスに基づく評価に関しては、評価代理人の所在する地、及び当該目的のために両当事者が合意した地の商業銀行が営業(外国為替及び外貨預金取引を含む。)を行う日。

(iv) 本アネックスに基づく通知またはその他の連絡に関しては、その受領者により提供された直近の通知の宛先に指定されている地の商業銀行が営業(外国為替及び外貨預金取引を含む。)を行う日。

「最低引渡額(Minimum Transfer Amount)」とは、一方の当事者に関して、第 1 1 条(b)項(iii)号(C)においてその旨定められる価額をいう。価額が指定されない場合にはゼロとする。

「新しい信用補完物(New Credit Support)」とは、第 3 条(c)項(i)号に定める意味を有する。

「通知期限(Notification Time)」とは、第 1 1 条(c)項(iv)号に定める意味を有する。

「再算出日(Recalculation Date)」とは、第 4 条に基づき紛争が生じた場合の評価算出日をいう。但し、紛争解決以前において、第 2 条に基づきその後の評価算出日が発生した場合には、「再算出日」とは第 2 条に基づく直近の評価算出日をいう。

「解決時間(Resolution Time)」とは、第 1 1 条(e)項(i)号に定める意味を有する。

(参考訳)

「返還額(Return Amount)」とは、第2条(b)項に定める意味を有する。

「決済日(Settlement Day)」とは、ある期日に関して、(i)現金その他の資産（証券を除く。）の引渡しについては、翌現地営業日をいい、(ii)証券の引渡しについては、当該証券の取引がかかる期日になされたとしたら、当該証券の引渡しのために両当事者が合意する決済システムを通じて、または当該証券が主に取引されている市場にて、かかる取引を決済する際の慣行に従いその決済がなされる日以後の最初の現地営業日（または、いずれの場合も、かかる慣行がない場合には、当該証券の引渡しが合理的に実行可能な日以後の最初の現地営業日）をいう。

「信用極度額(Threshold)」とは、一方の当事者に関して、第11条(b)項(iii)号(B)においてその旨定められる金額をいう。金額が定められていない場合にはゼロとする。

「譲受人(Transferee)」とは、各評価算出日に関して、エクスポージャーが正数である当事者をいい、保有信用補完残高に関して、本アネックスに従いかかる保有信用補完残高または（場合により）かかる保有信用補完残高の評価額を相手方当事者に対して負担する当事者をいう。

「譲渡人(Transferor)」とは、譲受人に関連して、その相手方当事者をいう。

「評価代理人(Valuation Agent)」とは、第11条(c)項(i)号に定める意味を有する。

「評価算出日(Valuation Date)」とは、第11条(c)項(ii)号に定める各日または同号に従い決定される各日をいう。

「掛け目(Valuation Percentage)」とは、適格信用補完物の内容に関して、第11条(b)項(ii)号においてその旨定める割合をいう。

「評価基準時刻(Valuation Time)」とは、第11条(c)項(iii)号に定める意味を有する。

「評価額(Value)」とは、評価算出日において、または紛争がある場合には第4条に従って評価額が計算されるその他の日において、以下の通りとする。

- (i) 保有信用補完残高に含まれる適格信用補完物に関して、
 - (A) 現金の場合には、かかる金額の基準通貨相当額に、適用される掛け目（もしあれば）を乗じた金額。

(参考訳)

(B) 証券の場合には、評価代理人が入手した買取価格に、適用される掛け目（もしあれば）を乗じた金額。

(ii) 保有信用補完残高に含まれる適格信用補完物ではない信用補完物に関してはゼロとする。

第11条 選択事項

(a) 基準通貨及び適格通貨

- (i) 「基準通貨」とは米ドルを意味する。但し、以下に別段の定めがある場合にはこの限りではない。

- (ii) 「適格通貨」とは、基準通貨と以下に指定する各通貨をいう：

(b) 信用補完義務

- (i) 差入額、返還額及び必要信用補完額

- (A) 「差入額」とは、第2条(a)項に定める意味を有する。但し、以下に別段の定めがある場合にはこの限りではない。

- (B) 「返還額」とは、第2条(b)項に定める意味を有する。但し、以下に別段の定めがある場合にはこの限りではない。

- (C) 「必要信用補完額」とは、第10条に定める意味を有する。但し、以下に別段の定めがある場合にはこの限りではない。

- (ii) 適格信用補完物 以下の信用補完物は、以下に指定される当事者に関して「適格信用補完物」としての資格を有する。

	適格信用補完物	当事者A	当事者B	掛け目
(A)	適格通貨の現金	[]	[]	[]%
(B)	[] 政府が発行した債券であって、発行日から満期日までの期間が1年以下のもの。	[]	[]	[]%
(C)	[] 政府が発行した債券であって、発行日から満期日までの期間が1年超10年以下のもの。	[]	[]	[]%
(D)	[] 政府が発行した債券であって、発行日から満期日までの期間が10年超のもの。	[]	[]	[]%

(E) その他 [] [] []%

(iii) 極度額

(A) 当事者Aに関する「独立信用補完額」 : _____
当事者Bに関する「独立信用補完額」 : _____

(B) 当事者Aに関する「信用極度額」 : _____
当事者Bに関する「信用極度額」 : _____

(C) 当事者Aに関する「最低引渡額」 : _____
当事者Bに関する「最低引渡額」 : _____

(D) 端数の処理
差入額及び返還額は[____の整数倍に切り下げる。/それぞれ____の整数倍に切り上げる、および切り下げる]³

(c) 評価及び評価時期

(i) 「評価代理人」とは、第2条および第4条に関しては第2条に基づき請求を行う当事者、第5条(c)項に関しては譲受人を意味する。但し、以下に別段の定めがある場合にはこの限りではない。 _____

(ii) 「評価算出日」とは、 _____をいう。

(iii) 「評価基準時刻」とは、以下をいう。

[] 評価算出日もしくは計算日(該当する方)の評価代理人の所在地における営業終了時をいう。

[] 評価算出日もしくは計算日(該当する方)の直前の現地営業日の営業終了時をいう。

但し、評価額及びエクスポージャーの計算は、実行可能な限り、同日のほぼ同時刻に行われるものとする。

(iv) 「通知期限」とは、現地営業日の午後1時(ロンドン時間)をいう。但し、以下に別段の定めがある場合にはこの限りではない。 _____

(d) 交換日 「交換日」とは、第3条(c)項(ii)号に定める意味を有する。但し、以下に別段の定めがある場合にはこの限りではない。

³ いずれかを削除する。

(e) 紛争の解決

- (i) 「解決時間」とは、第4条に基づく紛争を引き起こすことになる通知がなされた日の翌現地営業日の午後1時（ロンドン時間）をいう。但し、以下に別段の定めがある場合はこの限りではない。
-

- (ii) 評価額 第4条(a)項(4)号(i)(C)及び第4条(a)項(4)号(ii)に関して、保有信用補完残高の評価額、または適格信用補完物もしくは同価値の信用補完物の引渡しについての評価額は、以下のとおり計算される。
-

- (iii) 代替的解決手続 第4条の規定が適用される。但し、以下に代替的な解決手続の定めがある場合にはこの限りではない。
-

(f) 配当物及び利息金額

- (i) 利率 「利率」とは、それぞれの適格通貨に関して以下のとおりとする。

適格通貨

利率

- (ii) 利息金額の引渡し 利息金額の引渡しは、毎暦月の最後の現地営業日、及び全部または一部が現金で構成される返還額が第2条(b)項に従って譲渡人に対して引き渡される現地営業日に行われる。但し、以下に別段の定めがある場合にはこの限りではない。
-

- (iii) 利息金額の代替 第5条(c)項(ii)号の規定が適用される。但し、以下に別段の定めがある場合にはこの限りではない。
-

(g) 引渡しのための宛先

当事者A : _____

当事者B : _____

(h) その他の規定