

EU 証券集中保管機関規則 (CSDR) : 決済規律制度

この特約は、CSDR および決済規律 RTS の遵守を確保することを目的とした規定を定めるものです。

本特約において使用されている用語のうち定義されていない用語は、当社とお客様との間に適用のある約款集に掲載された各約款（以下「約款」といいます。）に定める意味を有します。

本特約に定める事項に関して、関連契約と本特約との間に齟齬が生じた場合には、本特約に定める規定が優先します。疑義を避けるために付言すると、本特約は CSDR 取引に該当しない取引に関して発生した決済フェイルには適用されません。

お客様が本人のために行為する代理人である場合は、お客様自ら本特約に定める規定を遵守するとともに、当該本人にもこれを遵守させるものとします。

疑義を避けるために付言すると、本特約および本特約に起因または関連して生じる契約外の義務については、日本法に準拠し、同法に従って解釈されるものとします。

1 違約金および受取違約金

1.1 執行ブローカーまたは取引の相手方としての当社

当社は、当社（執行ブローカーまたは取引の相手方として）がお客様との間でまたはお客様のために執行した CSDR 取引について発生した決済フェイルに関連して、CSDR 第 7(2)条および決済規律 RTS 第 16 条ないし第 20 条に基づき、その後の CSDR 取引（お客様との間でもしくはお客様のために執行するものか、または第三者との間で執行するものかを問いません。）に関して違約金（以下「**違約金**」）と申します。）を課される可能性があります。また、違約金制度の実施、維持または運営を賄うことを目的として別途費用（以下「**違約金制度運営費**」）と申します。）を請求される可能性があります。当社は、その裁量により、かかる決済フェイルの結果として被った(i)違約金および(ii)違約金制度運営費を上限とする金額をお客様に請求し、回収することができます。

1.2 決済代理人としての当社

当社は、自らが、CSD 参加者としてお客様のために決済する CSDR 取引について発生した決済フェイルに関連して、CSDR 第 7(2)条および決済規律 RTS 第 16 条ないし第 20 条に基づき、違約金、違約金制度運営費を課され、かつ／または、違約金の支払（以下「**受取違約金**」）と申します。）を受ける可能性があります。当社が CSD 参加者として受領した受取違約金は、もっぱら当社に対し支払われ、当社の計算で受領するものとします。当社は、その裁量により、お客様と第三者との間で執行され、当社が決済代理人としてお客様のために決済した CSDR 取引に関連して発生した決済フェイルについて被った(i)違約金および(ii)違約金制度運営費を上限とする金額をお客様に請求することができます。



2 補 償

2.1 疑義を避けるために、お客様は以下の事項を確認し、これに同意します。

- 2.1.1 決済フェイルにより、当社または BNP パリバグループ内の関連会社が、お客様との間でまたはお客様のために CSDR 取引（お客様との間でまたはお客様のために CSDR 取引を執行するために第三者との間で CSDR 取引を執行することを含む場合があります。）を実行するためになした作為または不作為の過程で、またはその結果、損失（違約金、違約金制度運営費に関連する費用を含みますが、これらに限定されません。）を被るおそれが生じること。
- 2.1.2 上記の損失は、お客様に責任があるか否かにかかわらず、発生する可能性があること。
- 2.1.3 上記の損失が、当該損失を被った当社または BNP パリバグループ内の関連会社による詐欺、過失または故意の不履行に直接起因しないことを条件として、当社または当該関連会社は、約款の条件に従い当該損失についてお客様から補償を受けること。

3 解 釈

- 3.1 本特約に別段の定めがある場合を除き、本特約において使用および定義される定義語は、関連契約において他の意味が与えられているとしても、もっぱら本特約に定める意味を有します（また、本特約に定める規定にのみ適用されます）。本特約において使用されているものの定義されていない定義語は、関連契約に定める意味を有します。
- 3.2 本特約において、「お客様」という場合、お客様自身を意味し、お客様が代理人として行為する場合には、場合によりお客様が代理する本人をいいます。
- 3.3 以下の定義語が適用されます。
 - 「**違約金**」とは、第 1.1 項に定める意味を有します。
 - 「**違約金制度運営費**」とは、第 1.1 項に定める意味を有します。
 - 「**受取違約金**」とは、第 1.2 項に定める意味を有します。
 - 「**関連会社**」とは、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭 38・11・27 大令 59）その他の法令諸規則に定める関連会社をいいます。
 - 「**関連契約**」とは、約款および適用ある商品契約をいいます。
 - 「**決済規律 RTS**」とは、欧州委員会委任規則（EU）2018/1229（随時の改正を含みます。）をいいます。
 - 「**決済フェイル**」とは、決済の予定された日における CSDR 取引の決済未了または部分決済をいいます。

「効力発生日」とは、2022年2月1日または当社が書面（電子メールも可）によりお客様に通知するその他の日をいいます。

「商品契約」とは、お客様と当社との間で締結され、効力発生日現在有効な各商品契約をいい、ISDA マスター契約（ISDA Master Agreement）、グローバル・マスター有価証券貸借契約（Global Master Securities Lending Agreement）、グローバル・マスター・レポ契約（Global Master Repurchase Agreement）または金融デリバティブ取引に係るドイツのマスター契約（German Master Agreement for Financial Derivatives Transactions）を含みますが、これらに限定されません。

「約款」とは、総合約款に定める意味を有します。

「BNP パリバグループ内の関連会社」とは、BNP Paribas S.A.、BNP Paribas S.A.の連結子会社、および BNP Paribas S.A.または同社の連結子会社の関連会社をいいます。

「CSD」とは、CSDR に定義される証券集中保管機関をいいます。

「CSD 参加者」とは、CSDR に定義される参加者をいいます。

「CSDR」とは、EU 規則 2014 年第 909 号（随時の改正を含みます。）をいいます。

「CSDR 金融商品」とは、CSDR 第 5(1)条に定める各金融商品をいいます。

「CSDR 取引」とは、欧州経済領域（EEA）の CSD において決済される CSDR 金融商品に係る各取引をいいます。

