

金利スワップ取引清算業務における清算委託者の利便性向上等に係る制度要綱

2018年10月25日
株式会社日本証券クリアリング機構

I. 趣旨

当社の金利スワップ取引清算業務において、清算委託者が受託清算参加者と締結する金利スワップ清算受託契約書等について、現行の日本語様式に加えて英語様式の利用を可能とするなど、清算委託者の利便性向上等を図るため、所要の制度整備を行う。

II. 概要

項目	内容	備考
1. 英語様式の金利スワップ清算受託契約書等の導入	<ul style="list-style-type: none"> ・金利スワップ清算受託契約書について、現行の日本語様式に加え、当社は英語様式を定める。 ・清算委託者が当社に差し入れる誓約書について、現行の日本語様式に加え、当社は英語様式を定める。 	
2. クライアント・クリアリング手数料に係る特則の届出及びその取下げ時期の追加	<ul style="list-style-type: none"> ・受託清算参加者がクライアント・クリアリング手数料に係る特則の適用を受ける委託取引口座を当社に届け出ることができる時期及びその届出を取り下げることができる時期について、現行の3月及び9月に、6月及び12月を追加し、四半期毎に当該届出又は取下げを行うことができるものとする。 	<ul style="list-style-type: none"> ・特則とは、清算約定の想定元本に応じた手数料体系に加えて、取引量の多いクライアント向けに導入した手数料体系（金利スワップ取引清算業務に係る手数料に関する規則第5条の2の2に規定する手数料）をいう。 ・委託取引口座を新たに開設する場合には、当該開設と同時に届出を行うことができる点については、変更なし。

項 目	内 容	備 考				
<p>3. ポジション移管の自動化の導入</p> <p>(1) 制度概要</p> <p>(2) 申込み等</p> <p>(3) 手数料</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・ 現在、ポジションの移管（承継及び引継ぎを含む。）は、利用者が都度当社に申請を行った上で実施している（以下「都度移管方式」という。）。 ・ 今般、利用者の利便性向上を図るため、都度移管方式に加えて、初期の申請に基づき毎当社営業日自動的に所定の口座に移管される方式（以下「自動移管方式」という。）を導入する。 ・ 自動移管方式でのポジション移管を利用する場合には、あらかじめ当社に対し、移管元及び移管先の口座情報等について申請する。 ・ 当社は、毎当社営業日に、申請を受けた移管元口座の午後4時時点における全ての債務負担済取引を、移管先口座に移管する。 ・ 自動移管方式の導入に伴い、ポジション移管（破綻時を除く。）に対して以下の手数料を設定する。 <table border="1" data-bbox="546 1201 1350 1399"> <tr> <td data-bbox="546 1201 745 1350">ポジション移管手数料</td> <td data-bbox="745 1201 1350 1350">ポジション移管をした債務負担済取引1件あたり2,000円 ただし、1計算年度あたり100件まで無料</td> </tr> <tr> <td data-bbox="546 1350 745 1399">手数料の上限</td> <td data-bbox="745 1350 1350 1399">1計算年度あたり4,000万円</td> </tr> </table>	ポジション移管手数料	ポジション移管をした債務負担済取引1件あたり2,000円 ただし、1計算年度あたり100件まで無料	手数料の上限	1計算年度あたり4,000万円	<ul style="list-style-type: none"> ・ 都度移管方式は引き続き利用可能とする。 ・ 一部取引のみの移管を希望する場合は、現行同様、都度移管方式により移管が可能 ・ 自動移管方式も、都度移管方式同様、債務負担時所要証拠金の預託等を確認した後にポジションの移管を実施する。 ・ 第二階層口座単位で手数料の計算を行う。 ・ 手数料はポジション移管先（移管先が清算委託者の場合にはその受託清算参加者）が支払う。 ・ 都度移管方式及び自動移管方式の双方が対象 ・ 計算年度とは、毎年4月1日から翌年3月31日までの期間をいう。
ポジション移管手数料	ポジション移管をした債務負担済取引1件あたり2,000円 ただし、1計算年度あたり100件まで無料					
手数料の上限	1計算年度あたり4,000万円					

項 目	内 容	備 考
4. 実施時期	・上記1及び2については、2018年12月を目途とし、上記3については、2019年5月を目途とする。	

以 上