

## 米国財務省証券に係るコラテラル手数料について

2014年2月24日

2024年4月1日改正

株式会社日本証券クリアリング機構

### 1. 米国財務省証券の額面金額の円換算に関する事項（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4第2項第2号a関係）

米国財務省証券の額面金額を円換算した額は、当該米国財務省証券の差入に係る指図を清算参加者から当社が受領した日の前営業日における東京外国為替市場の対顧客直物電信買相場の1米ドル当たりの円貨額により換算した額とする。

### 2. 米国財務省証券の時価に関する事項（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4第2項第2号b関係）

米国財務省証券の時価の算出にあたっては、GovPX, Inc が公表する各月末日のニューヨーク市場における前日の最終の気配相場における価格を使用するものとする。

### 3. 米国財務省証券の管理に係る費用の円換算に関する事項（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4第2項第2号b及びc関係）

各月末日の経過時点において預託された米国財務省証券の額面金額の時価及び預託又は返戻の指図を行った回数に係る手数料にあっては、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7条第2項に規定する各計算期間において算出されるコラテラル手数料を当社に支払う月の前月の最終当社営業日の午後3時において、リフィニティブ・ジャパン株式会社及びブルームバーグ・エル・ピーから公表されている東京外国為替市場の対顧客直物電信売相場及び買相場の1米ドル当たりの円貨額の仲値の平均値を用いて円換算するものとする。

以 上