

日本円で預託を受けた清算預託金の運用方法の追加等に伴う
OTCデリバティブ清算業務に関する業務方法書の取扱い等の一部改正について

I. 改正趣旨

当社のOTCデリバティブ清算業務(CDS清算業務及び金利スワップ取引清算業務)において、清算参加者等から日本円で預託を受けた清算預託金(以下「日本円担保」という。)のうち、信託銀行へ信託設定した日本円担保について、今後の運用環境の変化等を見据えた運用方法の追加を行うほか、清算預託金の保管先である信託銀行の変更に伴い当社が信託銀行に対して負担する信託報酬が変更となるため、CDS清算業務及び金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の取扱い等について、別紙のとおり所要の改正を行う。

II. 改正概要

1. 日本円担保の運用方法の追加

- ・日本円担保の運用方法について、現在可能な方法に加えて、以下の運用方法を新たに追加する。
 - (1) 清算預託金を信託している信託銀行の定期預金
 - (2) 金融機関に対するリバースレポ取引
 - (3) 国債証券への投資

(備考)

- ・CDS清算業務に関する業務方法書の取扱い第52条の3
- ・金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の取扱い第44条の2

2. 信託銀行への信託設定により保管された清算預託金に係るコラテラル手数料の算出方法の見直し

- ・日本円担保の運用方法の追加に伴い、コラテラル手数料のうち、金銭信託に係る費用(日本銀行の補完当座預金制度における当座預金への適用利率に負数が含まれることにより、当社が当該適用利率に応じた信託報酬を負担する場合に限る。)の算出方法を見直す。
- ・当社が信託銀行に対して負担する信託報酬の算出方法の変更に伴い、コラテラル手数料のうち、代用有価証券の管理に係る費用の算出方法を見直す。

- ・CDS清算業務に係る手数料に関する規則第5条の2
- ・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

III. 施行日

2024年4月1日から施行する。

以上

CDS清算業務に関する業務方法書の取扱い等の一部改正新旧対照表

目 次

(ページ)

1. CDS清算業務に関する業務方法書の取扱いの一部改正新旧対照表	1
2. CDS清算業務に係る手数料に関する規則の一部改正新旧対照表	2
3. 金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の取扱いの一部改正新旧対照表	5
4. 金利スワップ取引清算業務に係る手数料に関する規則の一部改正新旧対照表	6

CDS清算業務に関する業務方法書の取扱いの一部改正新旧対照表

新	旧
<p>(清算預託金の運用)</p> <p>第52条の3 前条第1項第1号b及び第2項第1号bに定める方法により管理されているもののうち、清算参加者及び清算委託者が金銭により当社に預託しているCDS清算基金、当初証拠金及び破綻時証拠金に関して当社が行う業務方法書第88条第2項に規定する運用は、次の各号に掲げるいずれかの方法により行うものとする。</p> <p>(1)～(3) (略)</p> <p>(4) <u>CDS清算基金、当初証拠金及び破綻時証拠金を信託している信託業務を営む銀行への定期預金</u></p> <p>(5) <u>金融機関に対するリバースレポ取引</u></p> <p>(6) <u>国債証券への投資</u></p> <p style="text-align: center;">付 則</p> <p>この改正規定は、令和6年4月1日から施行する。</p>	<p>(清算預託金の運用)</p> <p>第52条の3 前条第1項第1号b及び<u>同条第2項第1号b</u>に定める方法により管理されているもののうち、清算参加者及び清算委託者が金銭により当社に預託しているCDS清算基金、当初証拠金及び破綻時証拠金に関して当社が行う業務方法書第88条第2項に規定する運用は、次の各号に掲げるいずれかの方法により行うものとする。</p> <p>(1)～(3) (略)</p> <p>(新設)</p> <p>(新設)</p> <p>(新設)</p>

C D S 清算業務に係る手数料に関する規則の一部改正新旧対照表

新	旧
<p>(コラテラル手数料)</p> <p>第5条の2 (略)</p> <p>2 各清算参加者のコラテラル手数料は、計算期日（3月、6月、9月及び12月末日（当該日が休業日（臨時休業日を除く。以下本項において同じ。）の場合には、その翌日（休業日を除く。））をいう。以下本項において同じ。）の翌日から次の計算期日までの期間（以下「計算期間」という。）ごとに当該各清算参加者について次の各号に掲げる費用を合計した額とする。</p> <p>(1) 国債証券の管理に係る費用 次の算式により算出される額 (各清算参加者が国債証券により当社に預託している清算基金等の額面金額の合計額を、一の計算期間において平均した額) × (当該計算期間の日数) / $365 \times 0.50 / 10,000$</p> <p>(2) 米国財務省証券の管理に係る費用 次の a から c までに掲げる算式により算出される額の合計額 a (各清算参加者が米国財務省証券により当社に預託している清算基金等の額面金額(当社が公示により定めるところにより円換算した額をいう。)の合計額を、一の計算期間において平均した額) × (当該計算期間の日数) / $365 \times 0.50 / 10,000$ b 計算期間における各月において次の算式により算出される額の合計額 (各月末日の経過時点において各清算参加者が米国財務省証券により当社に預託している清算基金等の額面金額の時価(当社が公示により定めるところにより算出し、円換算した額</p>	<p>(コラテラル手数料)</p> <p>第5条の2 (略)</p> <p>2 各清算参加者のコラテラル手数料は、計算期日（3月、6月、9月及び12月末日（当該日が休業日（臨時休業日を除く。以下本項において同じ。）の場合には、その翌日（休業日を除く。））をいう。以下本項において同じ。）の翌日から次の計算期日までの期間（以下「計算期間」という。）ごとに当該各清算参加者について次の各号に掲げる費用を合計した額とする。</p> <p>(1) 国債証券の管理に係る費用 次の算式により算出される額 (各清算参加者が国債証券により当社に預託している清算基金等の額面金額の合計額を、一の計算期間において平均した額) × (当該計算期間の日数) / $365 \times 0.11 / 10,000$</p> <p>(2) 米国財務省証券の管理に係る費用 次の a から c に掲げる算式により算出される額の合計額 a (各清算参加者が米国財務省証券により当社に預託している清算基金等の額面金額(当社が公示により定めるところにより円換算した額をいう。)の合計額を、一の計算期間において平均した額) × (当該計算期間の日数) / $365 \times 0.11 / 10,000$ b 計算期間における各月において次の算式により算出される額の合計額 (各月末日の経過時点において各清算参加者が米国財務省証券により当社に預託している清算基金等の額面金額の合計額) × (当該各月の日数) / $365 \times 0.8 / 10,000$</p>

	<p><u>をいう。) の合計額) × (当該各月の日数) /</u> $365 \times 1.0 / 10,000$</p> <p>c 次の算式により算出される額を当社が公示により定めるところにより円換算した額 $20\text{米ドル} \times (\text{各清算参加者が、清算基金等について、当該計算期間において当社に米国財務省証券の預託又は返戻の指図を行った回数})$</p> <p>(3) 金銭信託に係る費用 (日本銀行の補完当座預金制度における当座預金への適用利率に負数が含まれることにより、当社が当該適用利率に応じた信託報酬を負担する場合に限る。) 計算期間における各日において次の算式により算出される額の合計額 (当該日において各清算参加者が金銭により当社に預託している清算基金等の合計額のうち、信託業務を営む銀行への金銭信託の方法で保管されている金額<u>であって、CDS清算業務に関する業務方法書の取扱い第52条の3第3号及び第4号に定める方法により運用されているもの</u>の合計額) $\times 1 / 365 \times (\text{当該負数の絶対値})$</p> <p>(4) (略)</p> <p>(手数料の支払時期等)</p> <p>第6条 (略)</p> <p>2 清算参加者は、各計算期間において算出されるコラテラル手数料を、当該計算期間の末日の属する月の翌々月 (当該計算期間の末日が3月、6月、9月又は12月の末日ではない場合には、当該計算期間の末日の属する月の翌月) 20日 (同日が当社営業日でない場合には、翌当社営業日) までに、消費税及び地方消費税相当額を加算して当社に支払うものとする。</p> <p>3 (略)</p>	<p><u>c 10米ドル×(各清算参加者が、清算基金等について、当該計算期間において当社に米国財務省証券の預託又は返戻の指図を行った回数)</u></p> <p>(3) 金銭信託に係る費用 (日本銀行の補完当座預金制度における当座預金への適用利率に負数が含まれることにより、当社が当該適用利率に応じた信託報酬を負担する場合に限る。) 計算期間における各日において次の算式により算出される額の合計額 (当該日において各清算参加者が金銭により当社に預託している清算基金等の合計額のうち、信託業務を営む銀行への金銭信託の方法で保管されている金額) $\times 1 / 365 \times (\text{当該負数の絶対値})$</p> <p>(4) (略)</p> <p>(手数料の支払時期等)</p> <p>第6条 (略)</p> <p>2 清算参加者は、各計算期間において算出されるコラテラル手数料を、当該計算期間の末日の属する月の翌々月 (当該計算期間の末日が3月、6月、9月又は12月の末日ではない場合には、当該計算期間の末日の属する月の翌月) 20日 (同日が当社営業日でない場合には、翌当社営業日) までに、消費税及び地方消費税相当額<u>(第5条の2第2項第2号b及びcに掲げる費用に係るもの)を除く。</u>を加算して当社に支払うものとする。</p> <p>3 (略)</p>
--	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

付 則

- 1 この改正規定は、令和6年4月1日から施行する。
- 2 第5条の2第2項の規定にかかわらず、この改正規定施行前最後の計算期日は、この改正規定施行の日の前日とする。

金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の取扱いの一部改正新旧対照表

新	旧
(清算預託金の運用)	(清算預託金の運用)
第44条の2 前条第1項第1号b及び第2項 第1号bに定める方法により管理されている もののうち、清算参加者及び清算委託者が金 銭により当社に預託している金利スワップ清 算基金、当初証拠金及び破綻時証拠金に關し て当社が行う業務方法書第87条第2項に規定 する運用は、次の各号に掲げるいずれかの 方法により行うものとする。	第44条の2 前条第1項第1号b及び <u>同条第</u> <u>2項第1号bに定める方法により管理されて</u> <u>いるもののうち、清算参加者及び清算委託者</u> <u>が金銭により当社に預託している金利スワッ</u> <u>プ清算基金、当初証拠金及び破綻時証拠金に</u> <u>關して当社が行う業務方法書第87条第2項</u> <u>に規定する運用は、次の各号に掲げるいずれ</u> <u>かの方法により行うものとする。</u>
(1)～(3) (略)	(1)～(3) (略)
<u>(4) 金利スワップ清算基金、当初証拠金 及び破綻時証拠金を信託している信託業務 を営む銀行への定期預金</u>	(新設)
<u>(5) 金融機関に対するリバースレポ取引</u>	(新設)
<u>(6) 国債証券への投資</u>	(新設)
2 (略)	2 (略)
付 則	
この改正規定は、令和6年4月1日から施行 する。	

金利スワップ取引清算業務に係る手数料に関する規則の一部改正新旧対照表

新	旧
<p>(コラテラル手数料)</p> <p>第5条の4 (略)</p> <p>2 各清算参加者のコラテラル手数料は、計算期日（3月、6月、9月及び12月末日（当該日が休業日（臨時休業日を除く。以下本項において同じ。）の場合には、その翌日（休業日を除く。））をいう。以下本項において同じ。）の翌日から次の計算期日までの期間（以下「計算期間」という。）ごとに当該各清算参加者について次の各号に掲げる費用を合計した額とする。</p> <p>(1) 国債証券の管理に係る費用 次の算式により算出される額 (各清算参加者が国債証券により当社に預託している清算基金等の額面金額の合計額を、一の計算期間において平均した額) × (当該計算期間の日数) / $365 \times 0.50 / 10,000$</p> <p>(2) 米国財務省証券の管理に係る費用 次の a から c までに掲げる算式により算出される額の合計額 a (各清算参加者が米国財務省証券により当社に預託している清算基金等の額面金額(当社が公示により定めるところにより円換算した額をいう。)の合計額を、一の計算期間において平均した額) × (当該計算期間の日数) / $365 \times 0.50 / 10,000$ b 計算期間における各月において次の算式により算出される額の合計額 (各月末日の経過時点において各清算参加者が米国財務省証券により当社に預託している清算基金等の額面金額の時価(当社が公示により定めるところにより算出し、円換算した額</p>	<p>(コラテラル手数料)</p> <p>第5条の4 (略)</p> <p>2 各清算参加者のコラテラル手数料は、計算期日（3月、6月、9月及び12月末日（当該日が休業日（臨時休業日を除く。以下本項において同じ。）の場合には、その翌日（休業日を除く。））をいう。以下本項において同じ。）の翌日から次の計算期日までの期間（以下「計算期間」という。）ごとに当該各清算参加者について次の各号に掲げる費用を合計した額とする。</p> <p>(1) 国債証券の管理に係る費用 次の算式により算出される額 (各清算参加者が国債証券により当社に預託している清算基金等の額面金額の合計額を、一の計算期間において平均した額) × (当該計算期間の日数) / $365 \times 0.11 / 10,000$</p> <p>(2) 米国財務省証券の管理に係る費用 次の a から c に掲げる算式により算出される額の合計額 a (各清算参加者が米国財務省証券により当社に預託している清算基金等の額面金額(当社が公示により定めるところにより円換算した額をいう。)の合計額を、一の計算期間において平均した額) × (当該計算期間の日数) / $365 \times 0.11 / 10,000$ b 計算期間における各月において次の算式により算出される額の合計額 (各月末日の経過時点において各清算参加者が米国財務省証券により当社に預託している清算基金等の額面金額の合計額) × (当該各月の日数) / $365 \times 0.8 / 10,000$</p>

をいう。) の合計額) × (当該各月の日数) /
365 × 1.0 / 10,000

c 次の算式により算出される額を当社が公示
により定めるところにより円換算した額

20米ドル × (各清算参加者が、清算基金等
について、当該計算期間において当社に米国財
務省証券の預託又は返戻の指図を行った回数)

(3) 金銭信託に係る費用（日本銀行の補完当座預金制度における当座預金への適用利率に負数が含まれることにより、当社が当該適用利率に応じた信託報酬を負担する場合に限る。）計算期間における各日において次の算式により算出される額の合計額

(当該日において各清算参加者が金銭により当社に預託している清算基金等の合計額のうち、信託業務を営む銀行への金銭信託の方法で保管されている金額であって、金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の取扱い第44条の2第1項第3号及び第4号並びに同条第2項に定める方法により運用されているものの合計額) × 1 / 365 × (当該負数の絶対値)

(4) (略)

(手数料の支払時期等)

第7条 (略)

2 清算参加者は、各計算期間において算出されるコラテラル手数料を、当該計算期間の末日の属する月の翌々月（当該計算期間の末日が3月、6月、9月又は12月の末日ではない場合には、当該計算期間の末日の属する月の翌月）20日（同日が当社営業日でない場合には、翌当社営業日）までに、消費税及び地方消費税相当額を加算して当社に支払うものとする。

3 (略)

c 10米ドル × (各清算参加者が、清算基金等について、当該計算期間において当社に米国財務省証券の預託又は返戻の指図を行った回数)

(3) 金銭信託に係る費用（日本銀行の補完当座預金制度における当座預金への適用利率に負数が含まれることにより、当社が当該適用利率に応じた信託報酬を負担する場合に限る。）計算期間における各日において次の算式により算出される額の合計額

(当該日において各清算参加者が金銭により当社に預託している清算基金等の合計額のうち、信託業務を営む銀行への金銭信託の方法で保管されている金額) × 1 / 365 × (当該負数の絶対値)

(4) (略)

(手数料の支払時期等)

第7条 (略)

2 清算参加者は、各計算期間において算出されるコラテラル手数料を、当該計算期間の末日の属する月の翌々月（当該計算期間の末日が3月、6月、9月又は12月の末日ではない場合には、当該計算期間の末日の属する月の翌月）20日（同日が当社営業日でない場合には、翌当社営業日）までに、消費税及び地方消費税相当額（第5条の4第2項第2号b及びcに掲げる費用に係るものを除く。）を加算して当社に支払うものとする。

3 (略)

付 則

- 1 この改正規定は、令和6年4月1日から施行する。
- 2 第5条の4第2項の規定にかかわらず、この改正規定施行前最後の計算期日は、この改正規定施行の日の前日とする。