

金利スワップ取引清算業務における金銭で預託を受けた清算預託金に付す利息の取扱い等の見直しに伴う
「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」等の一部改正について

I. 改正趣旨

当社の金利スワップ取引清算業務において、清算参加者及び清算委託者（以下「清算参加者等」という。）から金銭で預託を受けた清算預託金のうち信託銀行への信託設定により保管しているもの（以下「金銭担保」という。）に付す利息の額の予見性向上及び運用により生じた損失に係る清算参加者等の負担抑制等を行い、また、清算参加者の円貨建清算約定に係る清算手数料等について、清算拡大に伴う清算参加者間の清算手数料格差の是正や、より分かりやすい料金体系実現の観点等から見直しを行うため、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. 金銭で預託を受けた清算預託金に付す利息の取扱い等の見直し

(1) 金銭担保に付す利息の算出方法の変更

- ・ 当社が金銭担保に付す利息について、現在は、運用により生じた収益の合計額から一定の金額を控除した残額を、各清算参加者等が当社に預託した金銭担保の平均残高に応じて按分することによって算出することとしているが、所定の計算式によって算出する方法に変更する。
- ・ コラテラル手数料及び金銭担保に付す利息の額の算出を行うための計算期間について、現在の四半期から月次へ変更する。また、各月分として算出されたコラテラル手数料を当社へ支払う時期について、各月の翌月20日までに支払うものとする取扱いに変更する。

(2) 運用により生じた損失の補填に充てる準備金の積立等

- ・ 当社は金銭担保の運用により生じた損失について、清算参加者等の負担を抑制する観点から、当該損失の補填に充てる準備金（以下「金利スワップ運用損失準備金」という。）を積み立てる。
- ・ 運用により収益が生じた場合には、当該収益から1. (1)により算出された利息の額並びに運用に必要な費用及び手数料を控除した後の残額について当社が支払う税額を差し引いた金額を追加して積み立てる。
- ・ 当社は、金銭担保の運用により損失が生じた場合には、金利スワップ運用損失準備金を取り崩すことによりこれを補填する。金利スワップ運用損失準備金の取り崩しによってもなお補填し得ない損失額がある場合は、当該額を当社が定める時点において当社に預託している金銭担保残高に応じて按分した額を、清算参加者等は負担するものとする。

(備 考)

- ・ 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（以下「IRS業務方法書の取扱い」という。）第44条の3第1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（以下「IRS手数料規則」という。）第5条の4等
- ・ IRS業務方法書の取扱い第44条の3第6項等

(3) 清算委託者に係る利息の取扱い

- ・ 当社が清算委託者に係る利息として受託清算参加者に支払う金額について、当該受託清算参加者は利息として受領した金銭の全部を当該清算委託者に支払うものとする取扱いに加えて、受託清算参加者と清算委託者との間であらかじめ合意した方法により、利息の額を取り扱うことができるものとする。
- ・ 金銭担保の運用により損失が生じ、1. (2) に定める金利スワップ運用損失準備金の取り崩しによってもなお補填しえない損失額がある場合において、受託清算参加者と清算委託者との間であらかじめ合意した方法により利息の額を取り扱っているときは、清算委託者が預託した金銭担保残高に応じた損失額についても受託清算参加者が負担するものとする。

- ・ I R S 業務方法書の取扱い第 4 4 条の 3 第 4 項等
- ・ 金利スワップ清算受託契約書第 1 1 条等

2. 清算手数料等の見直し

(1) 円貨建清算約定に係る清算手数料の見直し

- ・ 株主清算参加者以外の清算参加者に係る新規債務負担手数料、及び債務負担済残存取引手数料の算出方法について見直しを行う。

- ・ I R S 手数料規則第 4 条第 2 項第 2 号

(2) コンプレッションにより成立する清算約定に係る清算手数料の見直し

- ・ 各種コンプレッションにより成立する清算約定について新規債務負担手数料の算出対象外とする。

- ・ I R S 手数料規則第 4 条第 5 項等

(3) 取引報告手数料の廃止

- ・ 清算参加者へ請求する取引報告手数料を廃止する。

- ・ I R S 手数料規則第 5 条の 8 等

(4) 株主清算参加者の基本料及び円貨建清算約定に係る清算手数料に関する特則の見直し

- ・ 株主清算参加者の基本料及び円貨建清算約定に係る清算手数料に関する特則に定める「自己取引上限額」、「委託取引上限額」についてそれぞれ 1 億 1, 2 4 0 万円、5, 0 0 0 万円とする。

- ・ I R S 手数料規則第 6 条

3. その他

- ・ その他、所要の改正を行う。

Ⅲ. 施行日

2 0 2 6 年 4 月 1 日から施行する。

※ただし、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社が設置するシステムの稼働に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、2 0 2 6 年 4 月 1 日以後の当社が定める日から施行する。

以 上

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の一部改正新旧対照表

目 次

	(ページ)
1. 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	1
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の一部改正新旧対照表	6

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
<p>(当社が指定する通貨)</p> <p>第2条の2 (略)</p> <p><u>2 前項の規定にかかわらず、当初証拠金のうちカスタマーバッファに区分されるものについては、業務方法書第2条第1項第50号に規定する当社が指定する通貨は定めないものとする。</u></p> <p>(清算預託金の運用により生じた収益又は損失の取扱い)</p> <p>第44条の3 業務方法書第87条第4項に規定する利息は、<u>次の各号に掲げる清算預託金の資産区分に応じて、各月における各日において当該各号に定める算式により算出した額を合計した額とする。</u></p> <p><u>(1) 金銭(日本円に限る。以下本号において同じ。)</u> 当該日において各清算参加者及び各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(第44条第3項の規定に従い日本銀行に開設された当社名義の当座預金口座への預金により保管されているものを除く。)の合計額×<u>当社が公示により定めるところにより算出する利率(日本円)／365</u></p> <p><u>(2) 金銭(米ドルに限る。以下本号において同じ。)</u> 当該日において各清算参加者及び各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の合計額×<u>当社が公示により定めるところにより算出する利率(米ドル)／360</u></p> <p>2 当社は、前項の規定により算出された利息のう</p>	<p>(当社が指定する通貨)</p> <p>第2条の2 (略)</p> <p>(新設)</p> <p>(清算預託金の運用により生じた収益又は損失の取扱い)</p> <p>第44条の3 業務方法書第87条第4項に規定する利息は、<u>運用により生じた収益の合計額から当社が公示により定める金額を控除した残額を、各清算参加者及び各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(第44条第3項の規定に従い日本銀行に開設された当社名義の当座預金口座への預金により保管されているものを除く。)</u>の合計額を当社が公示により定める期間において平均した額に応じて按分した額とする。<u>この場合において、利息の計算は、当該金銭により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の通貨の種類ごとに行う。</u></p> <p>(新設)</p> <p>(新設)</p> <p>2 当社は、前項の規定により算出された利息を各</p>

ち、清算参加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係るものについては、各清算参加者に支払うものとする。

3 当社は、第1項の規定により算出された利息のうち、清算委託者が金銭により当社に預託している当初証拠金に係るものについては、当該清算委託者が有価証券等清算取次ぎの委託を行っている受託清算参加者に支払うものとし、当該受託清算参加者は当該利息の全部を当該清算委託者に支払うものとする。

4 前項の規定にかかわらず、受託清算参加者は、同項の規定により当社から受領した清算委託者が金銭により当社に預託している当初証拠金に係る利息の取扱いについて、当該受託清算参加者に有価証券等清算取次ぎの委託を行っている全ての清算委託者との間であらかじめ別段の合意をした場合には、当該合意の定めるところにより当該利息を取り扱うことができる。この場合においては、当該受託清算参加者は、当社が公示により定めるところにより、あらかじめ当社に届け出なければならない。

5 受託清算参加者は、前項の規定による利息の取扱いを取りやめようとするときは、当社が公示により定めるところにより、あらかじめ当社に届け出なければならない。

6 当社は、運用により収益が生じた場合には、次の各号に掲げる清算預託金の資産区分に応じて、当該各号に定める額を、運用により生じた損失の補填に充てるための準備金（以下「金利スワップ運用損失準備金」という。）として積み立てる。

（1） 金銭（日本円に限る。）

運用により生じた収益から第1項の規定により算出された利息の額並びに運用に必要な費用及び手数料を控除した後の残額について当社が支払う税額を差し引いた額

（2） 金銭（米ドルに限る。）

清算参加者及び各清算委託者に支払うものとする。このうち、清算委託者に係る利息については、当該清算委託者が有価証券等清算取次ぎの委託を行っている受託清算参加者に支払うものとし、当該受託清算参加者は、当社から清算委託者に係る利息として受領した金銭の全部を当該清算委託者に前項の規定により算出された利息として支払うものとする。

（新設）

（新設）

（新設）

（新設）

運用により生じた収益から第1項の規定により算出された利息の額並びに運用に必要な費用及び手数料を控除した後の残額について当社が支払う税額を差し引いた額を日本円に換算したうえで、両替した際に要した費用を控除した後の残額

7 当社は、運用により損失が生じた場合には、金利スワップ運用損失準備金の積立額を取り崩すことにより補填する。

8 業務方法書第87条第5項に規定する各清算参加者及び各清算委託者が負担する額は、前項に定めるところによってもなお補填し得ない損失額を当社が公示により定める日時における当該各清算参加者及び各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（第44条第3項の規定に従い日本銀行に開設された当社名義の当座預金口座への預金により保管されているものを除く。）の合計額に応じて按分した額とする。この場合において、各清算参加者及び各清算委託者が負担する額の計算は、当該金銭により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の通貨の種類ごとに行う。

9 業務方法書第87条第6項に規定する当社の定める方法は、前項の規定により算出された各清算参加者及び各清算委託者が負担する損失の額を、同項に定める日時における当該各清算参加者及び各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（第44条第3項の規定に従い日本銀行に開設された当社名義の当座預金口座への預金により保管されているものを除く。）の額に応じて按分し、当該按分後の損失の額を当該金銭により当社に預託された金利スワップ清算基金、当初証拠金及び破綻時証拠金から充当する方法（当該金利スワップ清算基金、当初証拠金及び破綻時証拠金が負担する損失の額に不足する場合には、当該不足分を別途当社に支払う方法）とする。

10 第8項の規定にかかわらず、第4項に規定する届出を行った受託清算参加者については、当該受託清算参加者に有価証券等清算取次ぎの委託を

(新設)

3 業務方法書第87条第5項に規定する各清算参加者及び各清算委託者が負担する額は、損失額を当社が公示により定める日時における当該各清算参加者及び各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（第44条第3項の規定に従い日本銀行に開設された当社名義の当座預金口座への預金により保管されているものを除く。）の合計額に応じて按分した額とする。この場合において、各清算参加者及び各清算委託者が負担する額の計算は、当該金銭により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の通貨の種類ごとに行う。

4 業務方法書第87条第6項に規定する当社の定める方法は、前項の規定により算出された各清算参加者及び各清算委託者が負担する損失の額を、前項に定める日時における当該各清算参加者及び各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の額に応じて按分し、当該按分後の損失の額を当該金銭により当社に預託された金利スワップ清算基金、当初証拠金及び破綻時証拠金から充当する方法とする。

(新設)

行っている清算委託者が金銭により当社に預託している当初証拠金（第44条第3項の規定に従い日本銀行に開設された当社名義の当座預金口座への預金により保管されているものを除く。）の額を、当該受託清算参加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（同項の規定に従い日本銀行に開設された当社名義の当座預金口座への預金により保管されているものを除く。）の合計額に含めて、業務方法書第87条第5項に規定する各清算参加者及び各清算委託者が負担する額を計算するものとする。

付 則

- 1 この改正規定は、令和8年4月1日から施行する。
- 2 改正後の第44条の3第4項に規定する届出については、この改正規定の施行前においても、同項の規定の例により、行うことができる。
- 3 第1項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社が設置するシステムの稼働に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、令和8年4月1日以後の当社が定める日から施行する。

様式第3号 清算受託契約の様式（日本語）

金利スワップ清算受託契約書

（当初証拠金の預託義務）

第11条 （略）

2 （略）

- 3 当初証拠金には、クリアリング機構が業務方法書等（甲乙間に別段の合意がある場合にあつては、当該合意）の定めるところにより利息を付することができるものとする。

（差換預託）

第16条 （略）

2 （略）

様式第3号 清算受託契約の様式（日本語）

金利スワップ清算受託契約書

（当初証拠金の預託義務）

第11条 （略）

2 （略）

- 3 当初証拠金には、クリアリング機構が業務方法書等の定めるところにより利息を付することができるものとする。

（差換預託）

第16条 （略）

2 （略）

3 委託当初証拠金には、甲が当初証拠金と同様の利率により利息を付すものとする。ただし、甲乙間に別段の合意がある場合は、この限りでない。

様式第3号の2 清算受託契約の様式（英語）

Interest Rate Swap Clearing Brokerage Agreement

Article 11 Obligation to Deposit Initial Margin

1・2 (Omitted)

3 JSCC may pay interest on Initial Margin in the manner as set forth in the Rules. If Party A and Party B separately agree otherwise regarding interest on Initial Margin, Party A may pay interest on the Initial Margin at the interest rate under such agreement to Party B.

Article 16. Substitute Deposit

1・2 (Omitted)

3 Party A shall pay interest on the Customer Initial Margin accrued at the same interest rate as that applied for the calculation of interest on Initial Margin, unless Party A and Party B separately agree otherwise regarding interest on the Customer Initial Margin.

3 委託当初証拠金には、甲が当初証拠金と同様の利率により利息を付すものとする。

様式第3号の2 清算受託契約の様式（英語）

Interest Rate Swap Clearing Brokerage Agreement

Article 11 Obligation to Deposit Initial Margin

1・2 (Omitted)

3 JSCC may pay interest on Initial Margin in the manner as set forth in the Rules.

Article 16. Substitute Deposit

1・2 (Omitted)

3 Party A shall pay interest on the Customer Initial Margin accrued at the same interest rate as that applied for the calculation of interest on Initial Margin.

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>(目的)</p> <p>第1条 (略)</p> <p>2 本規則において使用する用語は、本規則に別段の定めがある場合を除き、業務方法書において使用する用語の例によるほか、次の各号に掲げる用語の意義は、それぞれ当該各号に定めるところによる。</p> <p>(1)～(5) (略)</p> <p>(削る)</p> <p>(削る)</p> <p>(削る)</p> <p>(手数料の種類)</p> <p>第2条 業務方法書第16条に規定する当社が定め</p>	<p>(目的)</p> <p>第1条 (略)</p> <p>2 本規則において使用する用語は、本規則に別段の定めがある場合を除き、業務方法書において使用する用語の例によるほか、次の各号に掲げる用語の意義は、それぞれ当該各号に定めるところによる。</p> <p>(1)～(5) (略)</p> <p><u>(5)の2 「取引情報蓄積機関報告清算約定(IRS)」とは、金利スワップ取引清算業務に係る清算約定のうち、取引情報蓄積機関(金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第156条の6第1項に規定する取引情報蓄積機関をいう。)に対し、その当事者(清算約定(委託分)にあつては、当該清算約定(委託分)に係る清算委託取引の当事者である清算委託者)、想定元本その他の情報についての報告が行われたものをいう。</u></p> <p><u>(6) 「香港TR報告清算約定」とは、清算約定のうち、Hong Kong Monetary Authorityに対し、その当事者(清算約定(委託分)にあつては、当該清算約定(委託分)に係る清算委託取引の当事者である清算委託者)、想定元本その他の情報についての報告が行われたものをいう。</u></p> <p><u>(7) 「SDR報告清算約定(IRS)」とは、清算約定のうち、Swap Data Repository(U. S. Commodity Exchange Act Section 1a(48)に規定するSwap Data Repositoryをいう。)に対し、その当事者(清算約定(委託分)にあつては、当該清算約定(委託分)に係る清算委託取引の当事者である清算委託者)、想定元本その他の情報についての報告が行われたものをいう。</u></p> <p>(手数料の種類)</p> <p>第2条 業務方法書第16条に規定する当社が定め</p>

る手数料は、基本料、円貨建清算約定及び外貨建清算約定に係る清算手数料、コンプレッション手数料、クライアント・クリアリング手数料、口座開設手数料、外貨決済手数料、クロスマージン手数料、ポジション移管手数料並びにコラテラル手数料とする。

(円貨建清算約定に係る清算手数料)

第4条 (略)

2 各月の円貨建清算約定に係る新規債務負担手数料及び債務負担済残存取引手数料は、それぞれ、次の各号に掲げる清算参加者の区分に応じ当該各号に定める金額を自己取引口座及び委託取引口座(クライアント・クリアリングに係る委託取引口座を除く。)ごとに算出した金額の総額とする。

(1) (略)

(2) 前号に掲げる清算参加者以外の清算参加者

a 円貨建清算約定に係る新規債務負担手数料
当該各月の属する計算年度に成立した円貨建清算約定の累計件数に応じ、各月に成立した円貨建清算約定ごとに、次に掲げる金額の総額

(a) 当該計算年度に成立した円貨建清算約定の累計件数が2,000件までの部分
1件あたり6,000円

(b) 当該計算年度に成立した円貨建清算約定の累計件数が2,000件を超え、10,000件までの部分 1件あたり2,000円

(c) 当該計算年度に成立した円貨建清算約定の累計件数が10,000件を超える部分 1件あたり500円

b 円貨建清算約定に係る債務負担済残存取引手数料

当該各月末日の経過時点で残存する円貨建清算約定の件数に応じ、当該残存する円貨建清算約定ごとに、次に掲げる金額の総額

(a) 円貨建清算約定の件数が、8,000件以下の部分 1件あたり550円

(b) 円貨建清算約定の件数が8,000

る手数料は、基本料、円貨建清算約定及び外貨建清算約定に係る清算手数料、コンプレッション手数料、クライアント・クリアリング手数料、口座開設手数料、外貨決済手数料、クロスマージン手数料、ポジション移管手数料、コラテラル手数料並びに取引報告手数料とする。

(円貨建清算約定に係る清算手数料)

第4条 (略)

2 各月の円貨建清算約定に係る新規債務負担手数料及び債務負担済残存取引手数料は、それぞれ、次の各号に掲げる清算参加者の区分に応じ当該各号に定める金額を自己取引口座及び委託取引口座(クライアント・クリアリングに係る委託取引口座を除く。)ごとに算出した金額の総額とする。

(1) (略)

(2) 前号に掲げる清算参加者以外の清算参加者

a 円貨建清算約定に係る新規債務負担手数料
当該各月に成立した円貨建清算約定ごとに、1件あたり8,000円

(新設)

(新設)

(新設)

b 円貨建清算約定に係る債務負担済残存取引手数料

当該各月末日の経過時点で残存する円貨建清算約定ごとに、1件あたり700円

(新設)

(新設)

件を超え、40,000件までの部分 1
件あたり200円

(c) 円貨建清算約定の件数が40,000
0件を超える部分 1件あたり135円

3・4 (略)

5 前各項 (第2項第1号a及び第2号aを除く。) の規定は、業務方法書第53条に規定する取引毎コンプレッション、同第53条の2に規定するクーポン・ブレンディング、同第53条の2の2に規定する一括コンプレッション、同第53条の2の3に規定する参加者提案型コンプレッション又は同第53条の2の4に規定するJSCC提案型コンプレッションにより清算約定が成立する場合の円貨建清算約定に係る清算手数料について準用する。

(外貨建清算約定に係る清算手数料)

第4条の2 (略)

2 (略)

3 前2項(前項第1号a及び第2号aを除く。) の規定は、業務方法書第53条に規定する取引毎コンプレッション、同第53条の2に規定するクーポン・ブレンディング、同第53条の2の2に規定する一括コンプレッション又は同第53条の2の3に規定する参加者提案型コンプレッションにより新たに清算約定が成立する場合の外貨建清算約定に係る清算手数料について準用する。

(クライアント・クリアリング手数料)

第5条の2 (略)

2～5 (略)

6 前各項 (第2項を除く。) の規定は、業務方法書第53条に規定する取引毎コンプレッション、同第53条の2に規定するクーポン・ブレンディング、同第53条の2の2に規定する一括コンプレッション、同第53条の2の3に規定する参加者提案型コンプレッション又は同第53条の2の4に規定するJSCC提案型コンプレッションにより清算約定が成立する場合のクライアント・クリアリング手数料について準用する。

(新設)

3・4 (略)

5 前各項の規定は、業務方法書第53条に規定する取引毎コンプレッション、同第53条の2に規定するクーポン・ブレンディング、同第53条の2の2に規定する一括コンプレッション、同第53条の2の3に規定する参加者提案型コンプレッション又は同第53条の2の4に規定するJSCC提案型コンプレッションにより清算約定が成立する場合の円貨建清算約定に係る清算手数料について準用する。

(外貨建清算約定に係る清算手数料)

第4条の2 (略)

2 (略)

3 前各項の規定は、業務方法書第53条に規定する取引毎コンプレッション、同第53条の2に規定するクーポン・ブレンディング、同第53条の2の2に規定する一括コンプレッション又は同第53条の2の3に規定する参加者提案型コンプレッションにより新たに清算約定が成立する場合の外貨建清算約定に係る清算手数料について準用する。

(クライアント・クリアリング手数料)

第5条の2 (略)

2～5 (略)

6 前各項の規定は、業務方法書第53条に規定する取引毎コンプレッション、同第53条の2に規定するクーポン・ブレンディング、同第53条の2の2に規定する一括コンプレッション、同第53条の2の3に規定する参加者提案型コンプレッション又は同第53条の2の4に規定するJSCC提案型コンプレッションにより清算約定が成立する場合のクライアント・クリアリング手数料について準用する。

(クライアント・クリアリング手数料に関する特
則)

第5条の2の2 (略)

2～7 (略)

8 前各項(第2項及び第5項を除く。)の規定は、業務方法書第53条に規定する取引毎コンプレッション、同第53条の2に規定するクーポン・ブレンディング、同第53条の2の2に規定する一括コンプレッション、同第53条の2の3に規定する参加者提案型コンプレッション又は同第53条の2の4に規定するJSCC提案型コンプレッションにより、クライアント・クリアリングに係る清算約定が成立し届出委託取引口座に記録される場合の当該清算約定に関するクライアント・クリアリング手数料について準用する。

(コラテラル手数料)

第5条の4 (略)

2 各清算参加者の各月のコラテラル手数料は、次の各号に掲げる費用を合計した額とする。

(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、各月において平均した額) × (当該各月の日数) / 365 × 0.50 / 10,000

(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、各月において平均した額) × (当該各月の日数) / 365 ×

(クライアント・クリアリング手数料に関する特
則)

第5条の2の2 (略)

2～7 (略)

8 前各項の規定は、業務方法書第53条に規定する取引毎コンプレッション、同第53条の2に規定するクーポン・ブレンディング、同第53条の2の2に規定する一括コンプレッション、同第53条の2の3に規定する参加者提案型コンプレッション又は同第53条の2の4に規定するJSCC提案型コンプレッションにより、クライアント・クリアリングに係る清算約定が成立し届出委託取引口座に記録される場合の当該清算約定に関するクライアント・クリアリング手数料について準用する。

(コラテラル手数料)

第5条の4 (略)

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。

(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 × 0.50 / 10,000

(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

0.50/10,000

b (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、清算基金等に関して、当該各月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。)各月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)

第5条の6から第5条の8まで 削除

数)/365×0.50/10,000

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、清算基金等に関して、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)

第5条の6及び第5条の7 削除

(取引報告手数料)

第5条の8 各月の取引報告手数料は、次の各号に掲げる清算約定の区分に応じて、当該各号に定める金額とする。

(1) 取引情報蓄積機関報告清算約定(IRS) 次の算式により算出される額

(取引情報蓄積機関報告清算約定(IRS)の件数に応じた手数料相当額の総額として当社

(株主清算参加者の基本料及び円貨建清算約定に係る清算手数料に関する特則)

第6条 株主清算参加者が一の計算年度(清算参加者が当該計算年度の途中で株主清算参加者となり又は株主清算参加者でなくなった場合には、当該計算年度のうち当該清算参加者が株主清算参加者であった期間)において負担する基本料及び円貨建清算約定に係る清算手数料(清算約定(委託分)に係る清算手数料を除く。)の総額の上限(以下「自己取引上限額」という。)は、1億1,240万円とする。

2 株主清算参加者が一の計算年度(清算参加者が当該計算年度の途中で株主清算参加者となり又は株主清算参加者でなくなった場合には、当該計算年度のうち当該清算参加者が株主清算参加者であった期間)において負担する清算約定(委託分)(円貨建清算約定に限り、クライアント・クリアリングに係る清算約定を除く。)に係る清算手数料の上限(以下「委託取引上限額」という。)は、当該清算約定(委託分)が記録されている委

が公示により定める金額) × (各清算参加者に係る取引情報蓄積機関報告清算約定(I R S)の残存件数として当社が公示により定める件数) / (取引情報蓄積機関報告清算約定(I R S)の総残存件数として当社が公示により定める件数)

(2) 香港T R報告清算約定 当該各月末日の経過時点で残存する香港T R報告清算約定ごとに、1件あたり4.5香港ドルを当社が公示により定めるところにより円換算した額

(3) SDR報告清算約定(I R S) 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

(SDR報告清算約定(I R S)の件数に応じた手数料相当額の総額として当社が公示により定める金額) × (各清算参加者に係るSDR報告清算約定(I R S)の残存件数として当社が公示により定める件数) / (SDR報告清算約定(I R S)の総残存件数として当社が公示により定める件数)

(株主清算参加者の基本料及び円貨建清算約定に係る清算手数料に関する特則)

第6条 株主清算参加者が一の計算年度(清算参加者が当該計算年度の途中で株主清算参加者となり又は株主清算参加者でなくなった場合には、当該計算年度のうち当該清算参加者が株主清算参加者であった期間)において負担する基本料及び円貨建清算約定に係る清算手数料(清算約定(委託分)に係る清算手数料を除く。)の総額の上限(以下「自己取引上限額」という。)は、1億240万円とする。

2 株主清算参加者が一の計算年度(清算参加者が当該計算年度の途中で株主清算参加者となり又は株主清算参加者でなくなった場合には、当該計算年度のうち当該清算参加者が株主清算参加者であった期間)において負担する清算約定(委託分)(円貨建清算約定に限り、クライアント・クリアリングに係る清算約定を除く。)に係る清算手数料の上限(以下「委託取引上限額」という。)は、当該清算約定(委託分)が記録されている委

託取引口座ごとに、5, 0 0 0 万円（当該計算年度の下半期に当社に開設された委託取引口座については、2, 5 0 0 万円）を上限とする。

3 清算参加者が計算年度の下半期に株主清算参加者となった場合において、当該清算参加者が当該計算年度のうち株主清算参加者であった期間において負担する基本料及び円貨建清算約定に係る清算手数料の上限は、前2項の規定にかかわらず、次に定めるとおりとする。

(1) 自己取引上限額 5, 6 2 0 万円

(2) 委託取引上限額 清算約定（委託分）（円貨建清算約定に限り、クライアント・クリアリングに係る清算約定を除く。）が記録されている委託取引口座ごとに2, 5 0 0 万円

（手数料の支払時期等）

第7条 清算参加者は、毎月分の基本料、円貨建清算約定及び外貨建清算約定に係る清算手数料、コンプレッション手数料、クライアント・クリアリング手数料、口座開設手数料、コラテラル手数料、外貨決済手数料、ポジション移管手数料並びにクロスマージン手数料の合計額を、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。

（削る）

（削る）

付 則

1 この改正規定は、令和8年4月1日から施行す

託取引口座ごとに、4, 0 0 0 万円（当該計算年度の下半期に当社に開設された委託取引口座については、2, 0 0 0 万円）を上限とする。

3 清算参加者が計算年度の下半期に株主清算参加者となった場合において、当該清算参加者が当該計算年度のうち株主清算参加者であった期間において負担する基本料及び円貨建清算約定に係る清算手数料の上限は、前2項の規定にかかわらず、次に定めるとおりとする。

(1) 自己取引上限額 5, 1 2 0 万円

(2) 委託取引上限額 清算約定（委託分）（円貨建清算約定に限り、クライアント・クリアリングに係る清算約定を除く。）が記録されている委託取引口座ごとに2, 0 0 0 万円

（手数料の支払時期等）

第7条 清算参加者は、毎月分の基本料、円貨建清算約定及び外貨建清算約定に係る清算手数料、コンプレッション手数料、クライアント・クリアリング手数料、口座開設手数料、外貨決済手数料、ポジション移管手数料並びにクロスマージン手数料の合計額を、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。

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 清算参加者は、毎月分の取引報告手数料を、翌々月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。

る。

- 2 前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社が設置するシステムの稼働に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、令和8年4月1日以後の当社が定める日から施行する。
- 3 令和8年4月20日に納入される基本料、円貨建清算約定及び外貨建清算約定に係る清算手数料並びに取引報告手数料並びに同年5月20日に納入される取引報告手数料については、改正後の規定にかかわらず、なお従前の例による。
- 4 改正後の第7条の規定にかかわらず、令和8年1月分から3月分までのコラテラル手数料は、令和8年4月20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。