

**債務負担成立判定に係る基準の一部見直し等に伴う
「金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書」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、新規債務負担の申込みに係る棄却抑制効果の向上を目的として、債務負担成立判定に係る基準の一部見直しを行うほか、清算参加者の利便性向上を目的とする対応等のため、金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書等について別紙のとおり所要の改正を行います。

II. 改正概要

1. 新規債務負担時の債務負担成立判定に係る基準の一部見直し

- ・ 新規債務負担の申込みに係る棄却抑制効果の向上を目的に、債務負担時所要証拠金に足りる額が当社に預託されていない場合であっても清算約定を成立させる債務負担成立判定基準のうち、想定元本に係る基準を撤廃します。
- ・ 受託清算参加者が自己取引口座及び委託取引口座について任意のグループを作成し、当社が定める債務負担時所要証拠金不足許容上限額の範囲内で、各グループに対する債務負担時所要証拠金不足許容額の割当てを可能とします。この場合、債務負担成立判定に係る債務負担時所要証拠金不足額が当該自己取引口座又は委託取引口座の属するグループの債務負担時所要証拠金不足許容額以下である場合には、債務負担を可能とします。

2. パッケージ取引に係る債務負担要件の変更

- ・ 債務負担の申込みに係る棄却抑制や利便性向上の観点から、パッケージ取引の債務負担要件のうち、パッケージ取引を構成する適格金利スワップ取引の当事者に係る要件については、当事者が各取引間で同一であること（当事者が清算委託者である場合はその受託清算参加者も同一であること）のみとし、その他当社が通知又は公示により定める要件については廃止します。

3. 一括コンプレッション成立要件の変更

- ・ 一括コンプレッションの申込みが行われる日において、当社が速やかに債務負担の申込みに係る通知の受領を再開する観点から、一括コンプレッションの成立要件である日中証拠金の預託確認の対象を「一括コンプレッションに参加する清算参加者」へ変更します。

（備 考）

- ・ 金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書（以下「IRS業務方法書」という。）第49条第1項等
- ・ 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28条第5項等
- ・ IRS業務方法書の取扱い第28条第1項
- ・ IRS業務方法書第53条の2の2第2項

4. トライパーティ担保管理サービスへの対応

- ・ 担保事務の負荷軽減や担保の効率利用を目的に、代用有価証券の預託及び管理方法として、トライパーティ担保管理サービスを用いる方法を追加します。
- ・ トライパーティ担保管理サービスにより預託された代用有価証券についてはコラテラル手数料の対象外とします。

- ・ I R S 業務方法書の取扱い
第 1 3 条第 1 項等
- ・ 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

5. その他

- ・ その他、所要の改正を行います。

Ⅲ. 施行日

2026 年 10 月 5 日から施行します。

(ただし、トライパーティ担保管理サービスへの対応については、
2026 年 10 月 5 日以後の当社が定める日から施行します。)

※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、2026 年 10 月 5 日以後の当社が定める日から施行します。

以 上

金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書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一部改正新旧対照表	1
2. 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
3. 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	1 2

金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の一部改正新旧対照表

新	旧
(債務負担による清算約定の成立) 第49条 当社は、適格金利スワップ取引の両当事者である清算参加者から前条第1項の申込みに係る通知を受領した場合には、その内容及び当該適格金利スワップ取引が当社の定める条件を満たすこと並びに当該清算参加者が当社の定める方法により算出する証拠金（以下「債務負担時所要証拠金」という。）を当社に預託又は交付していること（以下これらの事項を「債務負担要件」という。）を当社が定めるところにより確認し、当社が債務負担要件の充足を確認することができた場合には、当社が定める時点をもって、債務負担の対象となった適格金利スワップ取引の一方の当事者であった清算参加者（以下本条において「清算参加者X」という。）と当社の上に、当社の取引ポジションを当該適格金利スワップ取引において清算参加者Xの相手方当事者であった清算参加者（以下本条において「清算参加者Y」という。）と同一とする金利スワップ取引が成立し、清算参加者Yと当社の上に、当社の取引ポジションを清算参加者Xと同一とする金利スワップ取引が成立するものとする。ただし、債務負担要件のうち、債務負担時所要証拠金に足りる額が当社に預託又は交付されていない場合であっても、前条第1項の債務負担の申込みに係る通知を当社が受領した時点で、次の各号に掲げる基準を満たすときには、本項が規定する金利スワップ取引が成立するものとする。 (削る) <u>(1) 当該申込みに係る自己取引口座又は委託取引口座の属するグループ（当社が定める方法により清算参加者又は受託清算参加者が申告した自己取引口座及び委託取引口座</u>	(債務負担による清算約定の成立) 第49条 当社は、適格金利スワップ取引の両当事者である清算参加者から前条第1項の申込みに係る通知を受領した場合には、その内容及び当該適格金利スワップ取引が当社の定める条件を満たすこと並びに当該清算参加者が当社の定める方法により算出する証拠金（以下「債務負担時所要証拠金」という。）を当社に預託又は交付していること（以下これらの事項を「債務負担要件」という。）を当社が定めるところにより確認し、当社が債務負担要件の充足を確認することができた場合には、当社が定める時点をもって、債務負担の対象となった適格金利スワップ取引の一方の当事者であった清算参加者（以下本条において「清算参加者X」という。）と当社の上に、当社の取引ポジションを当該適格金利スワップ取引において清算参加者Xの相手方当事者であった清算参加者（以下本条において「清算参加者Y」という。）と同一とする金利スワップ取引が成立し、清算参加者Yと当社の上に、当社の取引ポジションを清算参加者Xと同一とする金利スワップ取引が成立するものとする。ただし、債務負担要件のうち、債務負担時所要証拠金に足りる額が当社に預託又は交付されていない場合であっても、前条第1項の債務負担の申込みに係る通知を当社が受領した時点で、次の各号に掲げる基準を満たすときには、本項が規定する金利スワップ取引が成立するものとする。 <u>(1) 当該申込みに係る適格金利スワップ取引の想定元本が、当社が定める金額未満であること。</u> <u>(2) 次のa又はbに掲げる区分に応じて、当該a又はbに定める基準を満たすこと。</u> <u>a 当該申込みに係る自己取引口座</u> <u>当該申込みをした清算参加者の自己取</u>

をもって構成されるグループをいう。以下本号において同じ。）に属するすべての取引口座に係る債務負担時所要証拠金不足額（当該申込みに係る取引口座が委託取引口座である場合であって、第84条の7第1項の規定により、当該委託取引口座にカスタマーバッファが充当可能と認められるときは、当該充当後の債務負担時所要証拠金不足額）の合計額が、当該グループに配賦された債務負担時所要証拠金不足許容額（当社が定める方法による清算参加者又は受託清算参加者の申告に基づき、当社が定める上限額の範囲内で各グループに配賦された金額をいう。）以下であること。

(2) (略)

(3) (略)

2～6 (略)

(清算約定の一括コンプレッション)

第53条の2の2 (略)

2 当社は、前項の規定により清算参加者から清算約定の一括コンプレッションの申込みを受けた場合において、当該清算約定及び一括コンプレッションにより新たに成立する清算約定が当社の定める条件を満たすこと並びに一括コンプレッションに参加する清算参加者が一括コンプレッションが成立したと仮定して算出する日中証拠金所要額について当社に預託又は交付していること（以下これらの事項を「一括コンプレッション成立要件」という。）を当社が定めるところにより確認するものとし、一括コンプレッション成立要件を満たしているときは、当社が当該確認を行った時点をも

引口座に係る債務負担時所要証拠金不足額が、当社が定める上限額（次のbに定める配賦がなされた場合には、配賦に伴う減少後の額。以下「債務負担時所要証拠金不足許容上限額」という。）以下であること。

b 当該申込みに係る委託取引口座

受託清算参加者が自己取引口座に係る債務負担時所要証拠金不足許容上限額から当該申込みに係る委託取引口座に配賦（受託清算参加者が当社が定める方法で申告することにより、当該受託清算参加者の自己取引口座に係る債務負担時所要証拠金不足許容上限額を、当該委託取引口座に配賦することをいう。）を行った場合であって、当該委託取引口座に係る債務負担時所要証拠金不足額（第84条の7第1項の規定により、当該委託取引口座にカスタマーバッファを充当可能な場合は、当該充当後の債務負担時所要証拠金不足額）が当該配賦を受けた上限額以下であること。

(3) (略)

(4) (略)

2～6 (略)

(清算約定の一括コンプレッション)

第53条の2の2 (略)

2 当社は、前項の規定により清算参加者から清算約定の一括コンプレッションの申込みを受けた場合において、当該清算約定及び一括コンプレッションにより新たに成立する清算約定が当社の定める条件を満たすこと並びにすべての清算参加者が一括コンプレッションが成立したと仮定して算出する日中証拠金所要額について当社に預託又は交付していること（以下これらの事項を「一括コンプレッション成立要件」という。）を当社が定めるところにより確認するものとし、一括コンプレッション成立要件を満たしているときは、当社が当該確認を行った時点をもって、当社及び当該清算参加者

って、当社及び当該清算参加者は、当該清算約定を終了させ、当該一括コンプレッションの申込みの内容に従い新たな清算約定を、清算約定（担保型）として成立させる。

3～7 （略）

（カスタマーバッファの利用）

第84条の7 清算委託者が、第54条又は第54条の2に規定するところにより有価証券等清算取次ぎの委託を行った場合において、債務負担時所要証拠金に足りる額が当社に預託又は交付されていないときであって、新規債務負担時カスタマーバッファ利用可能額が債務負担時所要証拠金不足額以上であるとき又は新規債務負担時カスタマーバッファ利用可能額が債務負担時所要証拠金不足額を下回る場合において、第49条第1項第1号から第3号までに掲げる基準を満たすときには、当社の定めるところにより、債務負担時所要証拠金不足額に当たる額（新規債務負担時カスタマーバッファ利用可能額が債務負担時所要証拠金不足額を下回る場合にあっては新規債務負担時カスタマーバッファ利用可能額に当たる額）のカスタマーバッファが当該清算委託者に係る委託取引口座に自動的に充当され、当社は、当該充当されたカスタマーバッファの額を預託額に含めて債務負担要件の充足を確認するものとする。

2～5 （略）

付 則

- 1 この改正規定は、令和8年10月5日から施行する。
- 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

は、当該清算約定を終了させ、当該一括コンプレッションの申込みの内容に従い新たな清算約定を、清算約定（担保型）として成立させる。

3～7 （略）

（カスタマーバッファの利用）

第84条の7 清算委託者が、第54条又は第54条の2に規定するところにより有価証券等清算取次ぎの委託を行った場合において、債務負担時所要証拠金に足りる額が当社に預託又は交付されていないときであって、債務負担時所要証拠金不足額から新規債務負担時カスタマーバッファ利用可能額に当たる額を控除した額が、第49条第1項第2号bに規定する上限額以下であるときには、当社の定めるところにより、債務負担時所要証拠金不足額に当たる額（新規債務負担時カスタマーバッファ利用可能額が債務負担時所要証拠金不足額を下回る場合にあっては新規債務負担時カスタマーバッファ利用可能額に当たる額）のカスタマーバッファが当該清算委託者に係る委託取引口座に自動的に充当され、当社は、当該充当されたカスタマーバッファの額を預託額に含めて債務負担要件の充足を確認するものとする。

2～5 （略）

が認める場合には、令和8年10月5日以後の 当社が定める日から施行する。	
---	--

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
(適格金利スワップ取引の要件) 第9条 業務方法書第2条第1項第47号に規定する当社が定める要件は、次に掲げるすべての要件(有価証券等清算取次ぎの委託に基づいて成立する清算参加者間の金利スワップ取引及び損失回避取引については、第1号を除くすべての要件)とする。ただし、第5号eからgまでに掲げる事項の取扱いは、当社が公示により定める。 (1)～(7) (略) (8) 契約期間が、次のa及びbに掲げる変動金利の決定方法の金利スワップ取引ごとに、当該a及びbに定める日数以上であること。 a (略) b <u>前a</u>に掲げる変動金利の決定方法以外の変動金利の決定方法 28日 (9)～(15) (略) (代用有価証券) 第13条 業務方法書第7条第1項に規定する当社が定める代用有価証券の代用価格は、別表1の「代用有価証券の種類」欄に掲げる有価証券の種類に応じて、同表の「時価」欄に掲げる時価に、同表の「時価に乗すべき率」欄の値を乗じた額(委託当初証拠金の代用有価証券の代用価格にあつては、当該額を超えない範囲内で受託清算参加者及び清算委託者が合意する額)とする。<u>ただし、次項第2号の2に規定する方法により預託される代用有価証券の代用価格は、トライパーティ担保管理サービスにおいて用いられる時価に、同表の「時価に乗すべき率」欄の値を乗じた額とする。</u> 2 業務方法書第7条第2項に規定する代用有価証券の預託の方法その他代用有価証券に関する事項は、次に定めるとおりとする。	(適格金利スワップ取引の要件) 第9条 業務方法書第2条第1項第47号に規定する当社が定める要件は、次に掲げるすべての要件(有価証券等清算取次ぎの委託に基づいて成立する清算参加者間の金利スワップ取引及び損失回避取引については、第1号を除くすべての要件)とする。ただし、第5号eからgまでに掲げる事項の取扱いは、当社が公示により定める。 (1)～(7) (略) (8) 契約期間が、次のa及びbに掲げる変動金利の決定方法の金利スワップ取引ごとに、当該a及びbに定める日数以上であること。 a (略) b <u>上記a</u>に掲げる変動金利の決定方法以外の変動金利の決定方法 28日 (9)～(15) (略) (代用有価証券) 第13条 業務方法書第7条第1項に規定する当社が定める代用有価証券の代用価格は、別表1の「代用有価証券の種類」欄に掲げる有価証券の種類に応じて、同表の「時価」欄に掲げる時価に、同表の「時価に乗すべき率」欄の値を乗じた額(委託当初証拠金の代用有価証券の代用価格にあつては、当該額を超えない範囲内で受託清算参加者及び清算委託者が合意する額)とする。 2 業務方法書第7条第2項に規定する代用有価証券の預託の方法その他代用有価証券に関する事項は、次に定めるとおりとする。

- (1) 国債証券の預託方法その他の取扱い
- a (略)
- b 清算参加者は、当社が定める事項を記載した書面を当社に提出し、あらかじめ当社の承認を得た場合には、前aに規定する国債証券の預託及び返戻を、代理人を通じて行い、受けることができる。この場合において、当該預託及び返戻は、日本銀行又はその下位機関に設けられた当該代理人名義の口座を通じて行うこととする。
- (2) アメリカ合衆国財務省証券の預託方法その他の取扱い
- a 清算参加者は、代用有価証券としてアメリカ合衆国財務省証券（以下「財務省証券」という。）を当社に預託しようとする場合（清算委託者の代理人として預託する場合を含む。）には、あらかじめ当社が通知により定めるところにより同意を得るものとする。
- b 清算参加者は、前aの規定に基づき財務省証券を当社に預託する場合（清算委託者の代理人として預託する場合を含む。）には、預託しようとする財務省証券について、当社が指定する銀行に設けられた当社名義の口座に振替を行うものとし、当社が通知により定めるところにより、その旨を当社に申告するものとする。この場合における口座振替（同一銀行内の口座振替である場合を除く。）は、アメリカ合衆国のFederal Reserve Communications Systemを通じて行うものとする。
- c 清算参加者は、代用有価証券として預託している財務省証券の返戻を求める場合（清算委託者の代理人として返戻を求める場合を含む。）には、当社が通知により定

- (1) 国債証券の預託方法その他の取扱い
- a (略)
- b 清算参加者は、当社が定める事項を記載した書面を当社に提出し、あらかじめ当社の承認を得た場合には、上記aに規定する国債証券の預託及び返戻を、代理人を通じて行い、受けることができる。この場合において、当該預託及び返戻は、日本銀行又はその下位機関に設けられた当該代理人名義の口座を通じて行うこととする。
- (2) アメリカ合衆国財務省証券の預託方法その他の取扱い
- a 清算参加者は、代用有価証券としてアメリカ合衆国財務省証券（以下「財務省証券」という。）を当社に預託する場合（清算委託者の代理人として預託する場合を含む。）には、預託の都度、あらかじめ当社が通知により定めるところにより同意を得るものとする。
- b 清算参加者は、前号の規定に基づき財務省証券を当社に預託する場合（清算委託者の代理人として預託する場合を含む。）には、預託しようとする財務省証券について、アメリカ合衆国ニューヨーク州ニューヨーク市に所在する銀行に設けられた当社名義の口座に、差入日の前日のアメリカ合衆国東部時間の午後2時までに振替を行うものとし、当該口座振替を行う日の午後4時までに、その旨を当社に通知するものとする。この場合における口座振替（同一銀行内の口座振替である場合を除く。）は、アメリカ合衆国のFederal Reserve Communications Systemを通じて行うものとする。
- c 清算参加者は、代用有価証券として預託している財務省証券の返戻を求める場合（清算委託者の代理人として返戻を求める場合を含む。）には、当該返戻を受けよう

めるところにより、その旨を当社に申告するものとする。

d (略)

(2) の 2 トライパーティ担保管理サービスを用いた代用有価証券の預託方法

清算参加者は、トライパーティ担保管理サービス（当社が公示により指定する会社（以下「トライパーティ担保管理サービス提供会社」という。）が提供するものに限る。以下同じ。）を用いて代用有価証券を預託する場合には、トライパーティ担保管理サービス提供会社に開設された当社名義の口座に対する振替により行うものとし、当社が通知により定めるところにより、その旨を当社に申告するものとする。

(3)・(4) (略)

(債務負担に係る条件等)

第 2 8 条 業務方法書第 4 9 条第 1 項に規定する当社が定める条件は、同項の適格金利スワップ取引が次に掲げる要件のすべて（有価証券等清算取次ぎの委託に基づいて成立する清算参加者間の適格金利スワップ取引にあつては、第 1 号に掲げる要件に限る。また、第 4 号及び第 5 号に掲げる要件にあつては、当該適格金利スワップ取引がパッケージ取引に属する場合に限る。）を満たすこととする。

(1) ～ (3) (略)

(4) パッケージ取引を構成する適格金利スワップ取引について、当事者が各取引間で同一であること。ただし、パッケージ取引を構成する適格金利スワップ取引について、当事者が清算委託者である場合は、当該清算委託者の受託清算参加者も同一であること。

(5) (略)

2 ～ 4 (略)

(削る)

とする日の午前 1 1 時までに、その旨を当社に通知するものとする。

d (略)

(新設)

(3)・(4) (略)

(債務負担に係る条件等)

第 2 8 条 業務方法書第 4 9 条第 1 項に規定する当社が定める条件は、同項の適格金利スワップ取引が次に掲げる要件のすべて（有価証券等清算取次ぎの委託に基づいて成立する清算参加者間の適格金利スワップ取引にあつては、第 1 号に掲げる要件に限る。また、第 3 号及び第 4 号に掲げる要件にあつては、当該適格金利スワップ取引がパッケージ取引に属する場合に限る。）を満たすこととする。

(1) ～ (3) (略)

(4) パッケージ取引を構成する適格金利スワップ取引について、当事者が各取引間で同一であることその他当社が通知又は公示により定める要件を満たすこと。

(5) (略)

2 ～ 4 (略)

5 業務方法書第 4 9 条第 1 項第 1 号に規定する当社が定める金額は、別表 3 に定める金額とする。

5 業務方法書第49条第1項第1号に規定する当社が定める上限額は、20億円とする。

6 業務方法書第49条第1項第1号に規定する当社が定める方法は、金利スワップ取引清算業務システムを用いる方法とし、当該申告の内容は、申告を行った日の翌当社営業日に反映されるものとする。

7 (略)

8 (略)

9 (略)

(清算預託金の管理)

第44条 業務方法書第87条第1項に規定する当社が定める方法は、次の各号に掲げる清算預託金(清算委託者が預託した当初証拠金を除く。)の資産区分に応じて、当該各号に定める方法とする。

(1)・(1)の2 (略)

(2) 国債証券

次に掲げる方法により当社の固有財産とは分別して保管し、清算参加者ごとに、清算預託金の種類に区分して帳簿により管理する。

a・b (略)

c トライパーティ担保管理サービス提供会社に開設された当社名義の口座への記録

(3) 財務省証券

次に掲げる方法により当社の固有財産、他の清算業務に係る預かり資産及び清算委託者の当初証拠金とは分別して保管し、清算参加者ごとに、清算預託金の種類に区分して帳簿により管理する。

a 当社が指定する銀行に開設された当社名義の口座への記録

b (略)

c トライパーティ担保管理サービス提供会社に開設された当社名義の口座への記録

6 業務方法書第49条第1項第2号aに規定する当社が定める上限額は、20億円とする。

7 業務方法書第49条第1項第2号bに規定する当社が定める方法は、金利スワップ取引清算業務システムを用いる方法とし、当該申告の内容は、申告を行った日の翌当社営業日に反映されるものとする。

8 (略)

9 (略)

10 (略)

(清算預託金の管理)

第44条 業務方法書第87条第1項に規定する当社が定める方法は、次の各号に掲げる清算預託金(清算委託者が預託した当初証拠金を除く。)の資産区分に応じて、当該各号に定める方法とする。

(1)・(1)の2 (略)

(2) 国債証券

次に掲げる方法により当社の固有財産とは分別して保管し、清算参加者ごとに、清算預託金の種類に区分して帳簿により管理する。

a・b (略)

(新設)

(3) 財務省証券

次に掲げる方法により当社の固有財産、他の清算業務に係る預かり資産及び清算委託者の当初証拠金とは分別して保管し、清算参加者ごとに、清算預託金の種類に区分して帳簿により管理する。

a アメリカ合衆国ニューヨーク州ニューヨーク市に所在する銀行に開設された当社名義の口座への記録

b (略)

(新設)

録

2 清算委託者（第6項に規定する清算委託者を除く。以下本項において同じ。）の当初証拠金に係る業務方法書第87条第1項に規定する当社が定める方法は、次の各号に掲げる清算委託者の当初証拠金の資産区分に応じて、当該各号に定める方法とする。

（1）～（2） （略）

（3） 財務省証券

次に掲げる方法により当社の固有財産、他の清算業務に係る預かり資産及び清算参加者が預託した清算預託金とは分別して保管し、清算委託者ごとに区分して帳簿により管理する。

a 当社が指定する銀行に開設された当社名義の口座への記録

b （略）

3～5 （略）

6 FCM清算参加者（U. S. C o m m o d i t y E x c h a n g e A c t に規定された F u t u r e s C o m m i s s i o n M e r c h a n t（以下「FCM」という。以下同じ。）である清算参加者をいう。）と清算受託契約を締結した清算委託者の当初証拠金に係る業務方法書第87条第1項に規定する当社が定める方法は、C F T C R e g u l a t i o n 1. 4 9に基づき信託業務を営む銀行への信託により当社の固有資産、他の清算業務に係る預かり資産、清算参加者が預託した清算預託金及び第2項の清算委託者が預託した当初証拠金とは分別して保管し、清算委託者ごとに区分して帳簿により管理する方法とする。

付 則

1 この改正規定は、令和8年10月5日から施行する。

2 前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当

2 清算委託者（第6項に規定する清算委託者を除く。以下本項において同じ。）の当初証拠金に係る業務方法書第87条第1項に規定する当社が定める方法は、次の各号に掲げる清算委託者の当初証拠金の資産区分に応じて、当該各号に定める方法とする。

（1）～（2） （略）

（3） 財務省証券

次に掲げる方法により当社の固有財産、他の清算業務に係る預かり資産及び清算参加者が預託した清算預託金とは分別して保管し、清算委託者ごとに区分して帳簿により管理する。

a アメリカ合衆国ニューヨーク州ニューヨーク市に所在する銀行に開設された当社名義の口座への記録

b （略）

3～5 （略）

6 FCM清算参加者（U. S. C o m m o d i t y E x c h a n g e A c t に規定された F u t u r e s C o m m i s s i o n M e r c h a n t（以下「FCM」という。以下同じ。）である清算参加者をいう。）と清算受託契約を締結した清算委託者の当初証拠金に係る業務方法書第87条第1項に規定する当社が定める方法は、C F T C R e g u l a t i o n 1. 4 9に基づき信託業務を営む銀行への信託により当社の固有資産、他の清算業務に係る預かり資産、清算参加者が預託した清算預託金及び前項の清算委託者が預託した当初証拠金とは分別して保管し、清算委託者ごとに区分して帳簿により管理する方法とする。

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10月5日以後の当社が定める日から施行する。

- 3 前2項の規定にかかわらず、改正後の第13条第1項ただし書及び第2項第2号の2並びに第44条第1項第2号c及び第3号cの規定は、令和8年10月5日以後の当社が定める日から施行する。

(削る)

別表3 債務負担に係る条件等に係る想定元本の金額

取引の残存日数			想定元本 (億円)
より大きい		以下	
い			
二	≒	46	6,400
46	≒	107(3 か月)	2,100
107(3 か月)	≒	198(6 か月)	1,200
198(6 か月)	≒	381(1 年)	1,100
381(1 年)	≒	746(2 年)	460
746(2 年)	≒	1,842 (5年)	240
1,842 (5年)	≒	3,668 (10年)	170
3,668 (10年)	≒	10,973 (30年)	120
10,973 (30年)	≒	二	67

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 （差換預託） 第16条 第12条の規定にかかわらず、甲は、あらかじめ乙の書面による同意を得て、乙から交付を受けた金銭（日本円<u>及び業務方法書等の定めるところによりクリアリング機構が指定する通貨</u>に限る。）又は代用有価証券を委託当初証拠金として保管することができる。 2・3 （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 （差換預託） 第16条 第12条の規定にかかわらず、甲は、あらかじめ乙の書面による同意を得て、乙から交付を受けた金銭（日本円に限る。）又は代用有価証券を委託当初証拠金として保管することができる。 2・3 （略）
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 16. Substituted Deposit 1 Notwithstanding the provision of Article 12 of this Agreement, Party A may retain Japanese yen Cash, <u>Cash in a currency other than Japanese yen designated by JSCC in accordance with the Rules</u> or Eligible Securities Collateral delivered from Party B as Customer Initial Margin with the prior written consent of Party B. 2・3 (Omitted)	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 16. Substituted Deposit 1 Notwithstanding the provision of Article 12 of this Agreement, Party A may retain Japanese yen Cash or Eligible Securities Collateral delivered from Party B as Customer Initial Margin with the prior written consent of Party B. 2・3 (Omitted)

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
(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(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条第1項第2号b及び同条第2項第2号bに規定する方法により管理されているものに限る。))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(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条第1項第3号b及び同条第2項第3号bに規定する方法により管理されているものに限る。以下本号において同じ。))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 × 0.50 / 10,000 b・c (略) (3)・(4) (略) 付 則 この改正規定は、令和8年10月5日以後の当社が定める日から施行する。	(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 × 0.50 / 10,000 b・c (略) (3)・(4) (略)