

## 取引報告手数料の導入に伴う金利スワップ取引清算業務に係る手数料に関する規則等 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関し、当社は、各国の取引報告規制の内容に従い、米国では Swap Data Repository (以下「SDR」という。)である DTCC Data Repository (U. S. ) LLC(以下「DTCC」という。)に対し、また、香港では Hong Kong Monetary Authority (以下「HKMA」という。)に対し、取引報告を行っているが、それぞれの報告先は、清算機関に対しても利用料の費用負担を求めている。これらに関する手数料を新たに導入すべく、金利スワップ取引清算業務に係る手数料に関する規則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. 取引報告手数料の導入

- ・ SDR 及び HKMA への取引報告に係る手数料として、取引報告に係る清算約定の件数に応じた手数料を定める。

#### 2. その他

- ・ 米国商品先物取引委員会による DCO (Derivatives Clearing Organization) としての登録免除範囲の拡大決定に伴う所要の改正を行う。

(備 考)

- ・ 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2条、第5条の8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第47条の4

### III. 施行日

2017年11月1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	2
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	4

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>(FCMの登録等に関する届出)</p> <p>第47条の2 (略)</p> <p>(1)・(2) (略)</p> <p>(3) 当該清算参加者がU. S. Person (U. S. Commodity Futures Trading Commission (以下「米国商品先物取引委員会」という。以下同じ。)が公表するInterpretive Guidance and Policy Statement regarding Compliance with Certain Swap Regulations (78 Fed. Reg. 45292 (July 26, 2013)) <u>IV.A.4.</u>に規定されるU. S. Personをいう。以下同じ。)に該当することとなる場合又は該当しなくなる場合</p> <p>(4) (略)</p>	<p>(FCMの登録等に関する届出)</p> <p>第47条の2 (略)</p> <p>(1)・(2) (略)</p> <p>(3) 当該清算参加者がU. S. Person (U. S. Commodity Futures Trading Commission (以下「米国商品先物取引委員会」という。以下同じ。)が公表するInterpretive Guidance and Policy Statement regarding Compliance with Certain Swap Regulations (78 Fed. Reg. 45292 (July 26, 2013)) <u>IV.A.1.</u>に規定されるU. S. Personをいう。以下同じ。)に該当することとなる場合又は該当しなくなる場合</p> <p>(4) (略)</p>
<p>(清算約定の内容等の報告)</p> <p>第47条の4 (略)</p> <p>2 当社は、米国商品先物取引委員会がU. S. Commodity Exchange Act Section 5b (h)の規定に基づき発行した <u>2017年5月15日付Amended Order of Exemption from Registration</u> (以下「<u>修正登録免除決定</u>」という。) (9) (a)の定めるところに従い、当社営業日ごとに、米国商品先物取引委員会に対し、U. S. Personの清算約定に関し、当初証拠金所要額、当初証拠金預託額、変動証拠金所要額その他の情報について報告を行うものとする。</p> <p>3 当社は、<u>修正登録免除決定</u> (9) (b)の定めるところに従い、四半期ごとに、米国商品先物取引委員会に対し、U. S. Personの清算約</p>	<p>(清算約定の内容等の報告)</p> <p>第47条の4 (略)</p> <p>2 当社は、米国商品先物取引委員会がU. S. Commodity Exchange Act Section 5b (h)の規定に基づき発行した <u>2015年10月26日付Order of Exemption from Registration</u> (以下「<u>登録免除決定</u>」という。) (9) (a)の定めるところに従い、当社営業日ごとに、米国商品先物取引委員会に対し、U. S. Personの清算約定に関し、当初証拠金所要額、当初証拠金預託額、変動証拠金所要額その他の情報について報告を行うものとする。</p> <p>3 当社は、<u>登録免除決定</u> (9) (b)の定めるところに従い、四半期ごとに、米国商品先物取引委員会に対し、U. S. Personの清算約定に</p>

定に関し、その想定元本その他の情報について報告を行うものとする。

4 当社は、修正登録免除決定（10）の定めるところに従い、Swap Data Repository（U. S. Commodity Exchange Act Section 1a（48）に規定するSwap Data Repositoryをいう。以下「SDR」という。）に対し、清算約定に関し、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報告を行うものとする。

5～9（略）

#### 付 則

この改正規定は、平成29年11月1日から施行する。

関し、その想定元本その他の情報について報告を行うものとする。

4 当社は、登録免除決定（10）の定めるところに従い、Swap Data Repository（U. S. Commodity Exchange Act Section 1a（48）に規定するSwap Data Repositoryをいう。以下「SDR」という。）に対し、清算約定に関し、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報告を行うものとする。

5～9（略）

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 (略)</p> <p>(1) ~ (5) (略)</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</u> <u>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。)</u> <u>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、LIBORライセンス手数料、<u>コラテラル手数料並びに取引報告手数料</u>とする。</p> <p><u>(取引報告手数料)</u></p> <p><u>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。</u></p> <p><u>(1) 香港TR報告清算約定 当該各月末日の</u></p>	<p>(目的)</p> <p>第1条 (略)</p> <p>2 (略)</p> <p>(1) ~ (5) (略)</p> <p>(新設)</p> <p>(新設)</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、LIBORライセンス手数料 <u>並びに</u> <u>コラテラル手数料</u>とする。</p> <p>(新設)</p>

経過時点で残存する香港TR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

(2) SDR報告清算約定(IRS) 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(IRS)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(IRS)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(IRS)の総残存件数として当社が公示により定める件数)

(手数料の支払時期等)

第7条(略)

2・3(略)

4 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。

付 則

この改正規定は、平成29年11月1日から施行する。

(手数料の支払時期等)

第7条(略)

2・3(略)

(新設)