

**金銭で預託を受けた清算預託金の保管方法の追加等に伴う
O T C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

現在、当社のO T Cデリバティブ清算業務(C D S清算業務及び金利スワップ取引清算業務)において、清算参加者等から金銭で預託を受けた清算預託金(以下「金銭担保」という。)について、その全額を信託銀行へ信託設定を行うことにより保管しているが、清算参加者等の選択により、日本銀行の当座預金口座への預金による保管を可能とするため、C D S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. 金銭担保の保管方法の追加

- ・金銭担保の保管方法について、決済性預金口座への預金及び信託銀行への信託設定による方法に加え、日本銀行の当座預金口座への預金による方法(以下「日銀保管」という。)を新たに追加する。
- ・日銀保管を希望する清算参加者及び清算委託者は、あらかじめ当社にその旨を届け出るものとする。
- ・日銀保管を利用できる金銭担保の額として、清算参加者又は清算委託者ごとに、上限額を設定する。

2. 信託銀行への信託設定により保管された金銭担保に係るコラテラル手数料の追加

- ・信託銀行への信託設定により保管された金銭担保につき当社が日本銀行の当座預金への適用利率に応じた追加信託報酬を負担する場合において、当該追加信託報酬に相当する額をコラテラル手数料に追加する。

(備 考)

- ・ C D S清算業務に関する業務方法書の取扱い第5 2条の2及び第5 2条の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第4 4条及び第4 4条の3等
- ・ C D S清算業務に係る手数料に関する規則(以下「C D S手数料規則」という。)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(以下「I R S手数料規則」という。)第5条の4

3. その他

- ・当社が信託銀行に対し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。
- ・その他所要の改正を行う。

- ・ C D S 手数料規則第 5 条の 2 及び第 6 条
- ・ I R S 手数料規則第 5 条の 4 及び第 7 条

Ⅲ. 施行日

2019年4月1日から施行する。

以 上

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新旧対照表

目 次

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
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
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
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

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>(清算預託金の管理)</p> <p>第52条の2 (略)</p> <p>2 (略)</p> <p>3 <u>前2項の規定にかかわらず、清算参加者又は清算委託者が届け出た場合には、CDS清算基金、当初証拠金及び破綻時証拠金として当該清算参加者又は清算委託者から預託を受けた金銭に係る業務方法書第88条第1項に規定する当社が定める方法は、日本銀行に開設された当社名義の当座預金口座（当社が指定するものに限る。）への預金により当社の固有資産及び他の清算業務に係る預かり資産とは分別して保管し、清算参加者又は清算委託者ごとに、清算預託金の種類に区分して帳簿により管理する方法とする。ただし、当該金銭の額が当社が通知又は公示により定める上限額を超える場合、当該上限額を超えた部分に係る金銭については、当社は、第1項第1号b又は第2項第1号bに掲げる方法により前2項の規定に従って分別して保管し、清算参加者又は清算委託者ごとに、清算預託金の種類に区分して帳簿により管理するものとする。</u></p> <p>4 <u>前項の規定は、当社が指定できる当座預金口座が存在しない場合には適用しない。</u></p> <p>5 <u>第3項の届出及びその取下げは、当社が公示又は通知により定めるところによりあらかじめ行うものとする。</u></p>	<p>(清算預託金の管理)</p> <p>第52条の2 (略)</p> <p>2 (略)</p> <p>(新設)</p> <p>(新設)</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52条の4 業務方法書第88条第4項に規定する利息は、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CDS清算基金、当初証拠金及び破綻時証拠金（第52条の2第3項の規定に従</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52条の4 業務方法書第88条第4項に規定する利息は、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CDS清算基金、当初証拠金及び破綻時証拠金の合計額を当社が公示により定</p>

<p><u>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。</p> <p>2 (略)</p> <p>3 業務方法書第88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CDS清算基金、当初証拠金及び破綻時証拠金(第52条の2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。</p> <p>4 (略)</p>	<p>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。</p> <p>2 (略)</p> <p>3 業務方法書第88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CDS清算基金、当初証拠金及び破綻時証拠金の合計額に応じて按分した額とする。</p> <p>4 (略)</p>
<p>付 則</p>	
<p>1 この改正規定は、平成31年4月1日から施行する。</p> <p>2 第52条の2第5項に規定する届出については、この改正規定の施行の前においても、本改正規則の例により、行うことができる。</p> <p>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、平成31年4月1日以後の当社が定める日から施行する。</p>	

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

新	旧
<p>(清算手数料)</p> <p>第3条 インデックスCDS取引に係る清算手数料は、次の各号に掲げる清算参加者の区分に応じ当該各号に掲げる金額の合計額とする。</p> <p>2・3 (略)</p> <p>(コラテラル手数料)</p> <p>第5条の2 コラテラル手数料は、清算参加者が当社にCDS清算基金、当初証拠金(清算約定(委託分)に係るものを含む。)及び破綻時証拠金(以下本条においてこれらを併せて「清算基金等」という。)として預託している代用有価証券の管理に係る費用、<u>CDS清算業務に関する業務方法書の取扱い第52条の2第1項第1号b及び同条第2項第1号bに規定する信託業務を営む銀行への金銭信託(以下「金銭信託」という。)</u>に係る費用、<u>その他清算基金等の管理に関して清算参加者の要望に応じたことにより当社が負担した費用に相当する額とする。</u></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</p>	<p>(清算手数料)</p> <p>第3条 インデックスCDS取引に係る清算手数料は、次の各号に掲げる清算参加者の区分に応じ当該各号に掲げる金額の合計額とする。<u>ただし、清算約定の基となった適格CDS取引が当社によるインデックスCDS取引に係る清算業務の開始前に成立したものである場合には、次の各号に掲げる清算参加者の区分にかかわらず、成立した清算約定ごとに、想定元本1億円あたり400円とする。</u></p> <p>2・3 (略)</p> <p>(コラテラル手数料)</p> <p>第5条の2 コラテラル手数料は、清算参加者が当社にCDS清算基金、当初証拠金(清算約定(委託分)に係るものを含む。)及び破綻時証拠金(以下本条においてこれらを併せて「清算基金等」という。)として預託している代用有価証券の管理に係る費用<u>その他清算基金等の管理に関して清算参加者の要望に応じたことにより当社が負担した費用に相当する額とする。</u></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<u>本項において</u>「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</p>

(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) / $365 \times 0.11 / 10,000$

(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) / $365 \times 0.8 / 10,000$

c 10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) × $1 / 365 \times$
(当該負数の絶対値)

(4) 前3号に掲げる費用のほか、清算基金等の管理に関して清算参加者の要望に応じたこ

(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) / (当該計算期間の属する計算年度の日数) × $0.16 / 10,000$

(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) / (当該計算期間の属する計算年度の日数) × $0.16 / 10,000$

b (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各月末日の経過時点における時価(当社が公示により定めるところにより算出する額をいう。)の合計額) × (当該各月の日数) / (当該計算期間の属する計算年度の日数) × $0.85 / 10,000$

c 15米ドル × (各清算参加者が、清算基金等に関して、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)

(新設)

(3) 前2号に掲げる費用のほか、清算基金等の管理に関して清算参加者の要望に応じたこ

とにより当社が負担した費用のうち、当該清算参加者の要望に係る額

(手数料の支払時期等)

第6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。)を加算して当社に支払うものとする。

(削除)

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。

付 則

- 1 この改正規定は、平成31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。
- 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、平成31年4月1日以後の当社が定める日から施行する。

とにより当社が負担した費用のうち、当該清算参加者の要望に係る額

(手数料の支払時期等)

第6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(第5条の2第2項第2号b及びcに掲げる費用を除く。)を、当該計算期間の末日の属する月の翌々月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。

3 前2項の規定にかかわらず、清算参加者は、第5条の2第2項第2号b及びcに掲げる各月のコラテラル手数料を、当該各月の3か月後の月の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、当社に支払うものとする。

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。

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>(清算預託金の管理)</p> <p>第44条 (略)</p> <p>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。</p> <p>(1)～(3) (略)</p> <p>3 <u>前2項の規定にかかわらず、清算参加者又は清算委託者が届け出た場合には、金利スワップ清算基金、当初証拠金及び破綻時証拠金として当該清算参加者又は清算委託者から預託を受けた金銭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、日本銀行に開設された当社名義の当座預金口座(当社が指定するものに限る。)への預金により当社の固有資産及び他の清算業務に係る預かり資産とは分別して保管し、清算参加者又は清算委託者ごとに、清算預託金の種類に区分して帳簿により管理する方法とする。ただし、当該金銭の額が当社が通知又は公示により定める上限額を超える場合、当該上限額を超えた部分に係る金銭については、当社は、第1項第1号b又は第2項第1号bに掲げる方法により前2項の規定に従って分別して保管し、清算参加者又は清算委託者ごとに、清算預託金の種類に区分して帳簿により管理するものとする。</u></p> <p>4 <u>前項の規定は、当社が指定できる当座預金口座が存在しない場合には適用しない。</u></p> <p>5 <u>第3項の届出及びその取下げは、当社が公示又は通知により定めるところによりあらかじめ行うものとする。</u></p> <p>6 (略)</p> <p>(清算預託金の運用)</p>	<p>(清算預託金の管理)</p> <p>第44条 (略)</p> <p>2 清算委託者(次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。</p> <p>(1)～(3) (略)</p> <p>(新設)</p> <p>(新設)</p> <p>(新設)</p> <p>3 (略)</p> <p>(清算預託金の運用)</p>

第44条の2 (略)

2 前条第6項に定める方法により管理されているもののうち、FCM清算参加者と清算受託契約を締結し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に関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、当該清算委託者の当初証拠金を信託している信託業務を営む銀行への普通預金により行うものとする。

(清算預託金の運用により生じた収益又は損失の取扱い)

第44条の3 業務方法書第87条第4項に規定する利息は、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。)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。

2 当社は、前項の規定により算出された利息を各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。

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。)

第44条の2 (略)

2 前条第3項に定める方法により管理されているもののうち、FCM清算参加者と清算受託契約を締結し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に関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、当該清算委託者の当初証拠金を信託している信託業務を営む銀行への普通預金により行うものとする。

(清算預託金の運用により生じた収益又は損失の取扱い)

第44条の3 業務方法書第87条第4項に規定する利息は、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。

2 当社は、前項の規定により算出された利息を各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。

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の合計額に応じて按分した額とする。

<p>の合計額に応じて按分した額とする。</p> <p>4 (略)</p> <p>平成27年10月26日改正付則</p> <p>1・2 (略)</p> <p>3 第1項及びその他付則にかかわらず、本規則第44条第6項、第44条の2第2項及び第47条の3の規定は、平成27年10月26日からDCO登録までの間は、これを適用しない。</p> <p>付 則</p> <p>1 この改正規定は、平成31年4月1日から施行する。</p> <p>2 第44条第5項に規定する届出については、この改正規定の施行の前においても、本改正規則の例により、行うことができる。</p> <p>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、平成31年4月1日以後の当社が定める日から施行する。</p>	<p>4 (略)</p> <p>平成27年10月26日改正付則</p> <p>1・2 (略)</p> <p>3 第1項及びその他付則にかかわらず、本規則第44条第3項、第44条の2第2項及び第47条の3の規定は、平成27年10月26日からDCO登録までの間は、これを適用しない。</p>
---	---

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 コラテラル手数料は、清算参加者が当社に金利スワップ清算基金、当初証拠金（清算約定（委託分）に係るものを含む。）及び破綻時証拠金（以下本条においてこれらを併せて「清算基金等」という。）として預託している代用有価証券の管理に係る費用、<u>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1号b及び同条第2項第1号bに規定する信託業務を営む銀行への金銭信託（以下「金銭信託」という。）</u>に係る費用、その他清算基金等の管理に関して清算参加者の要望に応じたことにより当社が負担した費用に相当する額とする。</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×<u>0.11</u>／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</p>	<p>(コラテラル手数料)</p> <p>第5条の4 コラテラル手数料は、清算参加者が当社に金利スワップ清算基金、当初証拠金（清算約定（委託分）に係るものを含む。）及び破綻時証拠金（以下本条においてこれらを併せて「清算基金等」という。）として預託している代用有価証券の管理に係る費用、その他清算基金等の管理に関して清算参加者の要望に応じたことにより当社が負担した費用に相当する額とする。</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×<u>0.16</u>／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</p>

数) / 365 × 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 × 0.8 / 10,000

c 10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) × 1 / 365 × (当該負数の絶対値)

(4) 前3号に掲げる費用のほか、清算基金等の管理に関して清算参加者の要望に応じたことにより当社が負担した費用のうち、当該清算参加者の要望に係る額

(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。

数) / 365 × 0.16 / 10,000

b (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各月末日の経過時点における時価(当社が公示により定めるところにより算出する額をいう。)の合計額) × (当該各月の日数) /

365 × 0.85 / 10,000

c 15米ドル × (各清算参加者が、清算基金等に関して、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)

(新設)

(3) 前2号に掲げる費用のほか、清算基金等の管理に関して清算参加者の要望に応じたことにより当社が負担した費用のうち、当該清算参加者の要望に係る額

(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(第5条の4第2項第2号b及びcに掲げる費用を除く。)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。

(削除)

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。

付 則

- 1 この改正規定は、平成31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。
- 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、平成31年4月1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、清算参加者は、第5条の4第2項第2号b及びcに掲げる各月のコラテラル手数料を、当該各月の3か月後の月の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、当社に支払うものとする。

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。