

CDS清算業務に係る手数料に関する規則

(目的)

第1条 このCDS清算業務に係る手数料に関する規則（以下「本規則」という。）は、株式会社日本証券クリアリング機構（以下「当社」という。）が制定したCDS清算業務に関する業務方法書（以下「業務方法書」という。）第16条の規定に基づき、当社がCDS清算業務について徴収する手数料に関し、必要な事項を定めることを目的とする。

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。

(手数料の種類)

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、清算手数料、コンプレッション手数料、アドホック・コンプレッション手数料、ポジション移管等手数料、クレジットイベント決済手数料、コラテラル手数料及び取引報告手数料とする。

(清算手数料)

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。

(1) 業務方法書第75条第1項の清算参加者（インデックスCDS取引に係る指定を受けた者に限る。）

成立した清算約定ごとに、想定元本1億円あたり700円

(2) 前号に掲げる清算参加者以外の清算参加者

成立した清算約定ごとに、想定元本1億円あたり800円

2 前項の金額の合計額が1か月あたり4,000万円を超える場合における当該月の清算手数料は4,000万円とし、当該合計額が1か月あたり10万円（当該月にCDS清算資格を取得した清算参加者については、10万円に当該月の全当社営業日の日数に占める当該清算参加者がCDS清算資格を取得した日以降の当該月の当社営業日の日数の割合を乗じて得た額とする。以下この項において同じ。）に満たない場合における当該月の清算手数料は10万円とする。

3 前項の規定は、業務方法書第76条の規定により清算参加者が業務方法書第16条の手数料に加算して当社に支払う手数料については、適用しない。

第3条の2 シングルネーム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。ただし、清算約定の基となった適格CDS取引が当社によるシングルネーム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2,400円とする。

(1) 業務方法書第75条第1項の清算参加者(シングルネームCDS取引に係る指定を受けた者に限る。)

成立した清算約定ごとに、想定元本1億円あたり4,200円

(2) 前号に掲げる清算参加者以外の清算参加者

成立した清算約定ごとに、想定元本1億円あたり4,800円

2 前項の金額の合計額が1か月あたり4,000万円を超える場合における当該月の清算手数料は4,000万円とし、当該合計額が1か月あたり10万円(当該月にCDS清算資格を取得した清算参加者については、10万円に当該月の全当社営業日の日数に占める当該清算参加者がCDS清算資格を取得した日以降の当該月の当社営業日の日数の割合を乗じて得た額とする。以下この項において同じ。)に満たない場合における当該月の清算手数料は10万円とする。

3 前項の規定は、業務方法書第76条の規定により清算参加者が業務方法書第16条の手数料に加算して当社に支払う手数料については、適用しない。

(コンプレッション手数料)

第4条 コンプレッション手数料は、業務方法書第53条に規定するコンプレッションにより終了した清算約定の組合せごとに、当社を売り手とする清算約定の想定元本の総額又は当社を買い手とする清算約定の想定元本の総額のうち小さい方の額(双方同額の場合は当該額。)に2を乗じた額1億円あたり600円とする。

(アドホック・コンプレッション手数料)

第4条の2 アドホック・コンプレッション手数料は、業務方法書第53条の2に規定するアドホック・コンプレッションにより終了した清算約定の組合せごとに、当社を売り手とする清算約定の想定元本の総額及び当社を買い手とする清算約定の想定元本の総額を合計した額1億円あたり600円とする。

(ポジション移管等手数料)

第4条の3 ポジション移管等手数料は、業務方法書第53条の4第2項の規定により承継が成立した清算約定(自己分)については当該清算約定(自己分)ごとに、同第58条の3第2項の規定により移管が成立した清算委託取引については当該清算委託取引に係る清算約定(委託分)ごとに、同第58条の5第2項の規定により移管が成立した清算約定(自己分)については当該清算約定(自己分)ごとに、想定元本1億円あたり600円とする。

(クレジットイベント決済手数料)

第5条 インデックスCDS取引に係るクレジットイベント決済手数料は、クレジットイベント決済の対象となる清算約定ごとに500円とする。

2 シングルネームCDS取引に係るクレジットイベント決済手数料は、クレジットイベ

ント決済の対象となる清算約定ごとに3,000円とする。

(コラテラル手数料)

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、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。)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。

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、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の合計額) × 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

(取引報告手数料)

第5条の3 各月の取引情報蓄積機関報告約定(CDS)に係る取引報告手数料は、次の算式により算出される額とする。

(取引情報蓄積機関報告清算約定(CDS)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取引情報蓄積機関報告清算約定(CDS)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(CDS)の総残存件数として当社が公示により定める件数)

2 各月のSDR報告清算約定(CDS)に係る取引報告手数料は、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金額とする。

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

3 第1項の「取引情報蓄積機関報告清算約定(CDS)」とは、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63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。

4 第2項の「SDR報告清算約定(CDS)」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。

(手数料の支払時期等)

第6条 清算参加者は、毎月分の清算手数料、コンプレッション手数料、アドホック・コンプレッション手数料、ポジション移管等手数料及びクレジットイベント決済手数料の合計額を、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。

付 則

本規則は、平成23年7月19日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成24年7月23日から施行する。

付 則

- 1 この改正規定は、平成26年2月24日(以下「施行日」という。)から施行する。
- 2 第5条の2第2項の規定にかかわらず、この改正規定施行後最初の計算期間は、施行日から平成26年3月31日までの期間とする。

付 則

この改正規定は、平成26年12月15日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成27年6月15日から施行する。

付 則

- 1 この改正規定は、平成28年3月9日から施行する。
- 2 この改正規定施行の日の前日までに当社が申入れを受けた任意解約に係る任意解約時清算手数料(改正前の本規則第4条に規定する任意解約時清算手数料をいう。)の取扱いについては、なお従前の例による。

付 則

この改正規定は、平成29年6月5日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成29年11月1日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成30年4月6日から施行する。

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。

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。