

CDS清算基金所要額に関する規則

(目的等)

第1条 このCDS清算基金所要額に関する規則(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17条の規定に基づき、CDS清算基金所要額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。

(CDS清算基金所要額)

第2条 各清算参加者に係るCDS清算基金所要額は、毎営業日、別表「CDS清算基金所要額の算出に関する表」により算出する額とする。ただし、当社は、当該清算参加者が合併する場合その他必要と認める場合に限り、CDS清算基金所要額を臨時に変更することができる。

2 前項の規定にかかわらず、新たにCDS清算資格を取得する者に係るCDS清算基金所要額は、当該者がCDS清算資格を取得した後のCDS取引の状況が前項の規定により算出されるCDS清算基金所要額に適正に反映される状況に至るまでの間、当該者の会社規模、取引実績及びその見込み、CDS清算資格の取得の申請を行った日において各清算参加者のCDS清算基金所要額を合計した額を清算参加者の総数で除して得た金額等を勘案のうえ、当社がその都度定める額とする。

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26年2月24日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成26年2月28日から施行する。

付 則

1 この改正規定は、平成30年9月25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が認める場合には、平成30年9月25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5年5月22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が認める場合には、令和5年5月22日以後の当社が定める日から施行する。

別表 CDS清算基金所要額の算出に関する表

- 1 各清算参加者に係るCDS清算基金所要額は、CDS清算基金算出日（CDS清算基金所要額の算出を行う日をいう。以下同じ。）におけるストレス時想定損失負担額又は1億円のうちいずれか大きい額とする。

- 2 前項に規定するストレス時想定損失負担額は、CDS清算基金算出日における清算参加者の担保超過リスク額（清算参加者に関係会社等（ある会社の子会社及び関連会社並びに当該ある会社の親会社、当該親会社の子会社及び当該親会社の関連会社をいう。）に該当する他の清算参加者が存在する場合には、当該他の清算参加者の担保超過リスク額を合計した額）が上位である清算参加者2社の担保超過リスク額の合計額を、当該CDS清算基金算出日における当該各清算参加者の当初証拠金所要額（当初証拠金所要額の引上げ措置を受けている清算参加者については、当該引上げ措置を行う前の当初証拠金所要額）に応じて按分した額とする。なお、「担保超過リスク額」とは、当該各清算参加者の当該CDS清算基金算出日における自己取引口座及び各委託取引口座（当社が業務方法書第59条第6項の規定により区分口座を設定している場合には、区分口座）ごとの清算約定に係るストレス時リスク相当額（CDS取引に係る価格の極端な変動により、当該清算約定から当該清算参加者に生じ得る損失に相当する額をいい、当社が通知により定める方法により算出するものをいう。）から当該清算参加者の当該当社営業日の当該自己取引口座及び各委託取引口座に係る当初証拠金所要額（当初証拠金所要額の引上げ措置を受けている清算参加者については、当該引上げ措置を行った後の当初証拠金所要額）又は当初証拠金預託額のうちいずれか小さい額を差し引いた額（当該額が負数となる場合は、0とする。）を、すべての当該自己取引口座及び各委託取引口座について合算した額をいう。