

取引報告手数料について

2017年11月1日

2019年4月1日改正

株式会社日本証券クリアリング機構

1. CDS清算業務に係る手数料に関する規則第5条の3に規定するSDR報告清算約定(CDS)の件数に応じた手数料相当額の総額は、次の算式により算出される金額とする。
(各月におけるDTCC通知金額) × (各月におけるSDR報告清算約定(CDS)の件数) / (各月におけるSDR報告清算約定(CDS)及びSDR報告清算約定(IRS)の合計件数)

なお、本項において、「SDR報告清算約定(IRS)」とは、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1条第2項第7号に規定するSDR報告清算約定(IRS)をいい、「DTCC通知金額」とは、以下の表に掲げるSDR報告清算約定(CDS)及びSDR報告清算約定(IRS)の合計件数の区分に応じて、当該合計件数に対して各区分に定める額を乗じて得た金額を合計した金額として、DTCC Data Repository (U.S.) LLC (以下「DTCC」という。)から当社に対し通知された金額をいう。

SDR報告清算約定(CDS)及び SDR報告清算約定(IRS)の合計件数	件数に乗じる額
100件以下の部分	0.875米ドル
101件以上-1,000件以下の部分	0.75米ドル
1,001件以上-5,000件以下の部分	0.625米ドル
5,001件以上-10,000件以下の部分	0.5625米ドル
10,001件以上-50,000件以下の部分	0.50米ドル
50,001件以上-200,000件以下の部分	0.3125米ドル
200,001件以上-500,000件以下の部分	0.10米ドル
500,001件以上の部分	0.025米ドル

2. CDS清算業務に係る手数料に関する規則第5条の3に規定する各清算参加者に係るSDR報告清算約定(CDS)の残存件数は、各月末日の経過時点で残存する各清算参加者に係るSDR報告清算約定(CDS)の件数に、当該各月に終了した当該各清算参加者に係るSDR報告清算約定(CDS)の件数を合算した件数として、DTCCから当社に対し通知された件数とする。

3. CDS 清算業務に係る手数料に関する規則第 5 条の 3 に規定する SDR 報告清算約定 (CDS) の総残存件数は、各月末日の経過時点で残存する SDR 報告清算約定 (CDS) の件数に、当該各月に終了した SDR 報告清算約定 (CDS) の件数を合算した件数として、DTCC から当社に対し通知された件数とする。

4. 各月の SDR 報告清算約定 (CDS) に係る取引報告手数料にあつては、当該各月の翌月の最終当社営業日の午後 3 時において、リフィニティブ・ジャパン株式会社及びブルームバーグ エル・ピーから公表されている東京外国為替市場の対顧客直物電信売相場及び買相場の 1 米ドル当たりの円貨額の仲値の平均値を用いて日本円に換算するものとする。

以 上