

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

2021年2月1日改正

2022年7月1日改正

2024年4月1日改正

株式会社日本証券クリアリング機構

1. 取引情報蓄積機関報告清算約定（CDS）に係る取引報告手数料に関する事項（CDS清算業務に係る手数料に関する規則第5条の3第1項関係）

(1) 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は、次の算式により算出される金額とする。

$$\frac{(\text{各月におけるDDR J通知金額}) \times (\text{各月における取引情報蓄積機関報告清算約定(CDS)の件数})}{(\text{各月における取引情報蓄積機関報告清算約定(CDS)及び取引情報蓄積機関報告清算約定(IRS)の合計件数})}$$

なお、本号において、「取引情報蓄積機関報告清算約定（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(5)の2に規定する取引情報蓄積機関報告清算約定（IRS）をいい、「DDR J通知金額」とは、取引情報蓄積機関報告清算約定（CDS）及び取引情報蓄積機関報告清算約定（IRS）の合計件数に応じて、DTCC データ・レポジトリ・ジャパン株式会社（以下「DDR J」という。）がその時点において有効な手数料体系に従って算出した金額（口座管理手数料を除く。）として、DDR Jから当社に対し通知された金額をいう。

(2) 各清算参加者に係る取引情報蓄積機関報告清算約定（CDS）の残存件数は、各月末日の経過時点で残存する各清算参加者に係る取引情報蓄積機関報告清算約定（CDS）の件数として、DDR Jから当社に対し通知された件数とする。

(3) 取引情報蓄積機関報告清算約定（CDS）の総残存件数は、各月末日の経過時点で残存する取引情報蓄積機関報告清算約定（CDS）の件数として、DDR Jから当社に対し通知された件数とする。

2. SDR報告清算約定（CDS）に係る取引報告手数料に関する事項（CDS清算業務に係る手数料に関する規則第5条の3第2項関係）

(1) 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、SDR報告清算約定(CDS)及びSDR報告清算約定(IRS)の合計件数に応じて、DTCC Data Repository (U.S.) LLC (以下「DTCC」という。)がその時点において有効な手数料体系に従って算出した金額として、DTCCから当社に対し通知された金額をいう。

(2) 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) 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