

CDS清算業務における手数料等の見直しに伴う
「CDS清算業務に係る手数料に関する規則」の一部改正について

I. 改正趣旨

当社のCDS清算業務において、清算参加者の利便性向上を目的とした手数料等の一部見直しに伴い、取引報告手数料の廃止及びコラテラル手数料に係る計算期間を変更するため、CDS清算業務に係る手数料に関する規則について別紙のとおり所要の改正を行う。

II. 改正概要

- ・清算参加者へ請求する取引報告手数料を廃止する。
- ・コラテラル手数料の算出を行うための計算期間について、現在の四半期から月次へ変更する。また、各月分として算出されたコラテラル手数料を当社へ支払う時期について、各月の翌月20日までに支払うものとする取扱いに変更する。

(備考)

- ・CDS清算業務に係る手数料に関する規則第2条等

III. 施行日

2026年4月1日から施行する。

※ただし、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、
2026年4月1日以後の当社が定める日から施行する。

以上

C D S 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
(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及びコラテラル手数料とする。	(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。
(コラテラル手数料) 第5条の2 (略) 2 各清算参加者の <u>各月</u> のコラテラル手数料は、次の各号に掲げる費用を合計した額とする。	(コラテラル手数料) 第5条の2 (略) 2 各清算参加者のコラテラル手数料は、 <u>計算期日</u> （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、 <u>各月</u> において平均した額) × (当該各月の日数) / 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、 <u>各月</u> において平均した額) × (当該各月の日数) / 365 × 0.50 / 10,000 b (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	(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、 <u>一の計算期間</u> 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、 <u>一の計算期間</u> において平均した額) × (当該計算期間の日数) / 365 × 0.50 / 10,000 b <u>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</u>

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）／ $365 \times 1.0 / 10,000$

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）

(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。）各月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）× $1 / 365 \times$ （当該負数の絶対値）

(4) (略)

(削る)

（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）／ $365 \times 1.0 / 10,000$

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）× $1 / 365 \times$ （当該負数の絶対値）

(4) (略)

(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)の件数）

D S) 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 S D R 報告清算約定 (C D S) 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。

(S D R 報告清算約定 (C D S) 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 S D R 報告清算約定 (C D S) の残存件数として当社が公示により定める件数) ÷ (S D R 報告清算約定 (C D S) 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 (C D S)」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）にあっては、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「S D R 報告清算約定 (C D S)」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）にあっては、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、クレジットイベント決済手数料及びコラテラル手数料の合計額を、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、

（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

<p>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。</p> <p>(削る)</p>	<p>相当額を加算して当社に支払うものとする。</p> <p><u>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。</u></p> <p><u>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。</u></p>
<p>付 則</p> <p>1 この改正規定は、令和8年4月1日から施行する。</p> <p>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8年4月1日以後の当社が定める日から施行する。</p> <p>3 令和8年4月20日及び同年5月20日に納入される取引報告手数料については、改正後の規定にかかわらず、なお従前の例による。</p> <p>4 改正後の第6条の規定にかかわらず、令和8年1月分から3月分までのコラテラル手数料は、令和8年4月20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。</p>	