

## 金利スワップ清算業務における口座体系

## 1. 債務負担取引の管理

JSCC による債務負担取引の管理は、MarkitWire から申し込まれた取引の場合は MarkitWire 上の BIC コードごとに設定する JSCC 口座にて、MarkitWire 以外のプラットフォームから申し込まれた取引の場合は「LEI+BookID」ごとに設定する JSCC 口座にて管理します（詳細は以下のイメージ図を参照）。

## (1) MarkitWire を使用する場合

## &lt;第1階層口座&gt;

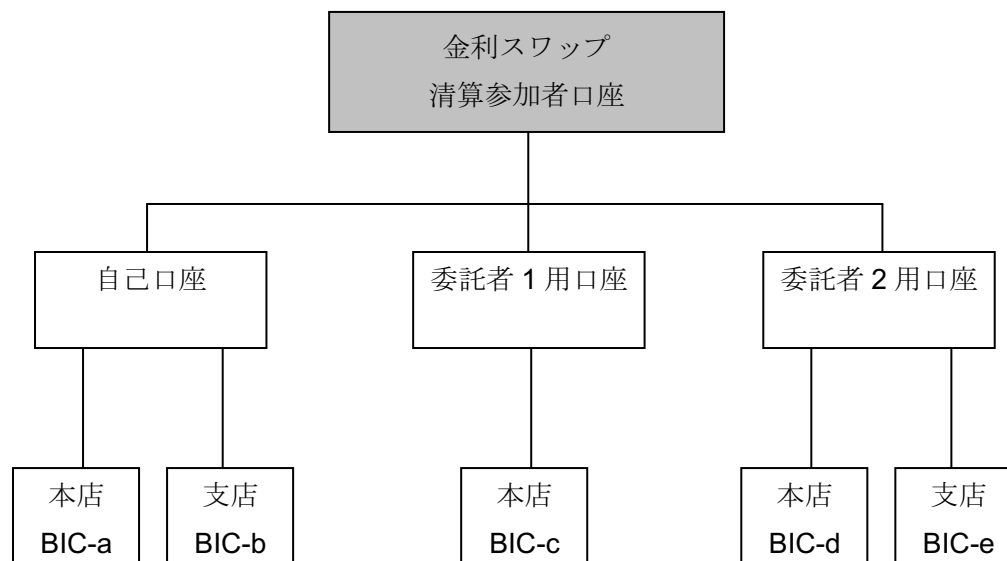
: 金利スワップ取引清算参加者の全残高を管理する口座

## &lt;第2階層口座&gt;

: 自己分を管理する口座（複数設定不可）及び  
清算取次ぎの委託者分（アフィリエイト、クライアント）を  
管理する口座（複数設定可）

## &lt;第3階層口座&gt;

: 自己又は委託者口座内において取引の管理上、  
MarkitWire 上の BIC コードごとに設定を可能とする口座  
（本店・支店間で別の BIC コードを設定している場合等を想定）  
（受託清算参加者として複数 BIC コード（例：BIC-a、BIC-b）  
の利用可。）



## (2) MarkitWire 以外のプラットフォームを使用する場合

## &lt;第1階層口座&gt;

: 金利スワップ取引清算参加者の全残高を管理する口座

## &lt;第2階層口座&gt;

: 自己分を管理する口座（複数設定不可）及び  
清算取次ぎの委託者分（アフィリエイト、クライアント）を  
管理する口座（複数設定可）

各口座の LEI (Legal Entity Identifier) を JSCC へ申告

## &lt;第3階層口座&gt;

: 自己又は委託者口座内において取引の管理上、

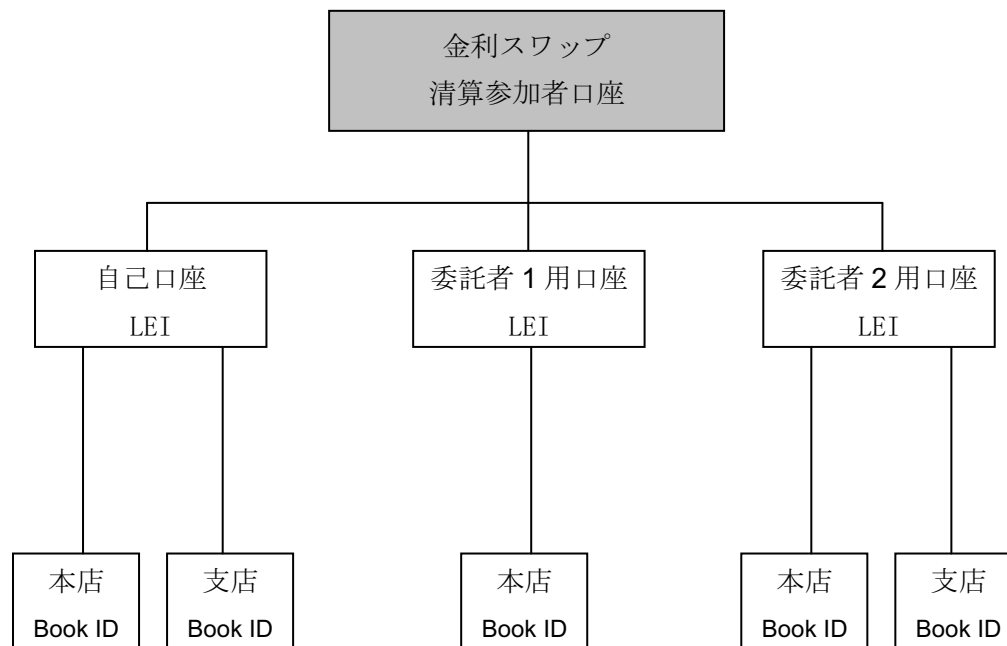
**Book ID** ごとに設定を可能とする口座

※**Book ID** は、「参加者コード（5桁コード）+ IRS  
+ 自己委託区分（参加者は H、アフィリエイト及び  
クライアントは C）+ 第二階層名称（3桁コード）  
+ 第三階層名称（3桁コードのみ）」を設定。

※なお、同一の **JSCC** 口座に **MarkitWire** 上の **BIC** コードと

**Book ID** を設定し、債務負担申込元にかかわらず同一の

**JSCC** 口座にて取引を管理することができます。



## 2. 証拠金所要額の計算単位

- ・ 証拠金所要額の計算は、第 2 階層で行います。
- ・ 金利スワップ清算参加者が JSCC に対して預託を行う際の証拠金所要額は、第 2 階層における自己口座に対する所要額及び第 2 階層における各委託者口座に対する所要額の合計（グロス）となります。

### <第 1 階層口座>

: 金利スワップ清算参加者が JSCC に対して預託を行う際の所要額

### <第 2 階層口座>

: 配下の全ての第 3 階層の口座の取引を対象として所要額を算出

### <第 3 階層口座>

