金利スワップ取引清算業務におけるクライアント・クリアリングの取扱いの承認に関するガイドライン

２０１４年2月２４日
２０１５年9月２４日改正
株式会社日本証券クリアリング機構

Ⅰ．ガイドラインの位置付け

・本ガイドラインは、金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書第１２条の２の規定に基づき、金利スワップ取引を対象とした清算業務に関し、清算参加者（注１）が、同一の企業集団に含まれる者以外の清算委託者からの委託に基づく有価証券等清算取次ぎ（以下「クライアント・クリアリング」という。）の取扱いを行おうとする場合に必要となる当社の承認について、確認上の観点や確認事項を取りまとめたものです。

（注１）金利スワップ清算資格の取得と同時にクライアント・クリアリングの取扱いの承認を受けようとする場合の金利スワップ清算資格の取得申請者を含みます。

Ⅱ．ガイドラインの内容

・クライアント・クリアリングの取扱いを行うためには、クライアント・クリアリングに係る業務執行体制を整備する必要があります。以下では、業務方法書の規定内容とともに、主な確認上の観点や確認事項をガイドラインとして記載しています。（注２）

（注２）今後の制度改正等により業務方法書の規定等及び本ガイドラインの記載が変更されることがございます。

クライアント・クリアリングの取扱いの承認に係る確認項目	金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書における規定内容	主な確認上の観点及び確認事項（ガイドライン）
業務執行体制	クライアント・クリアリングに係る清算約定の決済、損失の危険の管理及び利益相反の防止について当社が通知又は公示により確認上の	【決済業務関係】 ・清算委託者（クライアント・クリアリングの取扱いの承認を受けようとする者と同一の企業集団に含まれる者を除

クライアント・クリアリングの取扱いの承認に係る確認項目	金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書における規定内容	主な確認上の観点及び確認事項（ガイドライン）
	観点及び確認事項として定めるところにより確認を行い、適切な業務執行体制を備えていると認めるときは、クライアント・クリアリングの取扱いの承認を行う。 （１２条の２関係）	く。以下本ガイドラインにおいて同じ。）の取引の有価証券等清算取次ぎの承諾、当初証拠金・変動証拠金等（変動証拠金、変動証拠金に対する利息、クーポン及びアップフロントフィーをいう。）の預託・返戻の各処理について、当社の定める事務処理方法に沿って行うことができる体制が整備されていることを確認します。 【リスク管理関係】 ・クライアント・クリアリングの取扱いを開始する際の清算委託者に対する審査、清算委託者の信用状況が悪化した場合における受託清算参加者の対応、ポジションに係るリスクが増加した場合の対応等により、清算委託者に係るリスクを適切に管理することができる体制が整備されていることを確認します。 【コンプライアンス関係】 ・利益相反のおそれのある部門との情報遮断措置等の利益相反管理の方法により、清算委託者の利益が不当に害されることを防止することができる体制が整備されていることを確認します。

以　　上