為替相場の気配値の取扱いについて

２０１５年9月２４日
２０１６年4月１１日改正
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．リスク量が大きい場合における当初証拠金所要額の引上げ措置に関する外貨建清算約定に係るＰＶＯ１の超過額を日本円に換算するための為替相場の気配値に関する事項（金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の取扱い（以下「業務方法書の取扱い」という。）第２３条第３項関係）

同項に基づき当初証拠金所要額割増額を算出する日（以下「算出日」という。）の午後３時における、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、１ユーロ又は１オーストラリア・ドル当たりの円貨額の仲値の平均値（以下単に「東京外国為替市場の仲値の平均値」という。）に対して過去の変動幅を適用した値を用いるものとする。

過去の変動幅とは、算出日から起算して過去１，２５０当社営業日の午後３時における、東京外国為替市場の仲値の平均値の５日間の変動のうち、円安方向に変動した上位１２位までの変動幅の平均値をいうものとする。

２．外貨建清算約定に係る変動証拠金所要額を日本円に換算するための為替相場の気配値に関する事項（業務方法書の取扱い第４２条の７第１項第１号関係）

クロスマージン承諾日の午後３時における東京外国為替市場の仲値の平均値を用いるものとする。

３．決済未了金額を日本円に換算するための為替相場の気配値に関する事項（業務方法書の取扱い第４３条の３第１項関係）

（１）　豪ドル建清算約定に係る決済金額に関する決済未了金額の場合

ａ　決済未了金額の預託又は支払いを完了しなかった日（以下「未了日」という。）の後最初に到来する当社営業日かつシドニー営業日である日の正午までの間における当初証拠金所要額及び債務負担時所要証拠金の当初証拠金相当額に加算する金額の算出に用いる為替相場の気配値　当該未了日の午後３時における東京外国為替市場の仲値の平均値

ｂ　未了日の後最初に到来する当社営業日かつシドニー営業日である日の午後１時以

降午後４時までの間における日中証拠金所要額及び債務負担時所要証拠金の当初証拠金相当額に加算する金額の算出に用いる為替相場の気配値　当該未了日の後最初に到来する当社営業日かつシドニー営業日の午前１１時における東京外国為替市場の仲値の平均値

（２）　前号に掲げる決済金額以外の外貨建清算約定に係る決済金額に関する決済未了金額の場合

ａ　未了日の正午までの間における当初証拠金所要額及び債務負担時所要証拠金の当初証拠金相当額に加算する金額の算出に用いる為替相場の気配値　当該未了日の前当社営業日の午後３時における東京外国為替市場の仲値の平均値

ｂ　未了日の午後１時以降における日中証拠金所要額及び債務負担時所要証拠金の当初証拠金相当額に加算する金額の算出に用いる為替相場の気配値　当該未了日の午前１１時における東京外国為替市場の仲値の平均値

（３）　外貨建清算約定に係る変動証拠金に関する決済未了金額の場合

ａ　未了日の午前１１時以降正午までの間における当初証拠金所要額に加算する金額の算出に用いる為替相場の気配値　当該未了日の前当社営業日の午後３時における東京外国為替市場の仲値の平均値

ｂ　未了日の午後１時以降午後４時までの間における日中証拠金所要額及び債務負担時所要証拠金の当初証拠金相当額に加算する金額の算出に用いる為替相場の気配値　当該未了日の午前１１時における東京外国為替市場の仲値の平均値

ｃ　未了日の後最初に到来する当社営業日かつ当該外貨建清算約定に係る外貨本国営業日である日の午前１１時までの間における当初証拠金所要額に加算する金額の算出に用いる為替相場の気配値　当該未了日の午後３時における東京外国為替市場の仲値の平均値

４．当初証拠金算出のための為替相場の気配値に関する事項（業務方法書の取扱い別表２第１項第１号ｆ及びｈ、第２項１号ｃ並びに第３項第１号ａ及びｃ関係）

（１）　業務方法書の取扱い別表２第１項第１号ｆに規定する当社が定める為替相場の気配値は、午後３時における東京外国為替市場の仲値の平均値とする。

（２）　業務方法書の取扱い別表２第１項第１号ｈに規定する当社が定める為替相場の気配値は、算出日の午後３時における東京外国為替市場の仲値の平均値とする。

（３）　業務方法書の取扱い別表２第２項第１号ｃに規定する当社が定める為替相場の気配値は、算出日の午前１１時における東京外国為替市場の仲値の平均値とする。

（４）　業務方法書の取扱い別表２第３項第１号ａ及びｃに規定する当社が定める為替相場の気配値は、算出日の午前１１時における東京外国為替市場の仲値の平均値（午前９時から正午までの間に債務負担の申込みを受領した場合又は業務方法書の取扱い第２７条第３項に規定する申込みを受領した場合にあっては、算出日の前当社営業日

の午後３時における東京外国為替市場の仲値の平均値）とする。

５．外貨建清算約定に係るクライアント・クリアリング手数料を算出するための為替相場の気配値に関する事項（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５条の２第２項第２号関係）

（１）４月から９月までのクライアント・クリアリング手数料を算出する場合には、手数料を算出する日の属する年の前年１０月から３月までの各当社営業日における午後３時の東京外国為替市場の仲値の平均値を平均した値を用いる。

（２）１０月から翌年３月までのクライアント・クリアリング手数料を算出する場合には、手数料を算出する日の属する年（１月から３月までの手数料を算出する場合は、手数料を算出する日の属する前年）の４月から９月までの各当社営業日における午後３時の東京外国為替市場の仲値の平均値を平均した値を用いる。

６．外貨建清算約定に係る期限前終了手数料を算出するための為替相場の気配値に関する事項（金利スワップ取引清算業務に関する清算参加者の破綻処理に関する規則第６条関係）

金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書第９１条の規定により終了した外貨建清算約定の破綻処理入札を行った日の午後３時における東京外国為替市場の仲値の平均値を用いるものとする。

７．未決済債務等を日本円に換算するための為替相場の気配値に関する事項（金利スワップ取引清算業務に関する清算参加者の破綻処理に関する規則第１７条の２関係）

当該未決済債務等に係る外貨建清算約定の破綻処理入札を実施した日の午後３時における東京外国為替市場の仲値の平均値を用いるものとする。

以　　上