

自己資本額に応じたリスクとするための措置の制度の見直しに伴う 金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の一部改正について

I. 改正趣旨

当社の金利スワップ取引清算業務に関して、2014年のクライアント・クリアリングの開始以降、クライアントによる利用は増加を続けている。今後のクライアント・クリアリングのさらなる利用拡大に備える観点等から、清算参加者の自己資本額に応じたリスクとするための措置の対象となる当初証拠金所要額水準について見直しを行う。これに伴って、金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書について、別紙のとおり所要の改正を行う。

II. 改正概要

- 清算参加者の自己資本額に応じたリスクとするための措置※の対象となる水準を、取引口座に応じて以下のとおりとする。
 - ※ 当該清算参加者を当事者とする清算対象取引について新たな債務負担の全部又は一部の停止並びにポジション保有状況の改善指示

- 清算参加者の自己取引口座及び当該清算参加者と同一の企業集団に含まれる清算委託者のために設定された委託取引口座の当初証拠金所要額合計額が、当該清算参加者の自己資本額の200パーセントを超えた場合
- 清算参加者の自己取引口座及びすべての委託取引口座の当初証拠金所要額合計額が、当該清算参加者の自己資本額の400パーセントを超えた場合

(備考)

金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書第29条の3第1項

III. 施行日

2020年8月1日から施行する。

以 上

金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の一部改正新旧対照表

目 次

	(ページ)
1. 金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の一部改正新旧対照表	2

金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の一部改正新旧対照表

新	旧
<p>(自己資本額に応じたリスクとするための措置)</p> <p>第29条の3 当社は、<u>次の各号に掲げる口座に係る当初証拠金所要額の合計額が、当該各号に定める基準を超えた場合には、清算参加者を審問のうえ、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引について新たな債務負担の全部又は一部の停止の措置を行うとともに、取締役会の決議によるポジション保有状況の改善指示の措置を行うことができる。</u></p> <p><u>(1) 清算参加者の自己取引口座及び委託取引口座(当該清算参加者と同一の企業集団に含まれる清算委託者のために設定されたものに限る。)</u>に係る当初証拠金所要額の合計額 <u>当該清算参加者の自己資本額の200パーセント</u></p> <p><u>(2) 清算参加者の自己取引口座及びすべての委託取引口座に係る当初証拠金所要額の合計額</u> <u>当該清算参加者の自己資本額の400パーセント</u></p> <p>2 (略)</p> <p style="text-align: center;">付 則</p> <p>この改正規定は、令和2年8月1日から施行する。</p>	<p>(自己資本額に応じたリスクとするための措置)</p> <p>第29条の3 当社は、<u>清算参加者の自己取引口座及びすべての委託取引口座に係る当初証拠金所要額の合計額が、当該清算参加者の自己資本額の200パーセントを超えた場合には、当該清算参加者を審問のうえ、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引について新たな債務負担の全部又は一部の停止の措置を行うとともに、取締役会の決議によるポジション保有状況の改善指示の措置を行うことができる。</u></p> <p>2 (略)</p>