

清算済み金利スワップと長期国債先物取引およびTONA3か月金利先物取引との間の当初証拠金の相殺によりリスク縮減が図れる「クロスマージン」サービス

長期国債先物（※1）およびTONA3か月金利先物（※2）とのリスク相殺により、金利スワップの当初証拠金所要額を削減できます

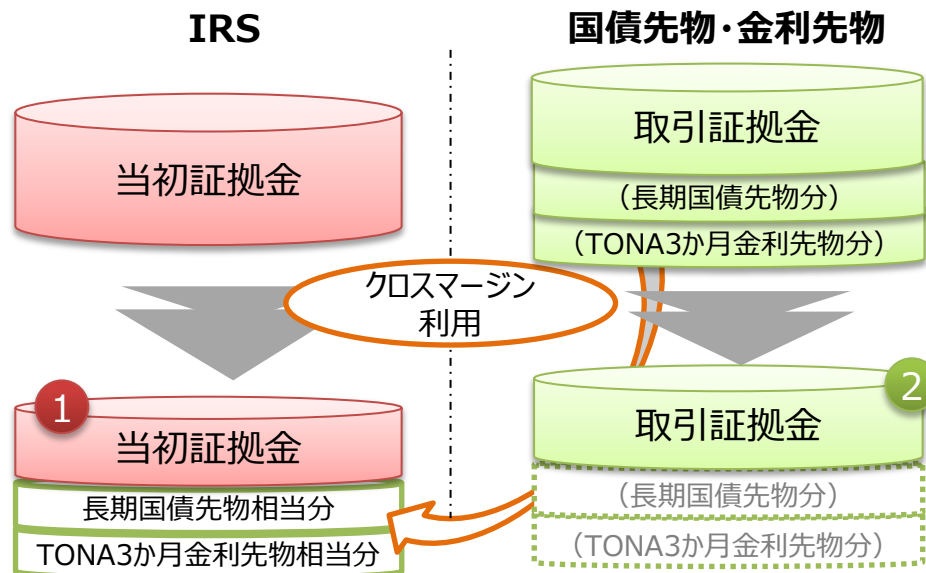
— 清算済みの円金利スワップの金利の種類や規模にかかわらず、クロスマージンを利用可能

（※1）大阪取引所上場の国債証券先物取引に係る現物先物取引&現金決済先物取引の第1限月&第2限月

（※2）大阪取引所上場のTONA3か月金利先物の第1限月～第8限月

JSCCで金利スワップを清算する清算委託者（クライアント）もクロスマージンサービスを利用可能です

— JSCCでは各クライアントのポジションについても、日々、「クロスマージン試算レポート」を提供



- 1 クロスマージンの利用者がクロスマージンの対象として申請した長期国債先物、TONA3か月金利先物について、金利スワップのポジションと併せて証拠金（※3）を算出
- 2 クロスマージン対象外の国債先物、金利先物については、通常通り、VaR方式で取引証拠金を算出

（※3）清算済み金利スワップに対してリスク相殺効果がある場合のみJSCCは申請を受領