

株式会社日本証券クリアリング機構におけるクロスマージン制度導入に伴う 当社関連諸規則の一部改正について

2015年6月30日
株式会社大阪取引所

I. 趣旨

当社は、清算・決済規程等の一部改正を行い、本年9月24日から施行します（詳細については、規則改正新旧対照表を御覧ください。）。

今回の改正は、株式会社日本証券クリアリング機構（以下「クリアリング機構」）において、国債証券先物取引及び金利スワップ取引に係るリスクの相殺を可能とすることで、金利スワップ清算参加者等の担保負担の軽減を図る「クロスマージン制度」の導入が予定されていることに伴い、所要の対応を行うものです。

II. 改正概要

1. クロスマージンに係る用語の意義等

- ・ クロスマージンに係る用語の意義は、クリアリング機構の業務方法書において定めるところによるものとします。
- ・ クロスマージンの申請に係る申込み等について定めます。

（備考）

- ・ 清算・決済規程第2条第8項
- ・ 清算・決済規程第4条の13、受託契約準則第14条の13、先物・オプション取引に係る証拠金及び未決済約定の引継ぎ等に関する規則第14条、清算・決済規程施行規則第4条

2. クロスマージン制度を適用している国債証券先物取引に係るポジションに基づく権利義務関係の消滅等

- ・ クロスマージン制度を適用している国債証券先物取引に係るポジションに基づく権利義務関係の消滅及び当該ポジションに係る取引の整理について定めます。

- ・ 先物・オプション取引口座設定約書第11条の2及び第12条第6項

3. 顧客の未決済約定の整理を行う場合における、クロス
マージンを適用している取引の取扱い

- ・ クロスマージン制度を適用している国債証券先物取引に係るポジションについて、当社が取引参加者に対して支払不能による売買停止等を行った場合又は顧客が期限の利益を喪失した場合等における、他の取引参加者への引継ぎや取引参加者が任意で行う未決済約定の整理の対象から除外します。

・ 受託契約準則第 3
3 条及び先物・オ
プション取引口座
設定約諾書第 1 2
条第 1 項

4. その他

- ・ その他所要の改正を行うものとします。

Ⅲ. 施行日

- ・ 2015 年 9 月 24 日から施行します。ただし、売買システムの稼働に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、2015 年 9 月 24 日に施行することが適当でないと当社が認める場合には、当該日以後の当社が定める日から施行することとします。

以 上