



PRESS RELEASE

平成 22 年 6 月 30 日

各 位

(株)日本証券クリアリング機構

OTC デリバティブ取引に係る清算業務の取扱いについて

昨今の金融危機を契機としてリスク削減に向けた取組みが世界規模で行われており、とりわけ OTC デリバティブ取引については、安全性・透明性の向上が強く求められております。

こうした状況の中、弊社は、我が国金融機関において広く取引が行われている金利スワップ取引及び市場規模の拡大が著しい CDS 取引について清算機関として機能の提供を行うべく、株式会社東京証券取引所と共同で、平成 21 年 5 月 22 日に「OTC デリバティブに係る清算業務検討ワーキング・グループ」を設置し、同年 7 月 21 日の第 1 回ワーキング・グループ以降、10 回にわたり、委員会社及びオブザーバーと検討を進めてまいりました。

今般、弊社はワーキング・グループにおける検討を踏まえ、金利スワップ取引及び CDS 取引に係る清算業務について、以下のとおり対応することとしましたので、公表いたします。

1. 金利スワップ取引

- ・ 金利スワップ取引については、英国の LCH. Clearnet Ltd. (以下「LCH」といいます。)が既に清算業務を提供し、海外の主要金融機関の多くが参加している実態を踏まえると、清算業務の提供にあたっては、LCH との間で連携(リンク)を構築することが有用と考えられます。
- ・ 当社は、これまで LCH と連携構築に向けた協議を行っており、早期の清算業務の提供に向け、引き続き精力的に検討を進めてまいります。

2. CDS 取引

- ・ 本年 5 月 19 日に「金融商品取引法等の一部を改正する法律」が公布され、平成 24 年 11 月までに、一定の条件を満たす CDS 取引について、国内清算機関の利用が義務付けられる見通しです。
- ・ 当社としては、CDS 取引について可能な限り早期に業務を開始すべく、金利スワップ取引に先行して清算業務を提供することとし()、平成 23 年 4 月から 6 月を目途として清算業務を開始すべく、今後、オペレーション面の詳細等、ワーキング・グループにおいてより具体的な検討を進めていくこととします。

() 清算業務の開始にあたっては、金融庁長官から業務方法書に係る認可を受ける必要があります。

以 上

< 本件に関する御照会先 >

(株)日本証券クリアリング機構 リスク管理グループ (電話 03-3665-1234 (代))