

2021年7月13日

各位

三菱UFJ信託銀行株式会社
日本マスタートラスト信託銀行株式会社

店頭デリバティブ取引にかかる証拠金管理サービスの拡充について

三菱UFJ信託銀行株式会社（取締役社長 ながしま いわお 長島 巖、以下MUTB）および、日本マスタートラスト信託銀行株式会社（取締役社長 むこうはら としかず 向原 敏和、以下MTBJ）は、店頭デリバティブ取引にかかる「証拠金管理サービス」において、新たに「当初証拠金」の取扱いを開始いたしました。

1. サービス導入の背景（店頭デリバティブ取引への証拠金規制）

デリバティブ取引のシステミックリスク（連鎖的に破綻が波及するリスク）、カウンターパーティーリスク（取引先が決済不履行に陥るリスク）等の削減を目的として、各国およびG20各国間では様々な証拠金規制が整備されております。

このうち、取引清算が中央清算機関を経由しない店頭デリバティブ取引については、取引当事者間で証拠金の授受が求められています。

2. 「証拠金管理サービス」の概要

店頭デリバティブ取引における証拠金には、「当初証拠金（※1）」「変動証拠金（※2）」の2つの区分があります。

MUTBとMTBJでは、今般「当初証拠金」について「当初証拠金担保管理サービス」をご提供する運びとなりました。このサービスは、お客さまの事務負担軽減を目的に、「当初証拠金」にかかる計算、決済手続等の一切を代行するもので、日本生命保険相互会社さまを第一号顧客として開始するものです。

なお、「変動証拠金」にかかる「変動証拠金担保管理サービス」につきましては、2016年2月よりご提供しており、今回のサービス拡充により、機関投資家のデリバティブ運用を包括的にご支援する体制が整いました。

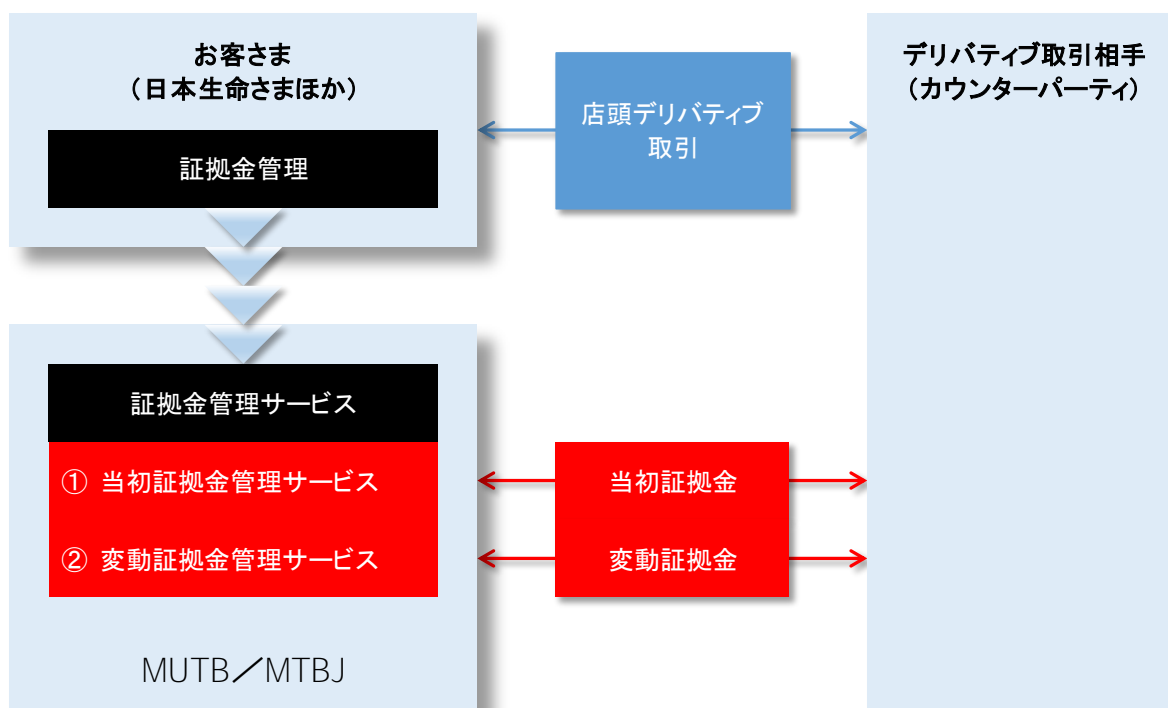
（※1）取引相手が破綻した場合の潜在的損失見積額を担保するための証拠金

（※2）日々の時価変動を担保するための証拠金

三菱UFJ信託銀行および日本マスタートラスト信託銀行は、これまで培った信託銀行のノウハウを最大限活用し、更なるサービスの拡充を図ってまいります。

以上

<スキーム図>



<各サービスの提供範囲>

	証拠金計算 過不足管理	取引相手との 証拠金照合	取引相手との 証拠金授受
① 当初証拠金管理サービス	○	○	○
② 変動証拠金管理サービス	○	○	○