



DTCC

MARGIN TRANSIT UTILITY

非清算店頭デリバティブ取引のオペレーションの自動化により、担保管理業務の課題を解消するプラットフォーム

DTCCのMargin Transit Utility (以下MTU)は担保授受などの事務処理や決済プロセスを自動化することで、既存の手作業によるオペレーションを効率化し、各金融機関のリスクを削減する事を目的に開発されました。

MTUはマージンコール後の決済業務プロセスを自動化し、決済指示、レポート、モニタリングを実施し、複数の取引相手との情報のやりとりを簡素化します。

マージンコール合意後から決済に至るまでのプロセスを自動化、標準化することにより、オペレーショナルリスクの軽減を実現します。また、取引関係者への決済データ送信を即時に行うことにより、信用リスクや流動性リスクの削減にも対応します。

MTUをご利用いただくことにより、マージンコールとデータの管理を自動化し、取引量の増加に伴うデリバティブ関連業務量の逼迫を防ぎ、非清算店頭デリバティブ取引の証拠金規制に対応します。

特徴:

- 担保物の決済指図の自動送信により、これまでの手作業による決済フェイルを減らします。
- ALERT® (DTCCが提供している決済情報データベース)に自動接続し、SWIFTコードをはじめとする決済情報 (SSI) をより正確なものへと更新します。
- 取引当事者とそのカストディアンに加え、トライパーティーエージェントに対してもメッセージを自動送信します。これにより従来のFAX送付、システム入力などの手作業が不要となります。
- MTUは決済ステータス (状況) をお客様へお送りしますが、お客様のシステムに合わせ、SWIFT、MQチャンネル、AcadiaSoftのMargin Manager (APIまたはGUI)、MTU GUIなどの接続タイプが選択可能です。
- 取引関係者は決済確認の通知をMTUより自動でリアルタイムにて受け取り、より迅速に担保の割り当てが可能となります。

MTUの仕組み:

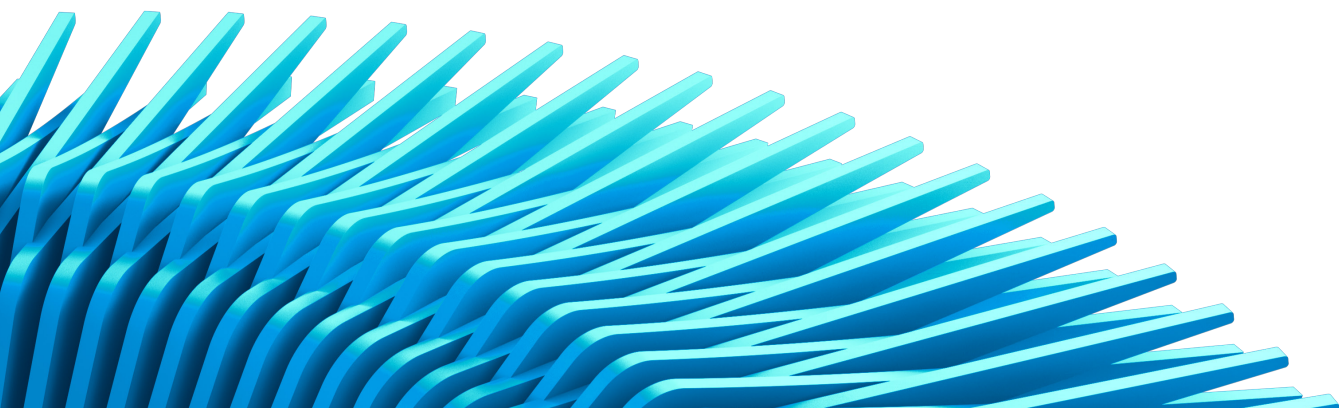
AcadiaSoftのMargin Managerでマージンコールの照会実施後、MTUはALERT (決済情報データベース) を経由し決済情報をより正確なものへと更新した後、決済確認通知をリアルタイムで送信します。

また、取引日ごとの最終ポジションレポートをお客様へお送りします。

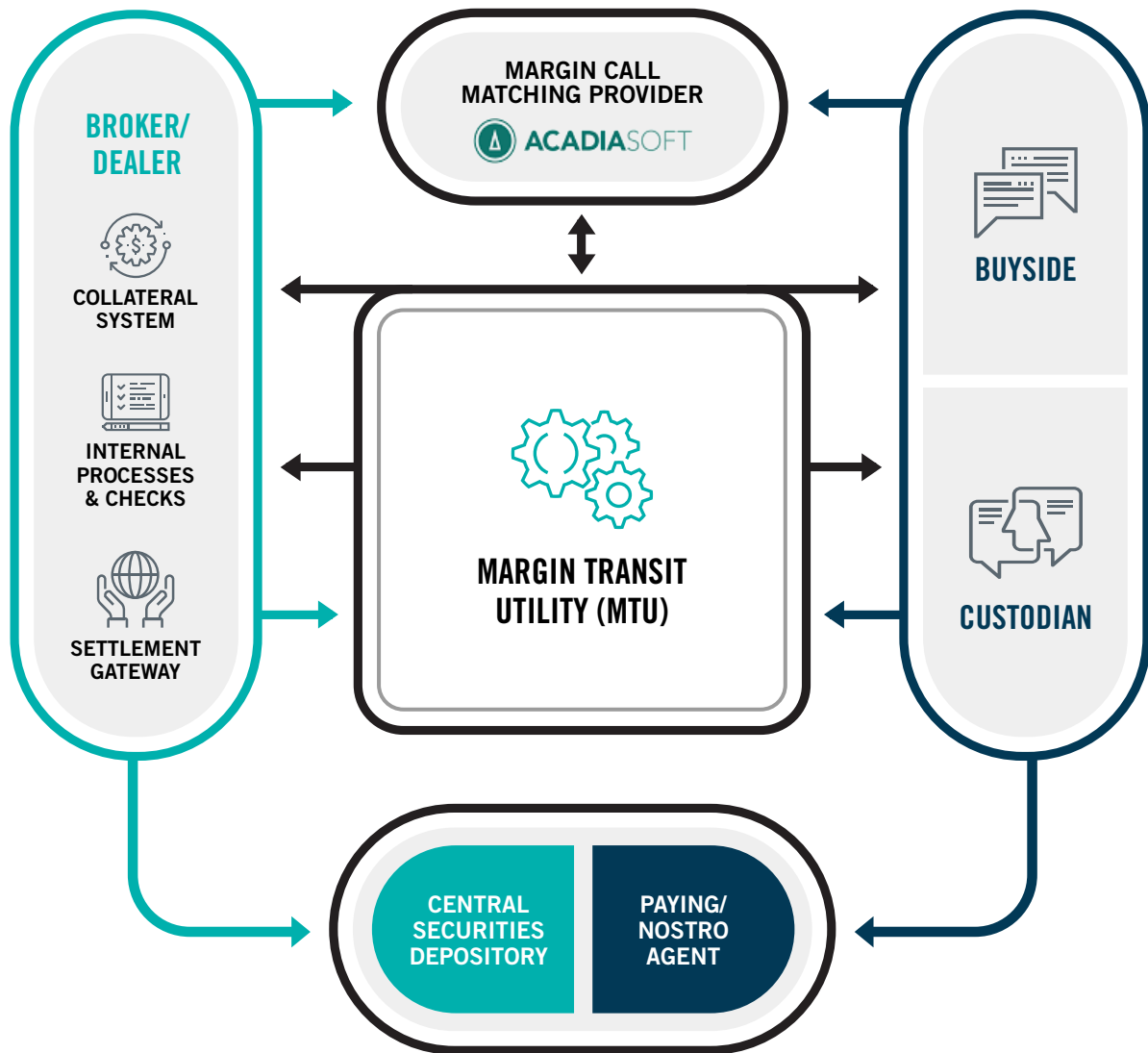
さらに、他の担保管理ソリューションであるCloudMargin、VERMEG (Colline)、TriOptima (triResolve Margin)などへも接続可能です。

担保管理プロセスについて: 双方の取引当事者がマージンコールの金額に合意した時点で担保管理プロセスが始まり、担保の割り当ては取引当事者、またはトライパーティーが実施します。2社間もしくは3社間の契約では、取引当事者がマージンの金額に合意し、トライパーティーマネージャーを通じて、差し入れ/受け入れ予定の担保を確認します。その後、トライパーティーマネージャーがMTUに対し担保を承認するメッセージを送信します。

ADVANCING FINANCIAL MARKETS. TOGETHER.™



MARGIN TRANSIT UTILITY WORKFLOW



CONTACT US



TO LEARN MORE, visit [DTCC.com/mtu](https://www.dtcc.com/mtu).

© 2021 DTCC. All rights reserved. DTCC, DTCC (Stylized), ADVANCING FINANCIAL MARKETS. TOGETHER, and the Interlocker graphic are registered and unregistered trademarks of The Depository Trust & Clearing Corporation.

The services described above are provided under the "DTCC" brand name by certain affiliates of The Depository Trust & Clearing Corporation ("DTCC"). DTCC itself does not provide such services. Each of these affiliates is a separate legal entity, subject to the laws and regulations of the particular country or countries in which such entity operates. See www.dtcc.com for a detailed description of DTCC, its affiliates and the services they offer.

Certain DTCC ITP LLC services are subject to regulation by the U.S. Securities and Exchange Commission ("SEC") and are offered by DTCC ITP Matching (US) LLC ("DTCC Matching"), which is set out in SEC Release No. 34-44188; File No. 600-32; 66 FR 20494 (April 17, 2001). TradeSuite ID and CTM are services of DTCC Matching and are subject to SEC regulation when used for trades in which either the broker-dealer or its institutional customer is a U.S. entity and the securities in the trade are issued by a U.S. issuer. No other services offered by DTCC ITP LLC are regulated.

26415_LC012021 DTCC Public (White)