

店頭デリバティブ取引等の規制に関する
内閣府令第4条第1項で定める作成・保存・報告事項
ガイドライン

令和4年12月
金融庁企画市場局市場課

【省略用語例】

このガイドラインにおいて使用した次の用語は、それぞれ次に掲げる法令を示すものである。

法：金融商品取引法（昭和 23 年法律第 25 号）

府令：店頭デリバティブ取引等の規制に関する内閣府令（平成 24 年内閣府令第 48 号）

法第 156 条の 63 及び第 156 条の 64 では、金融商品取引清算機関等（金融商品取引清算機関又は外国金融商品取引清算機関をいう。以下同じ。）及び金融商品取引業者等（金融商品取引業者又は登録金融機関をいう。以下同じ。）は、取引情報蓄積機関等（取引情報蓄積機関又は指定外国取引情報蓄積機関をいう。以下同じ。）に対し、取引情報を提供しなければならないと規定されている。

また、法第 156 条の 65 では、取引情報蓄積機関は、金融商品取引清算機関等及び金融商品取引業者等から提供を受けた取引情報について、府令第 4 条第 1 項で定める事項に関する記録を作成、保存し、保存する取引情報を内閣総理大臣に報告しなければならないと規定されている。

本ガイドラインは、取引情報蓄積機関、金融商品取引清算機関等及び金融商品取引業者等に対し、府令第 4 条第 1 項で定める事項の詳細を示すものである。

【別紙 1 について】

別紙 1「報告事項の定義及び解釈」では、府令第 4 条第 1 項で定める事項の定義及び解釈等を示している。金融商品取引清算機関等及び金融商品取引業者等は、取引情報蓄積機関等への報告にあたっては、必要に応じて別紙 1「報告事項の定義及び解釈」の内容を確認すること。

【別紙 2 について】

別紙 2「固有取引識別子（UTI）の付番等の考え方」では、UTI（Unique transaction identifier）の付番者等の考え方を示している。金融商品取引清算機関等及び金融商品取引業者等は、付番にあたっては必要に応じて別紙 2「固有取引識別子（UTI）の付番等の考え方」の内容を確認すること。

【既存取引の取扱いについて】

店頭デリバティブ取引のうち、本ガイドラインの施行日（令和6年4月1日）前に取引が行われたもので施行日時点では満期を迎えていないもの（既存取引）については、施行日に府令第4条第1項に規定する事項に変更が生じたものとみなして、変更した事項について、本ガイドラインに記載した内容について以下のとおり、更新・提供すること。

①施行日前に提供又は報告済みの取引情報

施行日から180日以内に取引情報蓄積機関等に対し、新たに規定された報告事項にかかる取引情報を提供すること。

（注1）新たに規定された報告事項について、取引情報を保有していない場合は、当該事項は空欄で構いません。

なお、取引情報の蓄積のため、施行日に金融商品取引清算機関等及び金融商品取引業者等は取引情報蓄積機関等が暫定的に定めた事項にかかる取引情報を取引情報蓄積機関等に提供をお願いします。

（注2）既存取引にかかる評価情報及び担保情報の提供について、施行日からの提供を妨げるものではありません。

②提供前に満期を迎えた場合

施行日以後、①の取引情報の提供前に満期を迎えた取引については、その後の取引情報の更新・提供は不要。

③取引が成立した日（金融商品取引清算機関等が債務を負担した日を含む。）が施行日前で取引情報の提供が施行日以後になる場合の取扱い

施行日に取引情報に変更が生じたものとみなして、施行日から起算した報告期限（令和6年4月3日）までに取引情報蓄積機関等に提供すること。

令和4年12月9日 制定

令和6年4月1日 施行

報告事項の定義及び解釈

令和4年12月
金融庁企画市場局市場課

報告事項 一覧

取引の執行の日時、取引に係る契約の評価の日時その他の取引に係る日時に関する事項

	Data Element Name	データ要素名	Source
1	Effective date	発効日	CDE
2	Expiration date	満期日	CDE
3	Early termination date	中途解約日	CDE
4	Reporting timestamp	報告タイムスタンプ	CDE
5	Execution timestamp	執行タイムスタンプ	CDE

取引の当事者及び取引情報の報告者に関する事項

	Data Element Name	データ要素名	Source
6	Entity responsible for reporting	金融機関名	ESMA
7	Counterparty 1 (reporting counterparty)	取引当事者1 (報告主体)	CDE
8	Counterparty 2	取引当事者2	CDE
9	Counterparty 2 identifier type	取引当事者2識別子タイプ (LEIか否か)	CDE
10	Direction 1 (Buyer/Seller)	取引の方向1 (買主/売主)	CDE
11	Direction 2 (Payer/Receiver)	取引の方向2 (支払人/受取人)	CDE
12	Submitter identifier	送信者識別子	CFTC
13	New SDR identifier	新しいSDR識別子	CFTC
14	Original swap SDR identifier	元のスワップSDR識別子	CFTC

金融商品取引清算機関等による債務の負担、決済及び取引の識別に関する事項

	Data Element Name	データ要素名	Source
15	Cleared	清算済み	CDE
16	Central counterparty	清算機関	CDE
17	Clearing member	清算会員	CDE
18	Platform identifier	プラットフォーム識別子	CDE
19	Confirmed	コンファメーションの有無	CDE
20	Final contractual settlement date	最終契約決済日	CDE
21	Settlement currency	決済通貨	CDE
22	Clearing account origin	清算口座元	CFTC
23	Original swap UTI	オリジナルスワップUTI	CFTC
24	Clearing receipt timestamp	清算受領タイムスタンプ	CFTC
25	Unique transaction identifier (UTI)	固有取引識別子(UTI)	CFTC
26	Prior UTI (for one-to-one and one-to-many relations between transactions)	過去のUTI(取引間が1対1および1対多の関係)	CDE

取引における日数の計算方法、定期的な金銭の支払の周期その他の支払に関する事項

	Data Element Name	データ要素名	Source
27	Day count convention	日数計算コンベンション	CDE
28	Payment frequency period	支払頻度	CDE
29	Payment frequency period multiplier	支払頻度乗数	CDE
30	Fixing date	確定日	CFTC
31	Floating rate reset frequency period	変動金利のリセット頻度周期	CFTC
32	Floating rate reset frequency period multiplier	変動金利のリセット頻度周期乗数	CFTC
33	Other payment amount	その他の支払いの額	CDE
34	Other payment type	その他の支払いタイプ	CDE
35	Other payment currency	その他の支払いの通貨	CDE
36	Other payment date	その他の支払い日	CDE
37	Other payment payer	その他の支払いの支払人	CDE
38	Other payment receiver	その他の支払いの受取人	CDE

取引に係る契約の評価額及び評価手法並びに担保及び証拠金に関する事項

	Data Element Name	データ要素名	Source
39	Valuation amount	評価額	CDE
40	Valuation currency	評価通貨	CDE
41	Valuation timestamp	評価タイムスタンプ	CDE
42	Valuation method	評価方法	CDE
44	Collateral portfolio indicator	担保付ポートフォリオの区分	CDE
45	Initial margin posted by the reporting counterparty (pre-haircut)	報告主体の取引当事者が差し入れた当初証拠金(ヘアカット前)	CDE
46	Initial margin posted by the reporting counterparty (post-haircut)	報告主体の取引当事者が差し入れた当初証拠金(ヘアカット後)	CDE
47	Currency of initial margin posted	差し入れた当初証拠金の計上通貨	CDE
48	Initial margin collected by the reporting counterparty (pre-haircut)	報告主体の取引当事者が徴求した当初証拠金(ヘアカット前)	CDE
49	Initial margin collected by the reporting counterparty (post-haircut)	報告主体の取引当事者が徴求した当初証拠金(ヘアカット後)	CDE
50	Currency of initial margin collected	徴求した当初証拠金の通貨	CDE
51	Variation margin posted by the reporting counterparty (pre-haircut)	報告主体の取引当事者が差し入れた変動証拠金(ヘアカット前)	CDE
52	Variation margin posted by the reporting counterparty (post-haircut)	報告主体の取引当事者が差し入れた変動証拠金(ヘアカット後)	CDE
53	Currency of variation margin posted	差し入れた変動証拠金の通貨	CDE
54	Variation margin collected by the reporting counterparty (pre-haircut)	報告主体の取引当事者が徴求した変動証拠金(ヘアカット前)	CDE
55	Variation margin collected by the reporting counterparty (post-haircut)	報告主体の取引当事者が徴求した変動証拠金(ヘアカット後)	CDE
56	Currency of variation margin collected	徴求した変動証拠金の通貨	CDE
57	Excess collateral posted by the reporting counterparty	差し入れた超過担保	CDE
58	Currency of excess collateral posted	差し入れた超過担保の通貨	CDE
59	Excess collateral collected by the reporting counterparty	徴求した超過担保	CDE
60	Currency of excess collateral collected	徴求した超過担保の通貨	CDE
61	Collateralisation category	担保区分	CDE
62	Initial margin collateral portfolio code	当初証拠金担保ポートフォリオコード	CFTC
63	Variation margin collateral portfolio code	変動証拠金担保ポートフォリオコード	CFTC

取引価格に関する事項

	Data Element Name	データ要素名	Source
64	Price	価格	CDE
65	Price currency	価格通貨	CDE
66	Price notation	価格表記	CDE
67	Price unit of measure	価格の表示単位	CDE
68	Price schedules - Unadjusted effective date of the price	価格スケジュール-価格の調整前の発効日	CDE
69	Price schedules - Unadjusted end date of the price	価格スケジュール-価格の調整前の終了日	CDE
70	Price schedules - Price in effect between the unadjusted effective date and unadjusted end date inclusive	価格スケジュール-調整前の発効日と調整前の終了日との間の有効な価格	CDE
71	Fixed rate	固定金利	CDE
72	Spread	スプレッド	CDE
73	Spread currency	スプレッド通貨	CDE
74	Spread notation	スプレッド表記	CDE
75	Strike price	行使価格	CDE
76	Strike price currency/currency pair	行使価格通貨/通貨ペア	CDE
77	Strike price notation	行使価格表記	CDE
78	Strike price schedules - Unadjusted effective date of the strike price	行使価格スケジュール-行使価格の調整前の発効日	CDE
79	Strike price schedules - Unadjusted end date of the strike price	行使価格スケジュール-行使価格の調整前の終了日	CDE
80	Strike price schedules - Strike price in effect between the unadjusted effective date and unadjusted end date inclusive.	行使価格スケジュール-調整前の発効日と調整前の終了日との間の有効な行使価格	CDE
81	Option premium amount	オプションプレミアム額	CDE
82	Option premium currency	オプションプレミアム通貨	CDE
83	Option premium payment date	オプションプレミアム支払い日	CDE
84	First exercise date	最初の行使日	CDE
85	Exchange rate	為替レート	CDE
86	Exchange rate basis	為替レートベース	CDE

報告事項 一覧

取引に係る想定元本に関する事項

	Data Element Name	データ要素名	Source
87	Notional amount	想定元本	CDE
88	Call amount	コール金額	CDE
89	Put amount	プット金額	CDE
90	Notional currency	想定元本通貨	CDE
91	Call currency	コール通貨	CDE
92	Put currency	プット通貨	CDE
93	Quantity unit of measure	数量単位	CDE
94	Notional amount schedule – notional amount in effect on associated effective date	想定元本スケジュール-関連する発効日に有効な想定元本	CDE
95	Notional amount schedule – unadjusted effective date of the notional amount	想定元本スケジュール-想定元本の調整前の発効日	CDE
96	Notional amount schedule – unadjusted end date of the notional amount	想定元本スケジュール-想定元本の調整前の終了日	CDE
97	Total notional quantity	想定元本の総量	CDE
98	Notional quantity schedules – Unadjusted date on which the associated notional quantity becomes effective	想定元本数量スケジュール-関連する想定元本が有効となる調整前の日	CDE
99	Notional quantity schedules – Unadjusted end date of the notional quantity	想定元本数量スケジュール-想定元本の調整前の終了日	CDE
100	Notional quantity schedules – Notional quantity which becomes effective on the associated unadjusted effective date	想定元本数量スケジュール-関連する調整前の有効日に有効となる想定元本数量	CDE

取引における新規、変更又は解除の別その他の取引の過程に関する事項

	Data Element Name	データ要素名	Source
101	Action type	アクションタイプ	CFTC
102	Event type	イベントタイプ	CFTC
103	Event identifier	イベント識別子	CFTC
104	Event timestamp	イベントタイムスタンプ	CFTC

約定した金融指標その他の取引の対象に関する事項

	Data Element Name	データ要素名	Source
105	Index factor	インデックス・ファクター	CFTC
106	Embedded option type	埋め込みオプションタイプ	CFTC
108	Delivery type	デリバリータイプ	ESMA
109	Asset Class	アセットクラス	ESMA
110	Underlying identification type	原資産の識別タイプ	ESMA
111	Underlying identification	参照資産	ESMA
112	Indicator of the underlying index	参照資産指標	ESMA
113	Name of the underlying index	参照資産名称	ESMA
114	Reference entity	参照組織	ESMA
115	Indicator of the floating rate	変動金利(参照金利)指標	ESMA
116	Name of the floating rate	変動金利(参照金利)名称	ESMA
117	Floating rate reference period – time period	変動金利(参照金利)期間	ESMA
118	Floating rate reference period – multiplier	変動金利(参照金利)期間 数値	ESMA
119	Derivative based on crypto-assets	暗号資産に基づく商品か否か	ESMA
120	Maturity date of the underlying	原資産の満期日	ESMA
121	Seniority (CD)	シニア	ESMA
122	Series (CD)	シリーズ	ESMA
123	Version (CD)	バージョン	ESMA
124	CDS index attachment point	CDSインデックスアタッチメントポイント	CDE
125	CDS index detachment point	CDSインデックスデタッチメントポイント	CDE
126	Custom basket code	カスタムバスケットコード	CDE
127	Identifier of the basket's constituents	バスケットの構成銘柄の識別子	CDE
128	Basket constituent identifier source	バスケット構成識別子ソース	CDE

取引に係る契約の種類に関する事項

	Data Element Name	データ要素名	Source
129	Contract type	契約の種類	ESMA
130	Option style	オプションスタイル	ESMA
131	Option type	オプションタイプ	ESMA
132	Package identifier	パッケージ識別子	CDE
133	Package transaction price	パッケージ取引価格	CDE
134	Package transaction price currency	パッケージ取引価格通貨	CDE
135	Package transaction price notation	パッケージ取引価格表記	CDE
136	Package transaction spread	パッケージ取引スプレッド	CDE
137	Package transaction spread currency	パッケージ取引スプレッド通貨	CDE
138	Package transaction spread notation	パッケージ取引スプレッド表記	CDE
139	Package indicator	パッケージインジケータ	CFTC

※ デルタ及びUPIは2024年4月1日時点での報告事項には含まれていない。今後の国際動向を踏まえて内容や導入時期等については決定するが、デルタは事項43、UPIは事項107に記載する予定のため、事項43、107は欠番としている。
 ※事項・許容値については国際動向を踏まえて今後修正する可能性がある。

表の見方

Data Element Name	Leg1,Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	#
データ要素名の英語表記	Leg1,Leg2それぞれで報告が必要な場合には「Leg1,Leg2」と記載	データ要素名の日本語表記	データ要素の定義の日本語表記	各データ要素の許容値	報告にあたっての留意事項等	事項の詳細が定められているガイダンス引用元	ガイダンス引用元における事項番号

許容値の見方

許容値	意味	補足説明	例
YYYY-MM-DD	日付	YYYY=4桁の年MM=2桁の月DD=2桁の日	2015-07-06 (2015年7月6日対応)
YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ	日付と時刻	YYYY、MM、DDは上記のとおり。 hh=2桁の時間(00~23)(am/pmは不可)、mm=2桁の分(00~59)、ss=2桁の秒(00~59) Tは固定され、時間要素の開始を示します。Zは固定され、時刻が現地時間ではなくUTC(協定世界時)で表されることを示す。	2014-11-05T13:15:30Z (2014年11月5日午後1時15分30秒(協定世界時))
Num(25.5)	小数点以下5桁までを含む25文字までの数字	長さは固定されていませんが、小数点以下5文字までを含む25文字までの数字に制限されています。 10進数の後に5桁を超える数値がある場合は、報告を行うカウンターパーティは端数を切り上げます。	1352.67 12345678901234567890.12345 1234567890123456789012345 0 - 20000.25 - 0.257
Num(5)	最大5文字の数字。 小数点以下は使用できない。	長さは固定されていないが、最大5文字の数字に制限される。	12345 123 20
Char(3)	3文字の英数字	長さは3文字の英数字で固定される。	USD X1X 999
Varchar(25)	最大25文字の英数字	長さは固定されていないが、最大25文字の英数字に制限される。特殊文字は使用できない。使用できる場合は、データ要素のフォーマットで明示的に記述される。	asgaGEH3268EFdsagtTRCF543 aaaaaaaaaa x
Boolean	ブーリアン型	二者択一条件を表すために使用されるデータ型で「TRUE、FALSE」に対応する。	True False

※ Source欄における略称は以下のとおり。

CDE: Harmonisation of critical OTC derivatives data elements (other than UTI and UPI) Revised CDE Technical Guidance – version 3

CFTC: CFTC Technical Specification Parts 43 and 45 swap data reporting and public dissemination requirements August 30, 2022 Version 3.1

ESMA: Final Report Technical standards on reporting, data quality, data access and registration of Trade Repositories under EMIR REFIT 17 December 2020

※ 本文中に使用した次の用語は以下のとおり。

金融庁告示第105号:金融商品債務引受業の対象取引から除かれる金融庁長官が指定する取引及び貸借を指定する件(平成二十三年金融庁告示第百五号)

	Data Element Name	Leg1,Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	
								#
1	Effective date		発効日	コンファメーションに記載されている、店頭デリバティブ取引に係る債務の調整前の発効日。	YYYY-MM-DD (UTC)	コンファメーションに記載がない場合、Execution date(約定日)を報告。 もしくは、Trade Dateを報告。 そのほか、各金融機関の内部管理上の定義によることを許容。	CDE	2.1
2	Expiration date		満期日	コンファメーションに記載されている、店頭デリバティブ取引に係る債務の効力が停止する調整前の満期日。中途解約を除く。	YYYY-MM-DD (UTC)	中途解約した際、Early termination date欄に中途解約日を入力し、当初の契約締結時点で定めた満期日は引き続きExpiration date欄に記載する。	CDE	2.2
3	Early termination date		中途解約日	報告済みの取引の中途解約(失効)の発効日。このデータ項目は、満期前に取引当事者が行った決定により、満期前に取引が終了した場合に適用される。 中途解約の(失効)の例は以下のとおり。 ・交渉による中途解約 ・中途解約に係る任意条項に基づく中途解約 ・更改、相殺(ネットリング)取引 ・オプション行使 ・コンプレッション ・当初の契約に規定されているコーラブルスワップである中途解約条項 ・mutual credit break	YYYY-MM-DD (UTC)	中途解約には、オプション行使が含まれる(Swaptionを含む)。アメリカンタイプなど期中にいつでも権利行使が可能なオプション契約について権利行使する場合は該当。権利行使した場合にその効力発生日を入力する。 相殺(ネットリング)取引(offsetting (netting) transaction、取引を両建てすることにより、取引に対するリスクをフラットにする取引)は、解約と同じ効果をもたらすが、金融機関においてポジションが解約されない限りは報告不要とする。	CDE	2.3
4	Reporting timestamp		報告タイムスタンプ	取引情報蓄積機関等への報告の提出日時。 報告者が対応。	YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ (UTC)	システム入力時間、データ生成時間、システム連携時間についても許容値とする。 また、システムの制約等により時間(秒等)までの把握が不可能の場合には、時間以下を「00」とすることについても許容値とする。 実務上同じ日時と判断できる場合には、Trade Date等で代替することを可。(異なる場合には代替は不可)	CDE	2.4
5	Execution timestamp		執行タイムスタンプ	当初取引が執行された日時。 取引の結果新しいUTIが生成される。このデータ項目は、UTIの存続期間を通して変わらない。	YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ (UTC)	システム入力時間、データ生成時間、システム連携時間についても許容値とする。 また、システムの制約等により時間(秒等)までの把握が不可能の場合には、時間以下を「00」とすることについても許容値とする。 実務上同じ日時と判断できる場合には、Trade Date等で代替することを可。(異なる場合には代替は不可)	CDE	2.5

	Data Element Name	Leg1,Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	#
6	Entity responsible for reporting		報告義務者	報告義務者である金融機関等の識別子。	LEIコード Char (20)	報告者は、Entity responsible for reporting及び12「Submitter identifier」で特定。 報告例 【ケース1】取引当事者がファンド以外の場合(通常のケース) ・「Entity responsible for reporting」=報告義務者であり取引当事者の金融機関LEI ・「Counterparty 1 (reporting counterparty)」=同上 ・「Submitter identifier」=同上 【ケース2】取引当事者がファンドの場合 ・「Entity responsible for reporting」=信託銀行LEI ・「Counterparty 1 (reporting counterparty)」=ファンドLEI ・「Submitter identifier」=信託銀行LEI 【ケース3】報告者が代理等の場合(地銀等が信託銀行等に報告を依頼している場合) ・「Entity responsible for reporting」=報告義務者であり取引当事者の金融機関LEI ・「Counterparty 1 (reporting counterparty)」=同上 ・「Submitter identifier」=代理等のサービスプロバイダLEI	ESMA	3
7	Counterparty 1 (reporting counterparty)		取引当事者1(報告主体)	報告において報告義務を有する店頭デリバティブ取引の取引当事者の識別子。両当事者が取引を報告しなければならない法域では、取引当事者1の識別子が、常に報告主体たる取引当事者の識別子となる。ファンド・マネジャーがファンドに代わって執行したデリバティブ取引をアロケーションする場合、ファンド・マネジャーではなくファンドが取引当事者として報告される。	LEIコード Char (20) ファンドはファンドのLEIを報告。		CDE	2.6
8	Counterparty 2		取引当事者2	店頭デリバティブ取引の第二の取引当事者の識別子。ファンド・マネジャーがファンドに代わって執行したデリバティブ取引をアロケーションする場合、ファンド・マネジャーではなくファンドが取引当事者として報告される。	LEIコード Char (20) Varchar(72) ※取引当事者2識別子タイプは"false"となる。 ファンドはファンドのLEIを報告。	LEIを取得できない場合には、仮LEIを許容。 当事者特定のため、仮LEIは、任意の一意の英数字である必要がある。 付番例 【金融機関の場合】 仮LEI= 取引当事者LEI+相手先BICコード 【事業法人・個人等の場合】 仮LEI= 取引当事者LEI+一意の英数字(金融機関内の管理番号等) ファンドLEIがまだ取得できていない場合は、信託銀行はファンドの仮LEI(信託銀行LEI+一意の英数字)を取引先金融機関に共有する。 金融庁告示第105号に規定されている清算機関と取引をした場合には清算機関のLEIを記入。	CDE	2.7

	Data Element Name	Leg1,Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	#
9	Counterparty 2 identifier type		取引当事者2識別子タイプ(LEIか否か)	取引当事者2を識別するためにLEIを使用したか否かの区分。	真偽二択 (Boolean: True or False) ・LEIを使用 True ・LEI以外 False	CDEガイドスでは、法人の場合にはTrue,個人の場合にはFalseと分類されることになるが、日本の場合には法人であっても仮LEIが許容され、その場合には「False」を選択する。	CDE	2.8
10	Direction 1 (Buyer/Seller)		取引の方向1 (買主/売主)	取引当事者1が買主か売主かを示す指標。 このデータ項目が適用される可能性のある商品例のリスト(ただし、網羅的ではない。)は、以下のとおり。 ・大半のフォワード契約及びフォワード類似契約(外国為替フォワード及び外国為替ノンデリバブル・フォワード契約を除く。) ・スワップション、キャップ、フロアを含む、大半のオプション契約及びオプション類似契約 ・クレジット・デフォルト・スワップ(プロテクションの売り手と買い手) ・バリエーション (variance) スワップ、ボラティリティ(volatility)スワップ、コリレーション (correlation) スワップ ・差金決済及びスプレッドベット (spreadbets) このデータ項目は、データ項目「取引の方向2」の対象となる商品の種類には適用されない。	Char(4) ・BYER = buyer ・SLLR = seller		CDE	2.13.1
11	Direction 2 (Payer/Receiver)	Leg1,Leg2	取引の方向2 (支払人/受取人)	取引当事者1が、取引時に決定された各レグの支払者か受取人かを示す指標。 このデータ項目が適用できる商品例のリスト(ただし、網羅的ではない)は、以下のとおり。 ・大半のスワップ及び類似契約(金利スワップ、クレジット・トータル・リターン・スワップ、エクイティ・スワップ(クレジット・デフォルト・スワップ、バリエーション、ボラティリティ、コリレーションスワップを除く。)など) ・外国為替スワップ、フォワード、ノンデリバブル・フォワード このデータ項目は、データ項目「取引の方向1」の対象となる商品の種類には適用されない。	Char(4) ・MAKE = payer (for each Leg) ・TAKE = receiver (for each Leg)		CDE	2.13.2
12	Submitter identifier		送信者識別子	取引情報蓄積機関等にデータを送信するエンティティの識別子。 送信者識別子は、第三者のサービスプロバイダーを使用してデータを取引情報蓄積機関に送信する場合を除き、取引当事者1と同じになる。ただし第三者のサービスプロバイダーを使用した場合、第三者のサービスプロバイダーの識別子を報告すること。	LEIコード Char (20)	6「Entity responsible for reporting」を参照。 清算機関又は金融機関が該当。 照合プラットフォーム等を使用して報告している場合は当該プラットフォーム等が報告。	CFTC	22
13	New SDR identifier		新しいSDR識別子	取引が移管される新しい取引情報蓄積機関等がある場合の当該取引情報蓄積機関等の識別子。	LEIコード Char (20)	該当無い場合は空欄で問題ない。	CFTC	105
14	Original swap SDR identifier		元のスワップ SDR識別子	元のスワップが報告された取引情報蓄積機関等の識別子。	LEIコード Char (20)	清算機関又は金融機関が報告。	CFTC	9

	Data Element Name	Leg1,Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	
								#
15	Cleared		清算済み	取引が清算集中されたか、清算が予定されているかの区分。	<ul style="list-style-type: none"> ・ Y=yes、ベータ及びガンマの取引について、清算集中されている。 ・ N=no、清算集中されていない。 ・ I=清算機関による清算を行う予定のアルファ取引について、清算の意思あり。 	<p>システム上、「I」の判別が難しい場合などには、「N」として報告することを許容。</p> <p>N又はIの場合に金融機関が報告、Yesの場合は清算機関が報告。ただし、金融庁告示第105号に規定されている清算機関と取引をした場合には、清算取引ではあるが、バイラテ取引として金融機関が取引情報を報告。</p> <p>金融庁告示第105号に規定されている清算機関と取引をした場合の報告例は以下のとおり。</p> <p>(報告例:以下の項目は必須)</p> <p>15 Cleared Y 16 Central counterparty 清算機関のLEI 17 Clearing member LEI 22 Clearing account origin 本人か代理か 23 Original swap UTI α取引のUTI</p>	CDE	2.14
16	Central counterparty		清算機関	取引を清算した清算機関の識別子。 このデータ項目は、データ項目「清算済みか否か(Cleared)」の値が「N」(「No、清算集中されていない」)又は「I」(Intend、清算の意志あり)である場合には適用されない。	LEIコード Char(20)	清算機関が報告。ただし、金融庁告示第105号に規定されている清算機関と取引をした場合には、清算取引ではあるが、バイラテ取引として金融機関が取引情報を報告。	CDE	2.15
17	Clearing member		清算会員	<p>清算機関においてデリバティブ取引を清算した清算会員の識別子。 このデータ項目は、エージェンシー・クリアリング・モデルとプリンシパル・クリアリング・モデルの両方において、清算された取引に適用される。 プリンシパル・クリアリング・モデルの場合、清算から生じる次の両取引において、清算会員は、清算会員であるとともに取引当事者として識別される。</p> <p>(i) 清算機関と清算会員との間の取引、 (ii) 清算会員と当初のアルファ取引の取引当事者との間の取引</p> <p>エージェンシー・クリアリング・モデルの場合、清算会員は、清算から生じる取引の清算会員として識別されるが、当該取引の取引当事者としては識別されない。このモデルでは、取引当事者は、清算機関と顧客である。</p> <p>このデータ項目は、データ項目「清算済みか否か(Cleared)」の値が「N」(「No、清算集中されていない」)又は「I」(Intend、清算の意志あり)である場合には適用されない。</p>	LEIコード Char(20)	清算機関が報告。ただし、金融庁告示第105号に規定されている清算機関と取引をした場合には、清算取引ではあるが、バイラテ取引として金融機関が取引情報を報告。 (クリアリングブローカーを通じて清算集中する場合は、クリアリングブローカーの識別子を報告。)	CDE	2.16

	Data Element Name	Leg1,Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	#
18	Platform identifier		プラットフォーム識別子	取引が執行されたトレーディング・ファシリティ(例:多角的トレーディング・ファシリティ、スワップ執行ファシリティ)の識別子。	ISO 10383セグメントMICコード Char(4) トレーディング・ファシリティを通じて取引が行われていない場合 ・上場商品の取引の場合、XOFF ・いずれの取引所にも上場されていない商品の取引の場合、XXXX ・商品が上場されているか否かを、法域の要件に従って報告主体の取引当事者が判断できない場合、BILT	スワップ執行ファシリティとして日本の場合は電子取引基盤運営業者が該当。米欧などのファシリティを使用した場合も該当する場合は報告が必要。 CDE及びCFTCテクニカル・スペシフィケーションの定義は「例」としてMTFやSEFを挙げているが、それらに限定していない。よって、日本の電子取引基盤運営業者も含めたうえで、定義の例示を参考に報告されたい。	CDE	2.17
19	Confirmed		コンファメーションの有無	(「CPMI-IOSCOのテクニカル・ガイダンス:固有取引識別子の調和」の定義による)新規の報告対象取引について、店頭デリバティブ契約の法的拘束力のある条件が文書化され、合意(確認)されているか、合意(確認)されていないか。文書化され、合意されている場合、確認が以下により行われているか。 ・共用のコンファメーションファシリティ、プラットフォーム、又はプライベート/バイラテラル電子システム(電子的) ・FAX、紙、手動処理された電子メールなど、人間が読める文書(電子的でない)	・ NCNF = unconfirmed (未確認) ・ ECNF = electronic (電子的) ・ YCNF = non-electronic (電子的でない)	紙コンファメーションで照合状況の把握が困難の場合には、契約合意(DONE)をもってコンファーム(YCNF)として報告することを許容。ただし、DONE後に速やかにコンファームとなる態勢が整備されている場合に限る。 紙コンファメーション合意まで期間を要することがあらかじめ判明している場合については、原則どおり、NCNF(未確認)で報告のうえ、合意後にYCNF(電子的でない)に変更することが必要である。	CDE	2.18
20	Final contractual settlement date		最終契約決済日	契約上の調整前の決済日。この日までに全ての現金又は資産の移転が行われ、取引当事者は相互に契約上の未払債務を有しないことになる。 契約上の最終決済日が設定されていない商品(例:アメリカン・オプション)については、このデータ項目には、満期日に取引が終了された場合に現金又は資産の移転が行われる日が反映される。	YYYY-MM-DD(UTC)		CDE	2.19
21	Settlement currency	Leg1,Leg2	決済通貨	該当する場合、取引の現金決済のための通貨。 ネットされない複数通貨建て商品については、各レグの決済通貨。 このデータ項目は、現物決済される商品(例:現物決済されるスワップション)には適用されない。	ISO 4217 Char(3)	オフショア通貨はオンショア通貨として報告。 ネットされない複数通貨建て商品(JPYと外貨を交換する通貨スワップ)の場合、報告データが受けと払いの2レコードでの報告になる。	CDE	2.20
22	Clearing account origin		清算口座元	清算会員がハウス取引の本人として行動したか、顧客取引の代理人として行動したかを示す指標。	・ HOUS=ハウス ・ CLIE=クライアント	清算機関が報告。ただし、金融庁告示第105号に規定されている清算機関と取引をした場合には、清算取引ではあるが、バイラテ取引として金融機関が取引情報を報告。	CFTC	3

	Data Element Name	Leg1, Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	#
23	Original swap UTI		オリジナルスワップUTI	清算スワップによって置き換えられるデリバティブ清算機関(DCO)に清算のために提出された元のスワップの一意のトランザクション識別子(UTI)。	Varchar(52) UTI	清算機関が報告。ただし、金融庁告示第105号に規定されている清算機関と取引をした場合には、清算取引ではあるが、バイラテ取引として金融機関が取引情報を報告。	CFTC	8
24	Clearing receipt timestamp		清算受領タイムスタンプ	元のスワップが清算のためにデリバティブ清算機関(DCO)によって受信され、DCOのシステムによって記録された日時。	YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ (UTC)	清算機関が報告。ただし、金融庁告示第105号に規定されている清算機関と取引をした場合には、清算取引ではあるが、バイラテ取引として金融機関が取引情報を報告。	CFTC	10
25	Unique transaction identifier (UTI)		固有取引識別子(UTI)	UTIを報告。	Varchar(52) UTI		CFTC	103
26	Prior UTI (for one-to-one and one-to-many relations between transactions)		過去のUTI(取引間が1対1及び1対多の関係)	取引間の1対1の関係(例:更改、取引終了時、新規取引発生時)、又は取引間の1対複数の関係(例:清算時又は取引が複数の異なる取引に分割されている場合)におけるライフサイクル・イベントによって、報告対象の取引を生じさせた過去の取引に割り当てられたUTI。 このデータ項目は、取引間の複数対1及び複数対複数の関係(例:コンプレッションの場合)を報告する場合には適用されない。	Varchar(52) UTI	ノベーションといった1対多、1対1の契約更改の場合に適用される。 ノベーションの他にもスワップションのスワップを権利行使したことによる新規取引や清算機関が報告する清算取引(β、γ取引)に付される。 ノベーションの場合、新しく取引に入ってきた金融機関(ステップイン・パーティ)の場合においても報告。 ただし、過去の取引においてそもそもUTIが付番されていないなど、物理的にPrior UTIの設定が困難な場合には仮Prior UTI(各金融機関が独自に設定する一意の番号)とすることを許容。	CDE	2.96

	Data Element Name	Leg1,Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	#
27	Day count convention	Fixed rate day count convention Leg1,Leg2 Floating rate day count convention Leg1Leg2	日数計算コンベンション	取引の各レグについて、該当する場合:支払利息の計算方法を決定する日数計算コンベンション(デイカウント・フラクション、デイカウント・ベース、デイカウント・メソッドとも呼ばれる)。計算期間における日数が1年に占める割合の計算に使用し、計算期間の日数をその年の日数で除して表示される。	Char(4) ・ A001 ・ A002 ・ A003 ・ A004 ・ A005 ・ A006 ・ A007 ・ A008 ・ A009 ・ A010 ・ A011 ・ A012 ・ A013 ・ A014 ・ A015 ・ A016 ・ A017 ・ A018 ・ A019 ・ A020 ・ NARR 許容値の内容については、別表1を参照。	固定・変動、Leg1,Leg2で項目を作成。	CDE	2.22
28	Payment frequency period	Fixed rate payment frequency period Leg1,Leg 2 Floating rate payment frequency period Leg 1,Leg 2	支払頻度	取引の各レグについて、該当する場合:支払頻度に関する時間単位(例えば、日、週、月、年、又はストリームの期間)。	Char(4) ・ DAIL=日次 ・ WEEK=週次 ・ MNTH=月次 ・ YEAR=年次 ・ ADHO=都度(支払が不定期な場合に適用される) ・ EXPI=期間終了後の支払	固定・変動、Leg1,Leg2で項目を作成。	CDE	2.23
29	Payment frequency period multiplier	Fixed rate payment frequency multiplier Leg 1,Leg 2 Floating rate payment frequency multiplier Leg 1,Leg 2	支払頻度乗数	取引の各レグについて、該当する場合:定期的な支払日の頻度を決定する時間単位(支払頻度で表される)の回数。例えば、支払頻度が2カ月ごとの取引は、支払頻度「MNTH」(月次)と支払頻度乗数2で表される。このデータ項目は、支払頻度が「ADHO」の場合は適用されない。支払頻度が「EXPI」の場合、支払頻度乗数は1である。支払頻度が日中の場合、支払頻度は「DAIL」であり、支払頻度乗数は0となる。	ゼロ以上の任意の値。 Num(3,0)	固定・変動、Leg1,Leg2で項目を作成。	CDE	2.24

	Data Element Name	Leg1,Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	#
30	Fixing date	Leg1,Leg2	確定日	最終的な現金決済を計算するために使用される、特定の為替レートに対して「固定」される現金決済オプション、ノンデリバブルフォワードなどの様々な種類のFX OTCオプションが発生する具体的な日付。	YYYY-MM-DD(UTC)		CFTC	54
31	Floating rate reset frequency period	Leg1,Leg2	変動金利のリセット頻度周期	取引の各フローティングレグ毎に、該当する場合、リセットの頻度に関連付けられた時間単位(たとえば、日、週、月、年、又はストリームの期間)。	Char(4) ・DAIL=日次 ・WEEK=週次 ・MNTH=月次 ・YEAR=年次 ・ADHO=都度(支払いが不定期な場合に適用される) ・EXPI=期間終了後の支払い		CFTC	55
32	Floating rate reset frequency period multiplier	Leg1,Leg2	変動金利のリセット頻度周期乗数	取引の各フローティングレグ毎に、該当する場合、リセットの定期的な支払い日が発生する頻度を決定する時間単位の数(変動レートのリセット頻度期間で表される)。たとえば、2か月ごとにリセット支払いが発生するトランザクションは、変動金利リセット頻度期間「MNTH」(月次)と変動金利リセット頻度期間乗数2で表される。変動相場制のリセット頻度期間が「ADHO」の場合、このデータ要素は適用されない。変動金利リセット頻度期間が「EXPI」の場合、変動金利リセット頻度期間乗数は1である。リセット頻度期間が日中の場合、変動金利リセット頻度期間は「DAIL」であり、リセット頻度周期乗数は0となる。	ゼロ以上の任意の値。 Num(3,0)		CFTC	56
33	Other payment amount		その他の支払いの額	異なるアセットクラスの取引の記載要件を満たすための、対応する支払いタイプに係る支払いの額。	Num(25,5)	元本交換は支払い両方を報告する。 元本交換を行う通貨スワップについて、Mark-to-Market型の取引における、元本額の洗替に伴い発生する元本額の差額についての取扱い例は以下のとおり。 例: はじめのドル元本が1で約定時のスポットが110だとすると、円元本は110で固定。仮に利払を3か月とし、3か月後のスポットが100とすると、新しいドル元本は、固定されている円元本110をスポット100で割った1.1となり、当該ドル元本の変動分(0.1)を受け払いする。 洗替の際には、 ・差額をother payment amountで報告 ・「modify」、other payment typeは「PEXH」で報告 また、その際、notional amountで洗替後の元本額を報告。 上記例だと、 Notional Amount: USD 1.1 Other payment Type: PEXH Other payment amount: USD 0.1	CDE	2.83

	Data Element Name	Leg1,Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	#
34	Other payment type		その他の支払いタイプ	その他の支払額のタイプ。オプション・プレミアムの支払いは、オプション・プレミアム固有のデータ項目を用いて報告されるため、支払タイプには含まれない。	Char(4) ・UFRO=アップフロント・ペイメント(取引を公正価値にするために、又は市場外取引が行われる原因となる可能性のあるその他の理由による、一方の取引当事者による最初の支払い) ・UWIN=アンワインド又は全部解約(取引が終了日前にアンワインドされた場合の最終的な決済支払い、デリバティブ取引の全部解約により生じる可能性のある支払い) ・PEXH=元本の交換(クロスカレンシー・スワップの想定元本の交換)	元本交換は受払い両方を報告する予定。	CDE	2.84
35	Other payment currency		その他の支払いの通貨	その他の支払額が表示される通貨。	ISO 4217 Char(3)		CDE	2.85
36	Other payment date		その他の支払い日	その他の支払額が支払われる調整前の日。	YYYY-MM-DD(UTC)		CDE	2.86
37	Other payment payer		その他の支払いの支払人	その他の支払額の支払人の識別子。	LEIコード Char(20) なお、LEIを取得できない場合には、仮LEIを許容。(Varchar(72))	【金融機関の場合】 仮LEI=取引当事者LEI+相手先BICコード 【事業法人・個人等の場合】 仮LEI=取引当事者LEI+一意の英数字(金融機関内の管理番号等) 当事者特定のため、仮LEIは、任意の一意の英数字である必要がある。ファンドはファンドのLEIを報告。	CDE	2.87

	Data Element Name	Leg1,Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	#
38	Other payment receiver		その他の支払いの受取人	その他の支払額の受取人の識別子。	LEIコード Char(20) なお、LEIを取得できない場合には、仮LEIを許容。 (Varchar(72))	【金融機関の場合】 仮LEI= 取引当事者LEI+相手先BICコード 【事業法人・個人等の場合】 仮LEI= 取引当事者LEI+一意の英数字(金融機関内の管理番号等) 当事者特定のため、仮LEIは、任意の一意の英数字である必要がある。ファンドはファンドのLEIを報告。	CDE	2.88
39	Valuation amount		評価額	評価調整を一切適用しない未決済契約の現在価値。	任意の値。 Num(25.5)	評価額は、CVA(Credit Valuation Adjustment)等の各種評価調整を考慮しない。評価調整前の評価額を報告。	CDE	2.25
40	Valuation currency		評価通貨	評価額の表示通貨。	ISO 4217 Char(3)		CDE	2.26
41	Valuation timestamp		評価タイムスタンプ	清算機関が提供した、又は現時点若しくは入手可能な最新のインプットである市場価格を用いて算定された、最新の時価評価の日付と時刻。例えば、為替レートが取引の評価基準である場合、評価タイムスタンプは、評価時における最新の為替レートの時点を反映する。	YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ (UTC)	評価作成時間での報告等、各金融機関が定めた評価時間での報告を許容。	CDE	2.27
42	Valuation method		評価方法	報告主体の取引当事者が評価に使用した情報源及び手法。 別表2において用いている評価インプットのうち1つ以上がmark-to-modelに分類されている場合、評価全体をmark-to-modelに分類する。 別表2でmark-to-marketとして分類されるインプットのみを用いている場合、評価全体をmark-to-marketとする。	Char(4) ・ MTMA=市場時価による時価評価(mark-to-market) ・ MTMO=評価モデルによる時価評価(mark-to-model) ・ CCPV=清算機関による評価別表2(評価インプット)参照		CDE	2.28
44	Collateral portfolio indicator		担保付ポートフォリオの区分	担保設定がポートフォリオごとに行われたか否かを示す区分。「ポートフォリオごと」とは、個々の取引ごとに証拠金が設定されるものではなく、(ネットベース又はグロスベースのいずれかにより)一緒に証拠金が設定される一連の取引を意味する。	真偽二択 (Boolean: True or False) ・ ポートフォリオごとに担保が設定されている場合には、True ・ ポートフォリオの一部について担保が設定されている場合には、False	各カウンターパーティごとに担保が設定されている場合、Trueとなる。 担保設定の有無はCSA契約の有無が想定されるが、CSA契約以外の独自に作成した担保契約も含まれる。 現在の残高が1件のみであったとしても、複数件の取引が担保対象になる担保契約を締結している場合はTrueとなる。	CDE	2.29

	Data Element Name	Leg1,Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	#
45	Initial margin posted by the reporting counterparty (pre-haircut)		報告主体の取引当事者が差し入れた当初証拠金 (ヘアカット前)	報告主体の取引当事者が差し入れた当初証拠金の金額。受渡しが完了していない未決済の証拠金を含むが、法域の要件において、当該証拠金を含めることが認められていない場合は除く。担保設定がポートフォリオごとに行われる場合、差入当初証拠金はポートフォリオ全体に関連する。担保設定が単一の取引に対して行われる場合、差入当初証拠金は、当該単一の取引に関連する。 これは、日次の変動ではなく、当初証拠金の現在価値の合計を指す。 データ項目は、清算されていない取引と清算集中された取引の両方を指す。 清算集中された取引の場合、データ項目には、デフォルト・ファンド拠出金又は清算機関に供与された流動性に対して差し入れた担保 (すなわち、コミットメント・クレジット・ライン) は含まれない。 差入当初証拠金が複数の通貨建ての場合、その金額は、報告主体の取引当事者が選定した単一通貨に換算され、一つの合計額として報告される。	ゼロ以上の任意の値。 Num(25,5)	担保報告は、取引報告と別に報告となる。ポートフォリオで担保を設定している場合、担保報告の際に、ポートフォリオコードと担保額 (総額) を一本報告する。	CDE	2.31
46	Initial margin posted by the reporting counterparty (post-haircut)		報告主体の取引当事者が差し入れた当初証拠金 (ヘアカット後)	報告主体の取引当事者が差し入れた当初証拠金の金額。受渡しが完了していない未決済の証拠金を含むが、法域の要件においてこのような証拠金を含めることが認められていない場合は除く。担保設定がポートフォリオごとに行われる場合、差入当初証拠金はポートフォリオ全体に関連する。担保設定が単一の取引に対して行われる場合、差入当初証拠金は、当該単一の取引に関連する。 これは、日次の変動ではなく、ヘアカット適用後 (適用される場合) の当初証拠金の現在価値の合計を指す。 データ項目は、清算されていない取引と清算集中された取引の両方を指す。 清算集中された取引の場合、データ項目には、デフォルト・ファンド拠出金又は清算機関に供与された流動性に対して差し入れた担保 (すなわち、コミットメント・クレジット・ライン) は含まれない。 差入当初証拠金が複数の通貨建ての場合、その金額は、報告主体の取引当事者が選定した単一通貨に換算され、一つの合計額として報告される。	ゼロ以上の任意の値。 Num(25,5)	担保報告は、取引報告と別に報告となる。ポートフォリオで担保を設定している場合、担保報告の際に、ポートフォリオコードと担保額 (総額) を一本報告する。	CDE	2.32
47	Currency of initial margin posted		差し入れた当初証拠金の計上通貨	差入当初証拠金の通貨。 差入当初証拠金が複数の通貨建ての場合、このデータ項目は、報告主体の取引当事者が差入当初証拠金の全ての価値を換算するために選定した通貨を表す。	ISO 4217 Char(3)		CDE	2.33
48	Initial margin collected by the reporting counterparty (pre-haircut)		報告主体の取引当事者が徴求した当初証拠金 (ヘアカット前)	報告主体の取引当事者が徴求した当初証拠金の金額。受渡しが完了していない未決済の証拠金を含むが、法域の要件においてこのような証拠金を含めることが認められていない場合は除く。担保設定がポートフォリオごとに行われる場合、徴求した当初証拠金はポートフォリオ全体に関連する。担保設定が単一の取引に対して行われる場合、徴求した当初証拠金は、当該単一の取引に関連する。 これは、日次の変動ではなく、当初証拠金の現在価値の合計を指す。 データ項目は、清算されていない取引と清算集中された取引の両方を指す。 清算集中された取引の場合、データ項目には、投資活動の一貫として清算機関が徴求した担保は含まれない。 徴求した当初証拠金が複数の通貨建ての場合、その金額は、報告主体の取引当事者が選定した単一通貨に換算され、一つの合計額として報告される。	ゼロ以上の任意の値。 Num(25,5)	担保報告は、取引報告と別に報告となる。ポートフォリオで担保を設定している場合、担保報告の際に、ポートフォリオコードと担保額 (総額) を一本報告する。	CDE	2.34

	Data Element Name	Leg1,Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	
								#
49	Initial margin collected by the reporting counterparty (post-haircut)		報告主体の取引当事者が徴求した当初証拠金の金額 (ヘアカット後)	報告主体の取引当事者が徴求した当初証拠金の金額。受渡しが完了していない未決済の証拠金を含むが、法域の要件においてこのような証拠金を含めることが認められていない場合は除く。担保設定がポートフォリオごとに行われる場合、徴求した当初証拠金はポートフォリオ全体に関連する。担保設定が単一の取引に対して行われる場合、徴求した当初証拠金は、当該単一の取引に関連する。これは、日次の変動ではなく、ヘアカット適用後(適用される場合)の当初証拠金の現在価値の合計を指す。データ項目は、清算されていない取引と清算集中された取引の両方を指す。清算集中された取引の場合、データ項目には、投資活動の一貫として清算機関が徴求した担保は含まれない。徴求した当初証拠金が複数の通貨建ての場合、その金額は、報告主体の取引当事者が選定した単一通貨に換算され、一つの合計額として報告される。	ゼロ以上の任意の値。 Num(25,5)	担保報告は、取引報告と別に報告となる。ポートフォリオで担保を設定している場合、担保報告の際に、ポートフォリオコードと担保額(総額)を一本報告する。	CDE	2.35
50	Currency of initial margin collected		徴求した当初証拠金の通貨	徴求した当初証拠金の通貨。 徴求した当初証拠金が複数通貨建ての場合、このデータ項目は、報告主体の取引当事者が徴求した当初証拠金の全ての価値を換算するために選定した通貨を表す。	ISO 4217 Char(3)		CDE	2.36
51	Variation margin posted by the reporting counterparty (pre-haircut)		報告主体の取引当事者が差入れた変動証拠金の金額 (ヘアカット前)	報告主体の取引当事者が差入れた変動証拠金(現金決済分を含む。)の金額。受渡しが完了していない未決済の証拠金を含むが、法域の要件においてこのような証拠金を含めることが認められていない場合は除く。偶発的な変動証拠金は含まれない。担保設定がポートフォリオごとに行われる場合、差入変動証拠金はポートフォリオ全体に関連する。担保設定が単一の取引に対して行われる場合、差入変動証拠金は、当該単一の取引に関連する。このデータ項目は、ポートフォリオ又は取引に対して差入れられた変動証拠金を最初に報告して以降累積された変動証拠金の現在価値の合計を指す。差入変動証拠金が複数の通貨建ての場合、その金額は、報告主体の取引当事者が選定した単一通貨に換算され、一つの合計額として報告される。	ゼロ以上の任意の値。 Num(25,5)	担保報告は、取引報告と別に報告となる。ポートフォリオで担保を設定している場合、担保報告の際に、ポートフォリオコードと担保額(総額)を一本報告する。	CDE	2.37
52	Variation margin posted by the reporting counterparty (post-haircut)		報告主体の取引当事者が差入れた変動証拠金の金額 (ヘアカット後)	報告主体の取引当事者が差入れた変動証拠金(現金決済分を含む。)の金額。受渡しが完了していない未決済の証拠金を含むが、法域の要件においてこのような証拠金を含めることが認められていない場合は除く。偶発的な変動証拠金は含まれない。担保設定がポートフォリオごとに行われる場合、差入変動証拠金はポートフォリオ全体に関連する。担保設定が単一の取引に対して行われる場合、差入変動証拠金は、当該単一の取引に関連する。このデータ項目は、ポートフォリオ又は取引に対して差入れられた変動証拠金を最初に報告して以降累積されたヘアカット適用後(適用される場合)の変動証拠金の現在価値の合計を指す。差入変動証拠金が複数の通貨建ての場合、その金額は、報告主体の取引当事者が選定した単一通貨に換算され、一つの合計額として報告される。	ゼロ以上の任意の値。 Num(25,5)	担保報告は、取引報告と別に報告となる。ポートフォリオで担保を設定している場合、担保報告の際に、ポートフォリオコードと担保額(総額)を一本報告する。	CDE	2.38
53	Currency of variation margin posted		差入れた変動証拠金の通貨	差入変動証拠金の通貨。 差入変動証拠金が複数通貨建ての場合、このデータ項目は、報告主体の取引当事者が差入変動証拠金の全ての価値を換算するために選定した通貨を表す。	ISO 4217 Char(3)		CDE	2.39

	Data Element Name	Leg1, Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	
								#
54	Variation margin collected by the reporting counterparty (pre-haircut)		報告主体の取引当事者が徴求した変動証拠金 (ヘアカット前)	報告主体の取引当事者が徴求した変動証拠金 (現金決済分を含む。)の金額。受渡しが完了していない未決済の証拠金を含むが、法域の要件においてこのような証拠金を含めることが認められていない場合は除く。 偶発的な変動証拠金は含まれない。 担保設定がポートフォリオごとに行われる場合、徴求した変動証拠金はポートフォリオ全体に関連する。担保設定が単一の取引に対して行われる場合、徴求した変動証拠金は、当該単一の取引に関連する。 このデータ項目は、ポートフォリオ又は取引に対して徴求した変動証拠金を最初に報告して以降累積された変動証拠金の現在価値の合計を指す。 徴求した変動証拠金が複数の通貨建ての場合、その金額は、報告主体の取引当事者が選定した単一通貨に換算され、一つの合計額として報告される。	ゼロ以上の任意の値。 Num(25,5)	担保報告は、取引報告と別に報告となる。ポートフォリオで担保を設定している場合、担保報告の際に、ポートフォリオコードと担保額 (総額) を一本報告する。	CDE	2.40
55	Variation margin collected by the reporting counterparty (post-haircut)		報告主体の取引当事者が徴求した変動証拠金 (ヘアカット後)	報告主体の取引当事者が徴求した変動証拠金 (現金決済分を含む。)の金額。受渡しが完了していない未決済の証拠金を含むが、法域の要件においてこのような証拠金を含めることが認められていない場合は除く。 偶発的な変動証拠金は含まれない。 担保設定がポートフォリオごとに行われる場合、徴求した変動証拠金はポートフォリオ全体に関連する。担保設定が単一の取引に対して行われる場合、徴求した変動証拠金は、当該単一の取引に関連する。 このデータ項目は、ポートフォリオ又は取引に対して徴求した変動証拠金を最初に報告して以降累積されたヘアカット適用後 (適用される場合) の変動証拠金の現在価値の合計を指す。 徴求した変動証拠金が複数の通貨建ての場合、その金額は、報告主体の取引当事者が選定した単一通貨に換算され、一つの合計額として報告される。	ゼロ以上の任意の値。 Num(25,5)	担保報告は、取引報告と別に報告となる。ポートフォリオで担保を設定している場合、担保報告の際に、ポートフォリオコードと担保額 (総額) を一本報告する。	CDE	2.41
56	Currency of variation margin collected		徴求した変動証拠金の通貨	徴求した変動証拠金の通貨。 徴求した変動証拠金が複数通貨建ての場合、このデータ項目は、報告主体の取引当事者が徴求した変動証拠金の全ての価値を換算するために選定した通貨を表す。	ISO 4217 Char(3)		CDE	2.42
57	Excess collateral posted by the reporting counterparty		差し入れた超過担保	報告主体の取引当事者が、当初証拠金及び変動証拠金とは別個かつ独立して差し入れた追加証拠金の金額。これは、日次の変動ではなく、ヘアカット適用前 (適用される場合) の超過担保の現在価値の合計を指す。 当初証拠金又は変動証拠金の所要額を上回って差し入れられた当初証拠金又は変動証拠金の額は、差入超過担保に含まれるのではなく、当初証拠金又は変動証拠金の一部として報告される。 清算集中された取引の場合、特定のポートフォリオ又は取引に割り当てることができる場合にのみ、超過担保が報告される。	ゼロ以上の任意の値。 Num(25,5)	定義上、超過担保とは当初証拠金とも変動証拠金とも別に管理されているものとなる。(例: Independent Amount-独立担保額)	CDE	2.43
58	Currency of excess collateral posted		差し入れた超過担保の通貨	差入超過担保の通貨。 差入超過担保が複数通貨建ての場合、このデータ項目は、報告主体の取引当事者が差入超過担保の全ての価値を換算するために選定した通貨を表す。	ISO 4217 Char(3)	定義上、超過担保とは当初証拠金とも変動証拠金とも別に管理されているものとなる。(例: Independent Amount-独立担保額)	CDE	2.44

	Data Element Name	Leg1, Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	
								#
59	Excess collateral collected by the reporting counterparty		徴求した超過担保	報告主体の取引当事者が、当初証拠金及び変動証拠金とは別個かつ独立して徴求した追加証拠金の金額。このデータ項目は、日次の変動ではなく、ヘアカット適用前(適用される場合)の超過担保の現在価値の合計を指す。 当初証拠金、変動証拠金の所要額を上回って徴求された当初証拠金又は変動証拠金の額は、徴求した超過担保に含まれるのではなく、それぞれ当初証拠金又は変動証拠金の一部として報告される。 清算集中された取引の場合、特定のポートフォリオ又は取引に割り当てることができる場合にのみ、超過担保が報告される。	ゼロ以上の任意の値。 Num(25,5)	定義上、超過担保とは当初証拠金とも変動証拠金とも別に管理されているものとなる。(例:Independent Amount-独立担保額)	CDE	2.45
60	Currency of excess collateral collected		徴求した超過担保の通貨	徴求した超過担保の通貨。 徴求した超過担保が複数通貨建ての場合、このデータ項目は、報告主体の取引当事者が徴求した超過担保の全ての価値を換算するために選定した通貨を表す。	ISO 4217 Char(3)	定義上、超過担保とは当初証拠金とも変動証拠金とも別に管理されているものとなる。(例:Independent Amount-独立担保額)	CDE	2.46
61	Collateralisation category		担保区分	取引当事者間の担保契約の有無(無担保/部分担保/一方担保/全額担保)を示す区分。このデータ項目は、取引又はポートフォリオごとに担保設定が行われているかどうかに応じて、各取引又は各ポートフォリオについて提供され、清算集中された取引と清算されていない取引の両方に適用される。	Char(4) 別表3から選択		CDE	2.47
62	Initial margin collateral portfolio code		当初証拠金担保ポートフォリオコード	担保がポートフォリオベースで報告される場合、一連の取引に関連する総当初証拠金を追跡するポートフォリオに報告主体の取引当事者によって割り当てられた一意のコード。 このデータ要素は、担保が取引レベルで実行された場合、担保契約がない場合、又は担保が差し入れ若しくは受領されていない場合は適用されない。 ポートフォリオコードは、2つのデータセットをリンクするために、担保報告と時価評価報告の両方に必要。	Varchar(52)	各金融機関が定めるそれぞれのコードを報告。 取引先毎に担保を設定している場合には、取引先毎のコードを報告。	CFTC	116
63	Variation margin collateral portfolio code		変動証拠金担保ポートフォリオコード	担保がポートフォリオベースで報告される場合、一連の取引に関連する総変動証拠金を追跡するポートフォリオに報告主体の取引当事者によって割り当てられた一意のコード。 このデータ要素は、担保が取引レベルで実行された場合、担保契約がない場合、担保が差し入れ又は受領されていない場合は適用されない。 ポートフォリオコードは、2つのデータセットをリンクするために、担保報告と時価評価報告の両方に必要。	Varchar(52)	各金融機関が定めるそれぞれのコードを報告。 取引先毎に担保を設定している場合には、取引先毎のコードを報告。	CFTC	124

	Data Element Name	Leg1,Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	#
64	Price		価格	<p>店頭デリバティブ取引において特定された価格。これには、報酬、税金又は手数料は含まれない。</p> <p>エクイティ・フォワード及びこれらの類似商品については、このデータ項目は、原資産又は参照資産のフォワード価格を指す。</p> <p>エクイティ・スワップ、ポートフォリオ・スワップ及びこれらの類似商品については、このデータ項目は、原資産又は参照資産の当初価格を指す。</p> <p>差金決済取引及び類似商品については、このデータ項目は、原資産の当初価格を指す。</p> <p>このデータ項目は、以下には適用されない。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・金利スワップ及び金利先渡契約：データ項目「固定金利」及び「スプレッド」に含まれる情報が、取引の価格として解釈することができるため。 ・金利オプション及び金利スワップオプション：データ項目「行使価格」及び「オプション・プレミアム」に含まれる情報が、取引の価格として解釈することができるため。 ・為替スワップ、為替フォワード、通貨オプション：「為替レート」「行使価格」「オプション・プレミアム」などのデータ項目に含まれる情報が、取引の価格として解釈することができるため。 ・株式オプション：データ項目「行使価格」及び「オプション・プレミアム」に含まれる情報が、取引の価格として解釈することができるため。 ・クレジット・デフォルト・スワップ及びクレジット・トータル・リターン・スワップ：データ項目「固定金利」「スプレッド」「アップフロント・ペイメント(その他の支払いタイプ：アップフロント・ペイメント)」に含まれる情報が、取引の価格として解釈することができるため。 <p>新規取引が報告された時点で価格が不明な場合、価格が入手可能となった時点で更新される。取引がパッケージの一部である場合、このデータ項目には、該当する場合、構成要素である取引の価格が含まれる。</p>	<p>・ 価格表記=1である場合、Num(18,13) 任意の値。</p> <p>・ 価格表記=3である場合、Num(11,10) 小数で表される任意の値。(例：2.57%を0.0257と表す)</p>		CDE	2.50
65	Price currency		価格通貨	<p>価格が表示される通貨。</p> <p>価格通貨は、価格表記=1である場合にのみ適用される。</p>	ISO 4217 Char(3)		CDE	2.51
66	Price notation		価格表記	価格の表示方法。	<p>Char(1)</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 1 =金額 ・ 3 =小数 <p>上記の許容値には、法域の要件に基づき、制約が課せられる場合がある(例えば、特定の法域においては、パーセンテージではなく小数で報告することが要求される場合がある。)</p>		CDE	2.52
67	Price unit of measure		価格の表示単位	価格が表示される単位。	<p>Char(4)</p> <p>ISO 20022: UnitOfMeasureCode codeset</p>		CDE	2.53

	Data Element Name	Leg1,Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	#
68	Price schedules – Unadjusted effective date of the price		価格スケジュール -価格の調整前の発効日	取引の期間を通じて価格が変動する店頭デリバティブ取引については、 ・68: 価格の調整前の発効日 ・69: 価格の調整前の終了日 (所定のスケジュールの期間の調整前の終了日が、その後の期間の調整前の発効日と連続している場合には、適用されない。) ・70: 調整前の発効日と調整前の終了日との間の有効な価格 価格スケジュールは、価格がスケジュールによって異なる場合にのみ適用される。 スケジュールにおいて変動する価格の通貨、表記、測定単位は、測定データ項目の 価格通貨、価格表記、価格の表示単位において報告される。	YYYY-MM-DD(UTC)	約定時に価格が変動することが定まっている商品が該当するが、該当無い場合は報告不要。	CDE	254.1
69	Price schedules – Unadjusted end date of the price		価格スケジュール -価格の調整前の終了日		YYYY-MM-DD(UTC)	約定時に価格が変動することが定まっている商品が該当するが、該当無い場合は報告不要。	CDE	254.2
70	Price schedules – Price in effect between the unadjusted effective date and unadjusted end date inclusive		価格スケジュール -調整前の発効日と調整前の終了日との間の有効な価格		・価格表記=1である場合、Num(18,13) ・価格表記=3である場合、Num(11,10)	約定時に価格が変動することが定まっている商品が該当するが、該当無い場合は報告不要。	CDE	254.3
71	Fixed rate	Leg1,Leg2	固定金利	取引の各レグについて、該当する場合: 定期的な支払いのある店頭デリバティブ取引については、固定レグの年利。	・Num(11,10) 正及び負の値を小数(例: 2.57%を0.0257と表す)で表す。	固定金額での受け払いの場合は利率に換算。	CDE	255
72	Spread	Leg1,Leg2	スプレッド	取引の各レグについて、該当する場合、定期的な支払いのある店頭デリバティブ取引(例: 固定/変動金利スワップ、金利ベース・スワップ)について、 ・変動レグのスプレッドが存在する場合、個々の変動レグ・インデックスの基準価格に対するスプレッド。例えば、USD-LIBOR-BBAプラス0.03、又は ・2つの変動レグのインデックス基準価格の差。	・スプレッド表記= 1である場合、Num(18,13) 任意の値。 ・スプレッド表記= 3である場合、Num(11,10) 小数で表される任意の値。 (例: 2.57%を0.0257と表す) ・スプレッド表記= 4である場合、Num(5) ベース・ポイントで表される任意の整数値(例: 2.57%を257と表す)。		CDE	257
73	Spread currency	Leg1,Leg2	スプレッド通貨	取引の各レグについて、該当する場合: スプレッドが表示される通貨。 このデータ項目は、スプレッド表記 = 1である場合にのみ適用される。	ISO 4217 Char(3)		CDE	258

	Data Element Name	Leg1,Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	#
74	Spread notation	Leg1,Leg2	スプレッド表記	取引の各レグについて、該当する場合:スプレッドの表示方法。	Char(1) ・1=金額 ・3=小数 ・4=ベースス・ポイント 上記の許容値には、法域の要件に基づき、制約が課せられる場合がある(例えば、特定の法域においては、パーセンテージではなく小数で報告することが要求される場合がある。)		CDE	2.59
75	Strike price		行使価格	・通貨オプション、スワップション及びこれらの類似商品以外のオプションの場合、オプションの保有者がオプションの原資産を売買できる価格。 ・通貨オプションの場合、オプションを行使できる為替レートであり、単位通貨をクォート通貨に換算した為替レートで表す。例えば、0.9426 USD/EURでは、USDが単位通貨、EURがクォート通貨で、1USD = 0.9426EURである。新規取引が報告された時点で行使価格が不明な場合、行使価格が入手可能となった時点で更新される。 ・ボラティリティ・スワップ、バリアンス・スワップ及びこれらの類似商品については、このデータ項目には、ボラティリティの権利行使価格が報告される。	・行使価格表記=1である場合、Num(18,13) 株式オプション、通貨オプション及びこれらの類似商品について、金額で表される任意の値(例:6.39USD)。 ・行使価格表記=3である場合、Num(11,10.) 金利オプション、スプレッドで値付けされる金利スワップション、クレジット・スワップション及びこれらの類似商品について、小数で表される任意の値(例:2.1%を0.021と表す)。	Strike Priceのスケジュールを有する店頭デリバティブ取引の場合、取引開始時点のStrike Priceを報告。	CDE	2.60
76	Strike price currency/currency pair		行使価格通貨/通貨ペア	株式オプション及び類似商品について、行使価格が表示される通貨。 通貨オプションについては、行使価格が表示される通貨ペアと順序。単位通貨/クォート通貨で表される。0.9426USD/EURの例では、USDは単位通貨、EURはクォート通貨で、1USD = 0.9426EURである。 行使価格通貨/通貨ペアは、行使価格表記=1である場合にのみ適用される。	ISO 4217 Char(3) 通貨オプションの場合: Char(3)/Char(3);[Unit currency/Quoted currency] 通貨ペアの順序は制限されない(すなわち、行使価格通貨ペアは、USD/EUR又はEUR/USDのいずれの場合もある。) ISO 4217に含まれる通貨ペア		CDE	2.61

	Data Element Name	Leg1,Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	
								#
77	Strike price notation		行使価格表記	行使価格の表示方法。	Char(1) ・1 =金額 ・3 =小数 上記の許容値には、法域の要件にもとづき、制約が課せられる場合がある(例えば、特定の法域においては、パーセンテージではなく小数で報告することが要求される場合がある。)		CDE	2.62
78	Strike price schedules – Unadjusted effective date of the strike price		行使価格スケジュール -行使価格の調整前の発効日		YYYY-MM-DD(UTC)	約定時に行使価格が変動することが定まっている商品が該当するが、該当無場合は報告不要。	CDE	2.63.1
79	Strike price schedules – Unadjusted end date of the strike price		行使価格スケジュール -行使価格の調整前の終了日	オプション、スワップション及びこれらの類似商品で、行使価格が取引の期間を通じて変動する場合 ・78: 行使価格の調整前の発効日 ・79: 行使価格の調整前の終了日 (所定のスケジュールの期間の調整前の終了日が、その後の期間の調整前の発効日と連続している場合には、適用されない)	YYYY-MM-DD(UTC)	約定時に行使価格が変動することが定まっている商品が該当するが、該当無場合は報告不要。	CDE	2.63.2
80	Strike price schedules – Strike price in effect between the unadjusted effective date and unadjusted end date inclusive.		行使価格スケジュール -調整前の発効日と調整前の終了日との間の有効な行使価格	・80: 調整前の発効日と調整前の終了日との間の有効な行使価格。 行使価格スケジュールは、行使価格がスケジュールによって異なる場合にのみ適用される。 スケジュール中の変動する行使価格の通貨は、行使価格通貨のデータ項目において報告される。	ゼロ以上の任意の値 ・行使価格表記=1である場合、Num(18,13) 株式オプション、通貨オプション及びこれらの類似商品について、6.39で表される任意の値(例:6.39USD)。 ・行使価格表記=3である場合、Num(11,10) 金利オプション、スプレッドで値付けされる金利スワップション、クレジット・スワップション及びこれらの類似商品について、小数で表される任意の値(例:2.1%を0.021と表す)。	約定時に行使価格が変動することが定まっている商品が該当するが、該当無場合は報告不要。 (Strike Priceが記載されていない場合も報告不要)	CDE	2.63.3
81	Option premium amount		オプションプレミアム額	全てのアセットクラスのオプション及びスワップションについて、オプションの買い手が支払う金額。 このデータ項目は、商品がオプションではない場合、又はオプション性を含まない場合には適用されない。	ゼロ以上の任意の値。 Num(25,5)		CDE	2.64

	Data Element Name	Leg1,Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	#
82	Option premium currency		オプションプレミアム通貨	全てのアセットクラスのオプション及びスワップションについて、オプション・プレミアムの額が表示される通貨。このデータ項目は、商品がオプションではない場合、又はオプション性を包含していない場合には適用されない。	ISO 4217 Char(3)		CDE	2.65
83	Option premium payment date		オプションプレミアム支払い日	オプション・プレミアムの調整前の支払日。	YYYY-MM-DD (UTC)	オプションプレミアムを分割で支払う場合、初回の日付を報告。	CDE	2.66
84	First exercise date		最初の行使日	オプションを行使できる行使期間中の最初の日付(調整前)。ヨーロピアン・オプションの場合、この日付は満期日と同じである。アメリカン・オプションの場合、最初の行使日は、執行タイムスタンプに含まれる調整前の日付となる。ノックイン・オプションの場合、新規取引が報告された時点で最初の行使日が不明な場合、最初の行使日が入手可能となった時点で更新される。このデータ項目は、商品がオプションではない場合、又はオプション性を包含していない場合には適用されない。	YYYY-MM-DD (UTC)		CDE	2.67
85	Exchange rate		為替レート	店頭デリバティブ取引において取引当事者間で取引開始時に合意した異なる2通貨間の為替レート。単位通貨をクォート通貨に換算した為替レートで表す。0.9426 USD/EURの例では、USDが単位通貨、EURがクォート通貨で、1USD = 0.9426EURである。	ゼロ以上の任意の値。 Num(18,13)		CDE	2.68
86	Exchange rate basis		為替レートベース	為替レートが表示される通貨ペアと順序。単位通貨/クォート通貨で表される。0.9426 USD/EURの例では、USDが単位通貨、EURがクォート通貨で、1USD = 0.9426EURである。	Char(3)/Char(3); [Unit currency/Quoted currency] 通貨ペアの順序は制限されない(すなわち、行使価格通貨ペアは、USD/EUR又はEUR/USDのいずれの場合もある)。 ISO 4217に含まれる通貨ペア		CDE	2.69

	Data Element Name	Leg1,Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	#
87	Notional amount	Leg1,Leg2	想定元本	取引の各レグについて、該当する場合: - 金額ベースで締結される店頭デリバティブ取引については、契約に定められる金額。 - 金額ベース以外で締結される店頭デリバティブ取引の場合、別表4のとおりである。 ・ 想定元本スケジュールを有する店頭デリバティブ取引の場合、取引開始時に取引当事者が合意した当初の想定元本をこのデータ項目で報告する。 ・ 店頭通貨オプションの場合、このデータ項目に加えて、データ項目「コール額」と「プット額」を用いて、金額を報告する。変更又はライフサイクル・イベントがあった場合には、結果残高となった想定元本が報告される(想定元本スケジュールのステップは、変更又はライフサイクル・イベントとはみなされない)。 ・ 新たな取引が報告された時点で想定元本が不明な場合、想定元本は入手可能となった時点で更新される。	Num(25,5)	ネットされない複数通貨建て商品(JPYと外貨を交換する通貨スワップ)の場合、報告データが受けと払いの2レコードでの報告になる。	CDE	2.70
88	Call amount		コール金額	通貨オプションについて、オプションにより購入できる金額。	ゼロより大きい任意の値。 Num(25,5)	この項目は、Call AmountとPut Amountが存在する通貨オプションに限定する。Call Amount/Put Amountはそれぞれ、Notional Amount - Leg1/Leg2と同じ金額を報告することとなる。	CDE	2.72
89	Put amount		プット金額	通貨オプションについて、オプションにより売却できる金額。	ゼロより大きい任意の値。 Num(25,5)	この項目は、Call AmountとPut Amountが存在する通貨オプションに限定する。Call Amount/Put Amountはそれぞれ、Notional Amount - Leg1/Leg2と同じ金額を報告することとなる。	CDE	2.73
90	Notional currency	Leg1,Leg2	想定元本通貨	取引の各レグについて、該当する場合: 想定元本を表示する通貨。	ISO 4217 Char(3)	ネットされない複数通貨建て商品(JPYと外貨を交換する通貨スワップ)の場合、報告データが受けと払いの2レコードでの報告になる。	CDE	2.74
91	Call currency		コール通貨	通貨オプションについて、コール額を表示する通貨。	ISO 4217 Char(3)	Call AmountとPut Amountが報告される場合に、コール通貨、プット通貨を報告。	CDE	2.75
92	Put currency		プット通貨	通貨オプションについて、プット額を表示する通貨。	ISO 4217 Char(3)	Call AmountとPut Amountが報告される場合に、コール通貨、プット通貨を報告。	CDE	2.76

	Data Element Name	Leg1,Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	#
93	Quantity unit of measure	Leg1,Leg2	数量単位	取引の各レグについて、該当する場合：想定元本の総量と想定元本スケジュールが表示される単位。	Char(4) ISO 20022: UnitOfMeasureCode codeset		CDE	2.77
94	Notional amount schedule – notional amount in effect on associated effective date	Leg1,Leg2	想定元本スケジュール-関連する発効日に有効な想定元本	取引の各レグについて、該当する場合： 想定元本スケジュールを用いて、金額ベースで締結される店頭デリバティブ取引については、 ・95: 関連する想定元本が発効する調整前の日 ・96: 想定元本の調整前の終了日 (所定のスケジュールの期間の調整前の終了日が、その後の期間の調整前の有効日と連続している場合には、適用されない) ・94: 関連する調整前の有効日に有効となる想定元本 当初の想定元本、関連する調整前の発効日及び終了日が、スケジュールの最初の値として報告される。 このデータ項目は、想定元本が条件又は事由に依存する店頭デリバティブ取引には適用されない。スケジュールにおける様々な想定元本通貨は、「想定元本通貨」で報告される。	Num(25,5)	契約時に想定元本の変動が確定している場合に報告。 アモチ・アキュム付スワップなどの想定元本が増減する場合、 ・取引開始時に取引当事者が合意した当初の想定元本は、Notional amountで報告。 ・また、Notional amount schedule等も取引開始時に報告。 ・その後、スケジュール等に変更があった場合には、「ACTION TYPE」を「MODI」、「EVENT TYPE」を「TRAD」でNotional amount schedule等を変更。 (当初のスケジュールどおりであればNotional amount schedule等を変更する必要なし) ・取引開始時に報告した当初の想定元本の変更はしない。	CDE	2.78.3
95	Notional amount schedule – unadjusted effective date of the notional amount	Leg1,Leg2	想定元本スケジュール-想定元本の調整前の発効日		YYYY-MM-DD (UTC)	契約時に想定元本の変動が確定している場合に報告。	CDE	2.78.1
96	Notional amount schedule – unadjusted end date of the notional amount	Leg1,Leg2	想定元本スケジュール-想定元本の調整前の終了日		YYYY-MM-DD (UTC)	契約時に想定元本の変動が確定している場合に報告。	CDE	2.78.2
97	Total notional quantity	Leg1,Leg2	想定元本の総量	取引の各レグについて、該当する場合：取引期間中の原資産の想定元本の総量 新規取引が報告された時点で想定元本の総量が不明な場合、想定元本の総量が入手可能となった時点で更新される。	ゼロ以上の任意の値。 Num(25,5)		CDE	2.79

	Data Element Name	Leg1,Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	#
98	Notional quantity schedules – Unadjusted date on which the associated notional quantity becomes effective	Leg1,Leg2	想定元本数量スケジュールに関連する想定元本が有効となる調整前の日	取引の各レグについて、該当する場合：想定元本数量スケジュールを用いて、金額ベース以外で締結される店頭デリバティブ取引については、 ・98：関連する想定元本数量が有効となる調整前の日 ・99：想定元本数量の調整前の終了日 （所定のスケジュールの期間の調整前の終了日が、その後の期間の調整前の有効日と連続している場合には、適用されない） ・100：関連する調整前の有効日に有効となる想定元本数量 当初の想定元本、関連する調整前の有効日及び終了日は、スケジュールの最初の値として報告される。 このデータ項目は、想定元本数量が条件又は事由に依存する店頭デリバティブ取引には適用されない。 スケジュール内における様々な想定元本数量の単位は、「数量単位」において報告される。	YYYY-MM-DD(UTC)	約定時に想定元本数量が変動することが確定している場合に報告。	CDE	2.80.1
99	Notional quantity schedules – Unadjusted end date of the notional quantity	Leg1,Leg2	想定元本数量スケジュール-想定元本の調整前の終了日		YYYY-MM-DD(UTC)	約定時に想定元本数量が変動することが確定している場合に報告。	CDE	2.80.2
100	Notional quantity schedules – Notional quantity which becomes effective on the associated unadjusted effective date	Leg1,Leg2	想定元本数量スケジュール-関連する調整前の有効日に有効となる想定元本数量		ゼロ以上の任意の値。 Num(25,5)	約定時に想定元本数量が変動することが確定している場合に報告。	CDE	2.80.3

	Data Element Name	Leg1,Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	#
101	Action type		アクションタイプ	<p>取引報告又は日次報告(時価評価・担保額)に用いるアクションの種類。アクションには、新規、変更、修正、エラー、解約、復元、別TRへの移管、評価、及び担保が含まれるが、これらに限定されない。 New:新しい取引をレポートするアクション。それは新しいUTIIに関する最初のメッセージに適用される。 Modify:以前に提出した取引(クレジットイベントなど)の状態を修正したり、新たに交渉した修正(修正)又は以前に不足していた情報を更新したりして、以前に提出した取引の条件を変更したりするアクション。それには、以前の取引の修正は含まれない。 Correct:以前に提出した取引の誤ったデータを修正するアクション。 Error:不正に提出された取引全体が存在しなかった場合、又は報告の対象ではなかったが誤って報告された場合の、不正に提出された取引全体の取消しの処置。又は重複レポートの取消し。 Terminate:新しいイベント(コンプレッション、ノベーションなど)のために既存の取引を終了するアクション。契約上の満期日に終了する取引には適用ない。 Revive:エラーとして報告された、又は誤って終了したスワップトランザクションを復元するアクション。 Transfer out:取引をあるTRから別のTRに移管するアクション(データレポジトリの変更)。 Valuation:時価評価データの更新。対応するイベントタイプはなし。 Collateral:担保証拠金データの更新。対応するイベントタイプはなし。</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・ NEWT = New ・ MODI = Modify ・ CORR = Correct ・ EROR = Error ・ TERM = Terminate ・ REVI = Revive ・ PRTO = Transfer out ・ VALU = Valuation ・ MARU = Collateral <p>アクション/イベントタイプの有効な組み合わせは別表5(アクション/イベントタイプの組合せ)を参照。</p>	<p>報告項目のうち、「LEI」や「Confirm」等は期中にステータスが変り得るもの。契約変更や誤謬訂正が発生しない項目内容のアップデートについては、Action Type:Modifyで報告。</p> <p>New、Correct又はModifyと、(New、Correct又はModify対象取引の)Valuationが同日に発生する場合、訂正報告(Correct)と時価評価(Valuation)の2明細を報告。</p> <p>【具体例】 (具体例1)エクイティオプション取引がKOLした場合(現在はModify、想定元本0で報告) 「ACTION TYPE」が「Terminate (TERM)」、「EVEVNT TYPE」が「Early Termination (EART)」で報告。 (具体例2)エクイティオプション取引を顧客が解約した場合(現在Cancelで報告) 「ACTION TYPE」が「Terminate (TERM)」、「EVEVNT TYPE」が「Early Termination (EART)」で報告。 (具体例3)エクイティオプション取引の権利行使(従来は報告対象外) 、「ACTION TYPE」が「Terminate (TERM)」、「EVEVNT TYPE」が「Exercise (EXER)」で報告。</p> <p>上記の他、具体的な報告例は、CFTC Technical Specification Appendices F を参照。</p> <p>権利被行使の場合も「Terminate」「Exercise」で報告。</p>	CFTC	26

	Data Element Name	Leg1,Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	#
102	Event type		イベントタイプ	<p>取引に実施されているアクションの説明又は理由。 イベントには、取引、更改、コンプレッション又はリスク削減の行使、早期解約、清算、行使、割り当て、清算及び割り当て、クレジットイベント、及び他TRへの移管が含まれるが、これらに限定されない。</p> <p>Trade:取引の作成又は変更。 Novation:ノベーションは、取引の財務リスクの一部又は全部を譲渡人から受渡人に法的に移動させ、元々の取引を終了/修正し、譲渡人/譲渡人と残りの当事者との間のエクスポージャーを特定するための新しい取引を創出する効果を持つ。 Compression or Risk Reduction Exercise:コンプレッション及びRisk Reduction Exerciseは、一般に、既存の一連の取引を終了又は修正する(すなわち、想定元本の価値を減少させる)効果を持ち、一連の新規取引を創出する。これらのプロセスは、取引相手にとって事前に存在していた市場リスクのエクスポージャーと、ほとんど同じエクスポージャーをもたらすことになる。 Early termination:予定された終了日又は満期日より前に、既存のスワップ取引を終了すること。 Clearing:清算集中とは、デリバティブの清算機関が契約の相手方の間に自らを介在させ、全ての売り手にとっては買い手となり、全ての買い手にとっては売り手となるプロセス。それは、売り手と買い手との間の既存の取引を終了させ、それによってオープンな契約の履行を保証する効果がある。 Exercise:オプション契約又はスワップ契約に定める権利の全部若しくは一部を相手方が行使する過程。 Allocation:複数のクライアントに代わって単一の取引を促進してきたエージェントが、実行された取引の一部をクライアントに割り当てるプロセス。 Clearing and Allocation:デリバティブ・クリアリング組織における同時クリア及びアロケーション・イベント。 Credit event:事前に提出したクレジット・デリバティブ取引の状況を修正する結果となる事象又はトリガー。クレジット・デリバティブのみに適用。 Transfer:取引が別のTRIに移管されるプロセスで、1つのTRで取引を閉じるか、又は異なるTRで同じUTIを使用する同じ取引(new)。 Corporate event:株式の取引に影響を与える、基礎となる株式に対する企業の行動。 Upgrade:改訂された報告要件への適合を確保するために実行された未処理取引のアップグレード。</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・ TRAD = Trade ・ NOVA = Novation ・ COMP = Compression or Risk Reduction ・ ETRM = Early termination ・ CLRG = Clearing ・ EXER = Exercise ・ ALOC = Allocation ・ CLAL = Clearing & Allocation ・ CREV = Credit event ・ PTNG = Transfer ・ CORP = Corporate event ・ UPDT = Upgrade <p>アクション/イベントタイプの有効な組み合わせは別表5 (アクション/イベントタイプの組合せ)を参照。</p>	CFTC	27	
103	Event identifier		イベント識別子	<p>イベントから生じる取引をリンクするための一意の識別子。当該識別子は、コンプレッション、及びクレジットイベントの際に付与される可能性があるが、これらに限定されない。一意の識別子は、報告主体の取引当事者又はサービスプロバイダーによって割り当てられる。</p>	<p>Varchar(52) LEI+英数字最大32文字。</p>	<p>コンプレッションとクレジットイベントにはPriorUTIが使用できないため、本項目が必要。</p> <p>プロバイダが付番したIDがあればそれを報告するが、ない場合は取引当事者間での共有までは求めない。</p>	CFTC	29
104	Event timestamp		イベントタイムスタンプ	<p>報告主体の取引当事者又はサービスプロバイダーによって決定されたイベントの発生日時。 清算イベントの場合、元の取引が清算のためにデリバティブ清算機関によって受け入れられ、清算機関のシステムによって記録された日時をこのデータ要素に報告する必要がある。</p>	<p>YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ (UTC)</p>	<p>実際のイベント発生時間ではなく、システム入力時間、データ生成時間、システム連携時間についても許容値とする。 また、システムの制約等により時間(秒等)までの把握が不可能の場合には、時間以下を「00」とすることについても許容値とする。</p> <p>金融機関によるα取引の解約報告については、必ずしも清算機関のシステムによって記録された日時と一致しなくともよい運用とする。</p> <p>清算機関のシステムによって記録された日時については、清算機関による$\beta \cdot \gamma$取引報告時に付される。</p>	CFTC	30

	Data Element Name	Leg1,Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	#
105	Index factor		インデックス・ファクター	10進値で表される想定元本に掛けるインデックスバージョンファクター。又はパーセント。クレジットデフォルトスワップのプロテクションの売り手がカバーする想定元本を算出する。	Num(11,10) 0と1の間の任意の値(0と1を含む)。 小数点以下(例)で表される。 5%ではなく0.05。	(参考例) 元本金額:10 億円 参照:日本企業50 銘柄から構成されるインデックス (iTraxx Japan) 各銘柄に対する元本金額:それぞれ2,000 万円 クレジットイベント決済:<銘柄#1にクレジットイベントの発生認定> ①銘柄#1 2,000 万円分決済 ②インデックス取引は9 億8,000 万円に減額されて継続 ⇒INDEX FACTORは98%となる。(Credit Event後の想定元本を計算する) 新規取引時は100%、Credit Event発生時にVersion2元本/Version1元本を報告。	CFTC	85
106	Embedded option type		埋め込みオプションタイプ	契約に組み込まれているオプション又はオプション条項の種類。	・MDET = Mandatory early termination ・OPET = Optional early termination ・CANC = Cancelable ・EXTD = Extendible ・OTHR = Other	埋め込みオプションとは、コーラプルスワップなどオプションと複合している商品をいう。	CFTC	86
108	Delivery type		デリバリータイプ	契約が現物決済か現金(差金)決済かの別。	英字4文字: ・CASH = Cash ・PHYS = Physical ・OPTL = Optional (報告主体もしくはサードパーティにより決定された場合はオプションナル)		ESMA	47
109	Asset Class		アセットクラス	アセットクラスの分類。 報告された各契約は、基礎となるアセットクラスに従って分類される。	・CRDT = Credit ・CURR = Currency ・EQUI = Equity ・INTR = Interest Rate ・OTHR=Other	デリバティブの原資産が暗号資産である場合、「OTHR=Other」を選択。	ESMA	11
110	Underlying identification type		原資産の識別タイプ	原資産の識別のタイプ。	英字1文字: ・I = ISIN ・B = Basket ・X = Index		ESMA	13
111	Underlying identification		参照資産	直接の基礎となるものは、その種類に基づいて基礎となるものの固有の識別子を使用することによって識別されなければならない。 クレジット・デフォルト・スワップについては、参照債務のISINを提供すべきである。	underlying identification ・typeIの場合:ISO 6166 ISIN 12文字英数字コード ・typeXの場合:ISO 6166 ISIN(該当する場合)	参照資産がISINを持たないインデックスである場合には、Indicator of the underlying indexで報告。	ESMA	14

	Data Element Name	Leg1,Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	#
112	Indicator of the underlying index		参照資産指標	参照資産を表示。	<ul style="list-style-type: none"> The indication of the floating rate index. 4 alphabetic characters: -ESTR = ESTR -SONA = SONIA -SOFR = SOFR -EONIA = EONIA -EONS = EONIA SWAP -EURI = EURIBOR -EUUS = EURODOLLAR -EUCH = EuroSwiss -GQFR = GCF REPO -ISDA = ISDAFIX -LIBI = LIBID -LIBO = LIBOR -MAAA = Muni AAA -PFAN = Pfandbriefe -TIBO = TIBOR -STBO = STIBOR -BBSW = BBSW -JISA = JISAR -BUBO = BUBOR -CDOR = CDOR -CIBO = CIBOR -MOSP = MOSPRIM -NIBO = NIBOR -PRBO = PRIBOR -TLBO = TELBOR -WIBO = WIBOR -TREA = Treasury -SWAP = SWAP -FUSW = Future SWAP -EFFR = Effective Federal Funds Rate -OSFR = Overnight Bank Funding Rate -CZNA = CZEONIA -TONA = TONA -TORF = TORF -RCTR = RBATGTR -CORR = CORRA -BCOL = CABROVER -HKIO = HIBOR -BJUD = MUTSCALM -ETIO = JBATIBOR -SIBO = SIBOR -SSOR = SOR -SORA = SORA 	Underlying identificationでの報告に該当しない場合に、この項目で報告。 報告すべき参照資産指標が選択肢にない場合には、Name of the underlying indexで報告。	ESMA	15
113	Name of the underlying index		参照資産名称	インデックス提供者によって割り当てられた参照資産インデックスのフルネーム。	最大50文字の英数字。	報告すべき参照資産指標がIndicator of the underlying indexにない場合には、この項目で報告。	ESMA	16
114	Reference entity		参照組織	基礎となる参照組織の識別子。	<ul style="list-style-type: none"> ISO 3166 – 2 character country code, or ISO 3166-2 – 2 character country code followed by dash “-” and up to 3 alphanumeric character country subdivision code, or ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) 20 alphanumeric character code 		ESMA	144

	Data Element Name	Leg1,Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	#
115	Indicator of the floating rate	Leg1,Leg2	変動金利(参照金利)指標	変動金利を表示。	<p>The indication of the floating rate index. 4 alphabetic characters:</p> <ul style="list-style-type: none"> •ESTR = ESTR •SONA = SONIA •SOFR = SOFR •EONA = EONIA •EONS = EONIA SWAP •EURI = EURIBOR •EUUS = EURODOLLAR •EUCH = EuroSwiss •GQFR = GCF REPO •ISDA = ISDAFIX •LIBI = LIBID •LIBO = LIBOR •MAAA = Muni AAA •PFAN = Pfandbriefe •TIBO = TIBOR •STBO = STIBOR •BBSW = BBSW •JISA = JISAR •BUBO = BUBOR •CDOR = CDOR •CIBO = CIBOR •MOSP = MCSPRIM •NIBO = NIBOR •PRBO = PRIBOR •TLBO = TELBOR •WIBO = WIBOR •TREA = Treasury •SWAP = SWAP •FUSW = Future SWAP •EFFR = Effective Federal Funds Rate •OSFR = Overnight Bank Funding Rate •CZNA = OZEONIA •TONA = TONA •TORF = TORF •RCTR = RBATGTR •CORA = CORRA •BCOL = CABROVER •HKIO = HIBOR •BUJO = MUTSCALM •ETIO = JEATIBOR •SIBO = SIBOR •SSOR = SOR •SORA = SORA 	報告すべき変動金利が選択肢にない場合には、Name of the floating rateで報告。	ESMA	84 100
116	Name of the floating rate	Leg1,Leg2	変動金利(参照金利)名称	インデックス提供者によって割り当てられる変動金利のフルネーム。	最大50文字の英数字。	報告すべき変動金利がIndicator of the floating rateにない場合に、この項目で報告。	ESMA	85 101
117	Floating rate reference period - time period	Leg1,Leg2	変動金利(参照金利)期間	変動金利の期間を記入。	<p>英字4文字:</p> <ul style="list-style-type: none"> •DAIL = daily •WEEK = weekly •MNTH = monthly •YEAR = yearly •ADHO = ad hoc which applies when payments are irregular •EXPI = payment at term 		ESMA	89 105
118	Floating rate reference period - multiplier	Leg1,Leg2	変動金利(参照金利)期間 数値	変動金利の期間(数値)を記入。	ゼロ以上の任意の値。 Num(3,0)		ESMA	90 106

	Data Element Name	Leg1,Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	#
119	Derivative based on crypto-assets		暗号資産に基づく商品か否か	デリバティブが暗号資産に基づいているかどうかを示す。	真偽二択 (Boolean: True or False)		ESMA	12
120	Maturity date of the underlying		原資産の満期日	スワップションの場合、原資産となるスワップの満期日。	YYYY-MM-DD (UTC)	スワップションの場合にのみ報告。	ESMA	142
121	Seniority (CD)		シニア	負債証券、又はデリバティブの原資産となる負債、バスケット又はインデックスの優先順位。	英字4文字。 ・SNDB =シニア シニア無担保債務などのシニア(企業/金融)、外貨ソブリン債務(政府) ・SBOD =劣後又は下位Tier2債務(銀行)、ジュニア劣後又は上位Tier 2債務(銀行)などの劣後 ・OTHR =その他(優先株やTier 1 Capital(銀行)又はその他のクレジットデリバティブ)		ESMA	143
122	Series (CD)		シリーズ	該当する場合、インデックスの構成の系列番号。	5文字までの数字。		ESMA	145
123	Version (CD)		バージョン	構成銘柄の1つがデフォルトになり、インデックス内の構成銘柄の総数の新しい数を考慮してインデックスを再重み付けする必要がある場合、シリーズの新しいバージョンが発行される。	5文字までの数字。		ESMA	146
124	CDS index attachment point		CDSインデックスアタッチメントポイント	トランシェの想定元本を減少させる原資産ポートフォリオの損失水準の所定の下限。例えば、アタッチメント・ポイントが3%のトランシェの想定元本では、ポートフォリオに3%の損失が発生した場合、想定元本が減少する。このデータ項目は、取引がCDSトランシェ取引(インデックス又はカスタムバスケット)でない場合には適用されない。	Num(11,10) 小数で表される(0と1を含む) 0と1の間の任意の値(例:5%を0.05と表す)。		CDE	2.81

	Data Element Name	Leg1,Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	#
125	CDS index detachment point		CDSインデックスデタッチメントポイント	原資産ポートフォリオの損失がトランシェの想定元本を減少させない所定のポイント。例えば、アタッチメント・ポイントが3%、デタッチメント・ポイントが6%のトランシェの想定元本では、ポートフォリオの損失が3%になった場合、想定元本が減少する。ポートフォリオの6%の損失によって、トランシェの想定元本が大幅に減少する。このデータ項目は、取引がCDSトランシェ取引(インデックス又はカスタム・バスケット)でない場合には適用されない。	Num(11,10) 小数で表される(0と1を含む) 0と1の間の任意の値(例:5%を0.05と表す)。		CDE	2.82
126	Custom basket code		カスタムバスケットコード	店頭デリバティブ取引がカスタムバスケットにもとづく場合に、構成銘柄と結び付けるためにカスタムバスケットの構成者により付番される固有のコード。このデータ項目は、カスタムバスケットが行われていない場合、又は固有のコードが割り当てられていない場合には適用されない。	Varchar(72) バスケットの構成者のLEIとそれに続く52文字の英数字。	カスタムバスケットとは、アセットを問わず複数銘柄を参照した商品(一例としてファースト・トウ・デフォルト、レインボーオプションなど)が考えられる。	CDE	2.97
127	Identifier of the basket's constituents		バスケットの構成銘柄の識別子	CPMI-IOSCOのテクニカル・ガイダンス「固有商品識別子の調和」におけるUPI参照データ項目で定義されるアンダーライヤーIDに従ったカスタムバスケットの構成銘柄を表すアンダーライヤー。このデータ項目は、カスタムバスケットが行われていない場合には適用されない。	Varchar(350) バスケットに含まれる資産、インデックス又はベンチマークを決定するために使用できる識別子。		CDE	2.98
128	Basket constituent identifier source		バスケット構成識別子ソース	バスケットの構成銘柄の識別子のソース。カスタムバスケットが関係しない場合、このデータ要素は適用されない。	Varchar(350) バスケット構成銘柄の識別子のソース(出所又は発行者)。		CDE	2.101
129	Contract type		契約種類	商品(契約)種類を報告。 報告された各契約は、その種類に従って分類される。	<ul style="list-style-type: none"> •CFDS = Financial contracts for difference •FRAS = Forward rate agreements •FUTR = Futures •FORW = Forwards •OPTN = Option •SPDB = Spreadbet •SWAP = Swap •SWPT = Swaption •OTHR = Other 		ESMA	10
130	Option style		オプションスタイル	オプションスタイルを記入。 オプションを行使できるのが、固定日付(European)、事前に指定された一連の日付(Bermudan)、又は契約期間中の任意の時点(American)のいずれであるかを示す。	英字4文字: <ul style="list-style-type: none"> •AMER = American •BERM = Bermudan •EURO = European 	Cap/Floorの場合は「EURO」で報告。	ESMA	133

	Data Element Name	Leg1,Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	#
131	Option type		オプションタイプ	<p>オプションタイプを記入。 デリバティブ契約がコール(特定の原資産を購入する権利)であるかプット(特定の原資産を売却する権利)であるか、又はデリバティブ契約の締結時にコール若しくはプットのいずれであるかを判断できないかの表示。 スワップションの場合は、次のとおりとする。 -レシーバースワップションの場合は「プット」であり、買い手は固定金利を受け取る側としてスワップを締結する権利を有する。 -購入者が固定金利の支払者としてスワップを締結する権利を有するペイヤースワップションの場合は「コール」。 キャップ及びフロアの場合は、次のとおりとする。 -フロアの場合は「プット」 -キャップの場合は「コール」</p>	<p>英字4文字: ・PUTO = Put ・CALL = Call ・OTHR = コールであるかプットであるかを判断できない場合</p>		ESMA	132
132	Package identifier		パッケージ識別子	<p>(報告主体の取引当事者により決定される)以下を関連付けるための識別子。 ・報告主体の取引当事者により別々に報告されるが、単一の経済的契約の商品として、合わせて交渉される2つ以上の取引 ・法域の報告要件においてTRIに単一の報告書で報告することが認められていない場合の、同一の取引に関連する2つ以上の報告 パッケージには、報告対象取引と報告対象ではない取引が含まれる場合がある。 このデータ項目は、以下のいずれかの場合には適用されない。 ・パッケージが行われていない場合 ・アロケーション 新規取引の報告時にパッケージ識別子が不明な場合、パッケージ識別子が入手可能になった時点で更新される。</p>	Varchar(35)	一意の番号とする。 なお、取引相手との共有までは求めない。	CDE	2.89
133	Package transaction price		パッケージ取引価格	<p>報告されたデリバティブ取引が構成要素であるパッケージ全体の取引価格。 このデータ項目は、以下のいずれかの場合には適用されない。 ・パッケージが行われていない ・パッケージ取引スプレッドが使用されている 入手可能な場合、取引価格及び関連するデータ項目(価格通貨、価格表記、価格の表示単位)が報告される。 パッケージ取引価格が新規取引の報告時に不明であっても、後に更新することができる。</p>	<p>・パッケージ取引価格表記=1である場合 Num(18,13) 任意の値。 ・パッケージ取引価格表記=3である場合 Num(11,10) 小数で表される任意の値 (例:2.57%を0.0257と表す)。</p>		CDE	2.90
134	Package transaction price currency		パッケージ取引価格通貨	<p>パッケージ取引価格が表示される通貨。 このデータ項目は、以下のいずれかの場合には適用されない。 ・パッケージが行われていない ・パッケージ取引スプレッドが使用されている ・パッケージ取引価格表記=3</p>	ISO 4217 Char(3)		CDE	2.91

	Data Element Name	Leg1,Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	#
135	Package transaction price notation		パッケージ取引価格表記	<p>パッケージ取引価格を表示する方法。 このデータ項目は、以下のいずれかの場合には適用されない。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・パッケージが行われていない ・パッケージ取引スプレッドが使用されている 	<p>Char(1)</p> <ul style="list-style-type: none"> ・1 =金額 ・3 =小数 <p>上記の許容値には、法域の要件にもとづき、制約が課せられる場合がある(例えば、特定の法域においては、パーセンテージではなく小数で報告することが要求される場合がある)。</p>		CDE	2.92
136	Package transaction spread		パッケージ取引スプレッド	<p>報告されたデリバティブ取引がパッケージ取引の構成要素であるパッケージ全体の取引価格。パッケージ価格がスプレッド(2つの基準価格の差)で表される場合のパッケージ取引価格。 このデータ項目は、以下のいずれかの場合には適用されない。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・パッケージが行われていない ・パッケージ取引価格が使用されている <p>入手可能な場合、パッケージの個々の構成要素を表す取引のスプレッド及び関連するデータ項目(スプレッド通貨、スプレッド表記)が報告される。 パッケージ取引スプレッドが新規取引の報告時に不明であっても、後に更新することができる。</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・パッケージ取引スプレッド表記=1である場合 Num(18,13) 任意の値。 ・パッケージ取引スプレッド表記=3である場合 Num(11,10) 小数で表される任意の値(例:2.57%を0.0257と表す)。 ・パッケージ取引スプレッド表記=4である場合 Num(5) ペーシス・ポイントで表される任意の整数値(例:2.57%を257と表す)。 		CDE	2.93
137	Package transaction spread currency		パッケージ取引スプレッド通貨	<p>パッケージ取引スプレッドが表示される通貨。 このデータ項目は、以下のいずれかの場合には適用されない。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・パッケージが行われていない ・パッケージ取引価格が使用されている ・パッケージ取引スプレッド表記 = 3又は = 4 	<p>ISO 4217 Char(3)</p>		CDE	2.94

	Data Element Name	Leg1,Leg2	データ要素名	データ要素の定義	許容値	備考	Source	#
138	Package transaction spread notation		パッケージ取引スプレッド表記	<p>パッケージ取引スプレッドを表示する方法。 このデータ項目は、以下のいずれかの場合には適用されない。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・パッケージが行われていない ・パッケージ取引価格が使用されている 	<p>Char(1)</p> <ul style="list-style-type: none"> ・1 = 金額 ・3 = 小数 ・4 = ベーシス・ポイント <p>上記の許容値には、法域の要件にもとづき、制約が課せられる場合がある(例えば、特定の法域においては、パーセンテージではなく小数で報告することが要求される場合がある)。</p>		CDE	2.95
139	Package indicator		パッケージインジケータ	取引がパッケージ取引の一部であるかどうかのインジケータ。	<p>真偽二択 (Boolean: True or False)</p> <ul style="list-style-type: none"> ・パッケージ取引 True ・パッケージ取引以外 False 		GFTC	45

別表1 Day count convention (事項27関連)

許容値	ISO20022上の名称	ISO20022上の定義	FIX / FIXMLコード値	FIX / FIXMLコード値 説明	FIX / FIXML上の定義	FpMLコード	FpML上の定義
A001	IC30360ISDA or30360AmericanBasicRule	月30日、年360日を基準に、利息を計算する方法。ある月の末日の評価日までの経過利息は、2月を除き、同月の暦ベースで30日目までの経過利息と同じとする。ただし、利息期間が30日又は31日に開始した場合に限る。すなわち、当該期間が30日又は31日に開始した場合には31日は30日であると想定し、2月28日(又はうるう年の場合は29日)は28日(又は29日)と想定することを意味する。これは、米国普通社債及び転換社債について最も一般的に用いられる30/360法である。	1	30/360 (30U/360 Bond Basis)	主に米国で用いられ、以下の日付調整ルールが適用される。 (1)投資が月末で、Date1とDate2が2月の最終日に当たる場合、Date2を30に変更する。(2)投資が月末で、Date1が2月の最終日である場合、Date1を30に変更する。(3)Date2が31で、Date1が30又は31である場合、Date2を30に変更する。(4)Date1が31である場合、Date1を30に変更する。 ISDA定義集(2021年版)セクション4.6.1「デイクウント・フラクション」パラグラフ(vi)、又はISDA定義集(2006年版)セクション4.16「デイクウント・フラクション」パラグラフ(f)も参照のこと。 [シンボル名: ThirtyThreeSixtyUS]	30/360	ISDA定義集(2021年版)セクション4.6.1「デイクウント・フラクション」パラグラフ(vi)、又はISDA定義集(2006年版)セクション4.16「デイクウント・フラクション」パラグラフ(f)又はISDA 2000年定義集(2000年6月版)の付属文書セクション4.16「デイクウント・フラクション」パラグラフ(e)にもとづく。 支払いが行われる「計算期間」又は「複利計算期間」の日数を360で除した値であり、計算式は以下のとおりである。 デイクウント・フラクション $= [360 \times (Y2Y1 + 30 \times (M2 - M1) + (D2 - D1))] / 360$ 「D1」は、計算期間又は複利計算期間の最初の暦日であり、数字で表わされる。ただし、この数字が31である場合、D1は30とする。「D2」は、計算期間又は複利計算期間の最終日の直後の暦日であり、数字で表わされる。ただし、この数字が31であり、D1が29を超える場合は、D2は30とする。
A002	IC30365	月30日(30/360(基本ルール)と類似した方法)、及び年365日を基準に、利息を計算する方法。ある月の末日の評価日までの経過利息は、2月を除き、同月の暦ベースで30日目までの経過利息と同じとする。すなわち、31日は30日であると想定し、2月28日(又はうるう年の場合は29日)は28日(又は29日)と想定することを意味する。					
A003	IC30Actual	30/360(基本ルール)と類似した方法により月30日を基準に、またActual/Actual(ICMA)と類似した方法によって1年間の想定日数を基準に、利息を計算する方法。ある月の末日の評価日までの経過利息は、2月を除き、同月の暦ベースで30日目までの経過利息と同じとする。すなわち、31日は30日であると想定し、2月28日(又はうるう年の場合は29日)は28日(又は29日)と想定することを意味する。 1年間の想定日数は、利払期間の実際の日数に、年間の利払い回数を乗じて算出される。					
A004	Actual360	利息期間における実際の経過日数、及び年360日を基準に、利息を計算する方法。	6	Act/360	Date1とDate2間の実際の日数を360で除した値。ISDA定義集(2021年版)セクション4.6.1「デイクウント・フラクション」パラグラフ(v)、又はISDA定義集(2006年版)セクション4.16「デイクウント・フラクション」パラグラフ(e)も参照のこと。 [シンボル名: ActThreeSixty]	ACT/360	ISDA定義集(2021年版)セクション4.6.1「デイクウント・フラクション」パラグラフ(v)、又はISDA定義集(2006年版)セクション4.16「デイクウント・フラクション」パラグラフ(e)又はISDA 2000年定義集(2000年6月版)の付属文書セクション4.16「デイクウント・フラクション」パラグラフ(d)にもとづく。 支払いが行われる「計算期間」又は「複利計算期間」の実際の日数を360で除した値。
A005	Actual365Fixed	利息期間における実際の経過日数、及び年365日を基準に、利息を計算する方法。	7	Act/365 (FIXED)	Date1とDate2間の実際の日数を365で除した値。ISDA定義集(2021年版)セクション4.6.1「デイクウント・フラクション」パラグラフ(iv)、又はISDA定義集(2006年版)セクション4.16「デイクウント・フラクション」パラグラフ(d)も参照のこと。 [シンボル名: ActThreeSixtyFiveFixed]	ACT/365.F IXED	ISDA定義集(2021年版)セクション4.6.1「デイクウント・フラクション」パラグラフ(iv)、又はISDA定義集(2006年版)セクション4.16「デイクウント・フラクション」パラグラフ(d)又はISDA 2000年定義集(2000年6月版)の付属文書セクション4.16「デイクウント・フラクション」パラグラフ(c)にもとづく。 支払いが行われる「計算期間」又は「複利計算期間」の実際の日数を365で除した値。
A006	ActualActualICMA	実際の経過日数及び1年間の想定日数(すなわち、利払期間の実際の日数に、年間の利払回数を乗じて計算された値)を基準に、利息を計算する方法。利払期間が不規則(ファーストクーポン又はラストクーポン)である場合、当該期間は延長されるか、通常の利払期間の長さを持つ準利息期間に分割される。各準利息期間について別々に計算が行われ、中間結果を合算する。	9	Act/Act (ICMA)	分母は、利払期間の実際の日数にその年の利払期間の数を乗じたものである。可能な場合、通常のクーポンは、常に月の同じ日に当たると仮定する。ISDA定義集(2021年版)セクション4.6.1「デイクウント・フラクション」パラグラフ(iii)、又はISDA定義集(2006年版)セクション4.16「デイクウント・フラクション」パラグラフ(c)も参照のこと。 [シンボル名: ActActICMA]	ACT/ACT.I CMA	ISDA定義集(2021年版)セクション4.6.1「デイクウント・フラクション」パラグラフ(iii)、又はISDA定義集(2006年版)セクション4.16「デイクウント・フラクション」パラグラフ(c)にもとづく。このデイクウント・フラクション・コードは、ISDA定義集(2006年版)にもとづき計上された取引に適用される。ISDA 2000年定義集にもとづく取引については、代わりにACT/ACT.ISMAコードを使用すべきである。 分母は、「経過日数 / 年間の日数」(各用語については、国際資本市場協会の法規、細則、規則及び勧告(「ICMAルールブック」)のルール251の定義に従う)に相当し、1998年12月31日以降に発行されたUSD以外の通貨建て普通社債・転換社債に適用されるICMAルールブックの規則251に従って、債券に係るクーポンがあたかも利息の支払いが行われる計算期間又は複利計算期間に対応する利息期間について計算されているかのように計算される。

別表1 Day count convention (事項27関連)

許容値	ISO20022上の名称	ISO20022上の定義	FIX / FIXMLコード値	FIX / FIXMLコード値 説明	FIX / FIXML上L定義	FpMLコード	FpML上の定義
A007	IC30E360orEuroBondBasismodel1	月30日、年360日を基準に、利息を計算する方法。ある月の末日における評価日までの経過利息は、同月の暦ベースで30日目までの経過利息と同じとする。すなわち、31日は30日であると想定し、2月28日(又はうるう年の場合は29日)は2月30日と同等であると想定することを意味する。ただし、満期クーポン期間の最終日が2月の最終日であれば、30日と想定しない。これは、ユーロ債で一般的に用いられる30/360(ICMA)手法のバリエーションの一つである。このバリエーションは、利払期間が月末日に終了する予定である場合にのみ使用される。	5	30E/360 (ISDA)	日付調整ルールは以下のとおりである。 (1)Date1が月末日の場合、Date1を30に変更する。(2)D2が月末日である場合(ただし、Date2が満期日で、かつ2月である場合を除く)、Date2を30に変更する。ISDA定義集(2021年版)セクション4.6.1「デイクウント・フラクション」パラグラフ(viii)、又はISDA定義集(2006年版)セクション4.16「デイクウント・フラクション」パラグラフ(h)も参照のこと。 [シンボル名: ThirtyEThreeSixtyISDA]	30E/360ISDA	ISDA定義集(2021年版)セクション4.6.1「デイクウント・フラクション」パラグラフ(viii)、又はISDA定義集(2006年版)セクション4.16「デイクウント・フラクション」パラグラフ(h)にもとづく。なお、ISDA定義集(2006年版)のデイクウント・フラクションのアルゴリズムは、ISDA 2000年定義集で定義されている30E/360にもとづくデイクウント・フラクションと実務上同じ計算結果が得られるように設計されていることに留意のこと。この変更に関する詳細情報については、ISDA定義集(2006年版)の序文を参照。支払いが行われる「計算期間」又は「複利計算期間」の日数を360で除した値であり、以下の算式となる。 デイクウント・フラクション=(360*(Y2-Y1)+30*(M2-M1)+(D2-D1))/360。「D1」は、計算期間又は複利計算期間の最初の暦日であり、数字で表わされる。ただし、当該数字が31である場合、D1は30とする。「D2」は、計算期間又は複利計算期間の最終日の直後の暦日であり、数字で表わされる。ただし、当該数字が31である場合は、D2は30とする。
A008	ActualActualSDA	以下にもとづき利息を計算する方法。通常の年における利息期間の実際の経過日数を365で除し、うるう年における利息期間の実際の経過日数を366で除した値に加算する。	11	Act/Act (ISDA)	関連する計算期間の一部がうるう年に当たるかによって、分母が異なってくる。計算期間のうち、うるう年に当たる部分の分母は366であり、うるう年に当たらない部分の分母は365とする。ISDA定義集(2021年版)セクション4.6.1「デイクウント・フラクション」パラグラフ(ii)、又はISDA定義集(2006年版)セクション4.16「デイクウント・フラクション」パラグラフ(b)も参照のこと。 [シンボル名: ActActISDA]	ACT/ACTISDA	ISDA定義集(2021年版)セクション4.6.1「デイクウント・フラクション」パラグラフ(ii)、又はISDA定義集(2006年版)セクション4.16「デイクウント・フラクション」パラグラフ(b)又はISDA 2000年定義集(2000年6月版)の付属文書セクション4.16「デイクウント・フラクション」パラグラフ(b)にもとづく。FpML 2.0版レコメンデーションから FpML 3.0版トライアル・レコメンデーションに移行した際に、FpML 2.0版における「ACT/365.ISDA」というコードが「ACT/ACT.ISDA」になったことに留意のこと。支払いが行われる「計算期間」又は「複利計算期間」の実際の日数を365で除した値(あるいは、当該計算期間又は複利計算期間のいずれかがうるう年に当たる場合は、(i)計算期間又は複利計算期間のうち、うるう年に当たる部分の実際の日数を366で除した値と、(ii)計算期間又は複利計算期間のうち、通常の年に当たる部分の実際の日数を365で除した値とを合計した値)。
A009	Actual365LorActuActubasisRule	実際の経過日数、及び年365日(利払日があるうるう年に当たらない場合)又は年366日(利払日があるうるう年に当たる場合)を基準に、利息を計算する方法。	14	Act/365L	実際の日数に等しいある期間における日数。1年間の日数は365日であるか、又は、当該期間がうるう年に終了する場合は366日である。ポンド建ての変動利付債に用いられる。ISMA年 (ISMA Year) とも呼ばれる場合がある。ISDA定義集(2021年版)セクション4.6.1「デイクウント・フラクション」パラグラフ(ix)、又はISDA定義集(2006年版)セクション4.16「デイクウント・フラクション」パラグラフ(i)も参照のこと。 [シンボル名: ActThreeSixtyFiveL]	ACT/365L	ISDA定義集(2021年版)セクション4.6.1「デイクウント・フラクション」パラグラフ(ix)、又はISDA定義集(2006年版)セクション4.16「デイクウント・フラクション」パラグラフ(i)にもとづく。支払いが行われる「計算期間」又は「複利計算期間」の実際の日数を365で除した値(あるいは、当該計算期間又は複利計算期間の期末日のうち、遅い方の期末日があるうるう年に当たる場合は、366で除した値)。
A010	ActualActualAFB	実際の経過日数、及び年366日(2月29日が利払期間に当たる場合)又は年365日(2月29日が利払期間に当たらない場合)を基準に、利息を計算する方法。利払期間が1年より長い場合、当該利払期間を、その末日から逆向きにカウントした1年のサブ期間で繰り返し分離することによって、分割する(該当する場合、2月28日から逆向きにカウントした1年は、2月29日である)。最初のサブ期間は、経過利息期間の開始日に始まるため、1年より短い場合がある。その後、各サブ期間について個別に利息を計算し、中間結果を合算する。	8	Act/Act (AFB)	Date1とDate2との間の実際の日数であり、分母は365日(計算期間に2月29日が含まれない場合)又は366日(計算期間に2月29日が含まれる場合)である。「金融取引に係るAFBマスターアグリーメント—金利取引(2004年)」セクション4「固定額及び変動額の計算(Calculation of Fixed Amounts and Floating Amounts)」のパラグラフ「デイクウント・フラクション」、サブパラグラフ(i)も参照のこと。 [シンボル名: ActActAFB]	ACT/ACT.AFB	固定・変動額は、1994年9月にフランス銀行協会が公表した「Definitions Communes plusieurs Additifs Techniques」で定義されている「BASE EXACT/EXACT」によるデイクウント・フラクションに従って計算される。分母は365(計算期間が2月29日を含まない場合)又は366(計算期間が2月29日を含む場合)のいずれかである。期間が1年を超える場合、2つ以上の計算が行われる。計算期間の末日から逆向きにカウントし、1年ごとに利息が計算され、残りの当初のサブ期間は通常のルールに従って処理される。この目的のために、逆向きにカウントするに当たっては、関連期間の最終日が2月28日である場合、前年の2月28日まで遡って1年とカウントすべきである。ただし、2月29日が存在する場合には、2月29日を使用すべきである。
A011	IC30360ICMAor30360basicrule	月30日、年360日を基準に、利息を計算する方法。ある月の末日における評価日までの経過利息は、2月を除き、同月の暦ベースで30日目までの経過利息と同じとする。すなわち、31日は30日であると想定し、2月28日(又はうるう年の場合は29日)は28日(又は29日)と想定することを意味する。これは、1999年1月1日以前に発行された米国以外の普通社債及び転換社債について最も一般的に用いられる30/360法である。	4	30E/360 (Eurobond Basis)	「30/360.ISMA」「30S/360」又は「Special German」としても知られる。日付調整ルールは、次のとおりである。(1)Date1が31日に当たる場合は、30日に変更する。(2)Date2が31日に当たる場合は、30日に変更する。ISDA定義集(2021年版)セクション4.6.1「デイクウント・フラクション」パラグラフ(vii)、又はISDA定義集(2006年版)セクション4.16「デイクウント・フラクション」パラグラフ(g)も参照のこと。 [シンボル名: ThirtyEThreeSixty]	30E/360	ISDA定義集(2021年版)セクション4.6.1「デイクウント・フラクション」パラグラフ(vii)、又はISDA定義集(2006年版)セクション4.16「デイクウント・フラクション」パラグラフ(g)又はISDA 2000年定義集(2000年6月版)の付属文書セクション4.16「デイクウント・フラクション」パラグラフ(f)にもとづく。ISDA定義集(2006年版)のデイクウント・フラクションのためのアルゴリズムは、ISDA 2000年定義集から変更されていることに留意のこと。この変更に関する詳細情報については、ISDA定義集(2006年版)の序文を参照のこと。

別表1 Day count convention (事項27関連)

許容値	ISO20022上の名称	ISO20022上の定義	FIX / FIXMLコード値	FIX / FIXMLコード値 説明	FIX / FIXML上L定義	FpMLコード	FpML上の定義
A012	IC30E2360orEurobondbasismodel2	月30日、年360日を基準に、利息を計算する方法。ある月の末日における評価日までの経過利息は、2月を除き、同月の暦ベースで30日目までの経過利息と同じとする。なお、利息期間の初日の評価額の方が2月の最終日における評価額よりも高く、当該期間が定期的なスケジュールのうち一つの期間である場合には、2月の最終日における評価額を、利息期間の初日の評価額の方に合わせる。このことは、31日は30日であると想定し、通常の年の2月28日は、利息期間の初日が29日である場合には2月29日に、利息期間の初日が30日又は31日である場合には2月30日に相当すると想定することを意味する。また、うるう年の2月29日は、利息期間の初日が30日又は31日である場合には、2月30日に相当すると想定する。同様に、利払期間が2月の最終日に開始する場合であって、当該期間の最終日が30日又は31日である場合には、2月30日に開始したかのようにみなし、2月には1日分のみの利息が、又は上記期間の最終日が29日である場合には、2月には2日分の利息が、又は上記期間の最終日が通常の年の2月28日であり、29日より前の日付である場合、2月には3日分の利息が発生するものと想定する。					
A013	IC30E3360orEurobondbasismodel3	月30日、年360日を基準に、利息を計算する方法。ある月の末日における評価日までの経過利息は、同月の暦ベースで30日目までの経過利息と同じとする。すなわち、31日は30日であると想定し、2月28日(又はうるう年の場合は29日)は2月30日に相当すると想定することを意味する。これは、2月の最終日が満期クーポン期間の最終日であっても、2月の最終日を常に30日と想定する、30E/360(又はユーロ債ベース)手法のバリエーションの一つである。					
A014	Actual365NL	利息期間における実際の経過日数(ただし、うるう日はカウントから除外する)、及び年365日を基準に、利息を計算する方法。	15	NL365	実際の日数に等しい、ある期間の日数。ただし、うるう日(2月29日)は無視する。1年の日数は、うるう年においても365とする。 [シンボル名: NLThreeSixtyFive]		
A015	ActualActualUltimo	利払期間の実際の日数をその年の実際の日数で除して得た値を基準に、利息を計算する方法。これは、「ActualActualICMA」手法のバリエーションの一つであるが、クーポンが常に月末日に当たると想定する点が異なる。また、FpMLモデルにおける「ACT/ACT.ISMA」、FIX/FIXMLモデルにおける「Act/Act(ICMA Ultimo)」に相当する手法である。	10	Act/Act(ICMA Ultimo)	「Act/Act(ICMA Ultimo)」が、「Act/Act(ICMA)」手法と唯一異なる点は、通常のクーポンが常に月末日に当たると想定する点である。 [シンボル名: ActActISMAUltimo]	ACT/ACT.ICMA	固定・変動額は、1998年12月31日以降に発行された普通社債及び転換社債に適用される、1999年4月に公表された国際証券市場協会の法規、細則、規則及び勧告のルール2511に従って、当該固定・変動額が上記債券のクーポンであるかのように計算される。このデイクウント・フラクション・コードは、ISDA 2000年定義集にもとづき計上された取引に適用される。ISDA定義集(2006年版)にもとづく取引については、代わりに「ACT/ACT.ICMA」コードを用いるべきである。
A016	IC30EPlus360	月30日、年360日を基準に、利息を計算する方法。ある月の末日における評価日までの経過利息は、同月の暦ベースで30日目までの経過利息と同じとする。すなわち、31日は30日であると想定し、2月28日(又はうるう年の場合は29日)は2月30日に相当すると想定することを意味する。これは、30E360手法のバリエーションの一つであり、クーポンが月末日に当たる場合には当該日を1に変更し、月を1カ月分増やす(すなわち、翌月)点が異なる。また、FIX/FIXMLモデルにおける「ThirtyEPlusThreeSixty」に相当する。	13	30E+/360	30E/360のバリエーション。日付調整ルールは、以下のとおりである。(1)Date1が31日に当たる場合、30日に変更し、(2)Date2が31日に当たる場合、1に変更し、Month2を1カ月増やす(すなわち、翌月)。 [シンボル名: ThirtyEPlusThreeSixty]		
A017	Actual364	利息期間における実際の経過日数を364で除した値を基準に、利息を計算する方法。 FIX/FIXMLモデルにおける「Act364」に相当する手法。	17	Act/364	Date1とDate2の間の日数を364で除した値。 [シンボル名: Act364]		
A018	Business252	利息期間における実際の営業日数を252で除した値を基準に、利息を計算する方法。 適用対象商品:ブラジル通貨スワップ FpMLモデルにおける「BUS/252」、FIX/FIXMLモデルにおける「BusTwoFiftyTwo」に相当する手法。	12	BUS/252	ブラジルレアルのスワップ(暦日ではなく営業日ベース)に使用。営業日数を252で除したものである。 [シンボル名: BusTwoFiftyTwo]	BUS/252	支払が行われる「計算期間」又は「複利計算期間」の営業日数を、252で除した値。

別表1 Day count convention (事項27関連)

許容値	ISO20022上の名称	ISO20022上の定義	FIX / FIXMLコード値	FIX / FIXMLコード値 説明	FIX / FIXML上L定義	FpMLコード	FpML上の定義
A019	Actual360NL	利息期間における実際の経過日数(ただし、うるう日はカウントから除外する)、及び年360日を基準に、利息を計算する方法。	16	NL360	うるう日(2月29日)が無視される点を除き、これは「Act/360」と同じである。 [シンボル名: NLThreeSixty]		
A020	1/1	当事者がデイカウント・フラクションを1/1と指定した場合、該当する金額を計算するに当たって、「1」は単に該当するデイカウント・フラクションとして計算に反映される。ISDA定義集(2006年版)セクション4.16「デイカウント・フラクション」パラグラフ(a)も参照のこと。	0	1/1	当事者がデイカウント・フラクションを1/1と指定した場合、該当する金額を計算するに当たって、「1」は単に該当するデイカウント・フラクションとして計算に反映される。ISDA定義集(2021年版)セクション4.6.1「デイカウント・フラクション」パラグラフ(i)、又はISDA定義集(2006年版)セクション4.16「デイカウント・フラクション」パラグラフ(a)又はISDA 2000年定義集(2000年6月版)の付属文書セクション4.16「デイカウント・フラクション」パラグラフ(a)にもとづく。 [シンボル名: OneOne]	1/1	ISDA定義集(2021年版)セクション4.6.1「デイカウント・フラクション」パラグラフ(i)、又はISDA定義集(2006年版)セクション4.16「デイカウント・フラクション」パラグラフ(a)又はISDA 2000年定義集(2000年6月版)の付属文書セクション4.16「デイカウント・フラクション」パラグラフ(a)にもとづく。
NARR	Narrative	その他の方法			上記に列挙されていないその他のFIX/FIXMLコード値、及びユーザ拡張用に維持されているFIX/FIXMLコード値(100以上の整数値)。		

別表2 評価インプットの分類（事項42関連）

バケット	内容	評価方法
1	<p>エンティティが測定日にアクセスできる同一の資産又は負債の活発な市場における相場価格。活発な市場における市場価格は、公正価値の最も信頼できる証拠を提供し、限られた例外を除いて、利用可能な場合はいつでも公正価値を測定するために調整なしで使用される。</p> <p>活発な市場とは、資産又は負債の取引が、継続的に価格情報を提供するのに十分な頻度と量で行われる市場をいう。</p>	mark-to-market
2	<p>活発な市場における類似の資産又は負債の相場価格。 (直接又は間接的に資産又は負債について観察可能なバケット1に含まれる相場価格を除く)</p>	mark-to-market
3	<p>活発でない市場における同一又は類似の資産又は負債の相場価格。 (直接又は間接的に資産又は負債について観察可能なバケット1に含まれる相場価格を除く)</p>	<p>mark-to-model</p> <p>活発でない市場からの過去の価格を直接使用しないこと</p>
4	<p>資産又は負債について観察可能な相場価格以外のインプット、例えば、一般的に引用される間隔で観察可能な金利及びイールドカーブ、インプライドボラティリティ、信用スプレッド。 (直接又は間接的に資産又は負債について観察可能なバケット1に含まれる相場価格を除く)</p>	mark-to-market
5	<p>相関又は他の手段によって観察可能な市場データから主に導き出された、又はそれによって裏付けられたインプット(“market-corroborated inputs”市場で裏付けられたインプット)。 (直接又は間接的に資産又は負債について観察可能なバケット1に含まれる相場価格を除く)</p>	<p>mark-to-model</p> <p>インプットは、観察可能な市場データから「主に」導出できる。つまり、観察不可能なインプットを使用できる。</p>
6	<p>資産又は負債の観察不能なインプット。 観察不能なインプットは、関連する観察可能なインプットが利用できない範囲で公正価値を測定するために使用され、それにより、測定日における資産又は負債の市場活動があったとしてもほとんどない状況を考慮に入れる。 エンティティは、合理的に入手可能な市場参加者の仮定に関する全ての情報を考慮に入れて、エンティティ自身のデータを含む可能性のある状況で入手可能な最良の情報を使用して観察不能なインプットを開発する。</p>	<p>mark-to-model</p> <p>観察できないインプットを使用。</p>

別表3 担保区分（事項61関連）

Value	Name		Definition
UNCL	Uncollateralised	(無担保)	取引当事者間で担保契約が締結されていないか、又は取引当事者間で締結されている担保契約において、デリバティブ取引について担保(当初証拠金、変動証拠金いずれも)の差し入れを要しない旨が規定されている。
PRC1	Partially collateralised: Counterparty 1 only.	(部分担保: 取引当事者1のみ)	取引当事者間で締結されている担保契約上、デリバティブ取引について、報告主体の取引当事者が、定期的に変動証拠金のみを差し入れ、他方の取引当事者は、証拠金の差し入れは行わない旨規定されている。
PRC2	Partially collateralised: Counterparty 2 only.	(部分担保: 取引当事者2のみ)	取引当事者間で締結されている担保契約上、デリバティブ取引について、他方の取引当事者が、定期的に変動証拠金のみを差し入れ、報告主体の取引当事者は、証拠金の差し入れは行わない旨規定されている。
PRCL	Partially collateralized	(部分担保)	取引当事者間で締結されている担保契約上、両方の取引当事者が、定期的に変動証拠金のみを差し入れる旨規定されている。
OWC1	One-way collateralised: counterparty 1 only	(一方向担保: 取引当事者1のみ)	取引当事者間で締結されている担保契約上、デリバティブ取引について、報告主体の取引当事者が、当初証拠金のほか、定期的に変動証拠金を差し入れ、他方の取引当事者は、いかなる証拠金の差し入れも行わない旨規定されている。
OWC2	One-way collateralised: counterparty 2 only	(一方向担保: 取引当事者2のみ)	取引当事者間で締結されている担保契約上、デリバティブ取引について、他方の取引当事者が、当初証拠金のほか、定期的に変動証拠金を差し入れ、報告主体の取引当事者は、いかなる証拠金の差し入れも行わない旨規定されている。
OWP1	One-way /partially collateralised: counterparty 1	(一方向/部分担保: 取引当事者1のみ)	取引当事者間で締結されている担保契約上、デリバティブ取引について、報告主体の取引当事者が、当初証拠金のほか、定期的に変動証拠金を差し入れ、他方の取引当事者は、定期的に変動証拠金のみを差し入れる旨規定されている。
OWP2	One-way /partially collateralised: counterparty 2	(一方向/部分担保: 取引当事者2のみ)	取引当事者間で締結されている担保契約上、デリバティブ取引について、他方の取引当事者が、当初証拠金のほか、定期的に変動証拠金を差し入れ、報告主体の取引当事者は、定期的に変動証拠金のみを差し入れる旨規定されている。
FLCL	Fully collateralized	(全額担保)	取引当事者間で締結されている担保契約上、デリバティブ取引について、両方の取引当事者が、当初証拠金のほか、定期的に変動証拠金を差し入れる旨規定されている。

別表4 想定元本 金額ベース以外で締結される店頭デリバティブ取引の場合（事項87関連）

Product(商品)		Converted Amount(転換後の金額)
Equity options and similar products	エクイティ・オプション及び類似する商品	行使価格と株式数又はインデックスユニットの積
Equity forwards and similar products	エクイティ・フォワード及び類似する商品	フォワード価格と株式数又はインデックスユニットの積
Equity dividend swaps and similar products	エクイティ・ディビデンド・スワップ及び類似する商品	期間固定行使価格と株式数又はインデックスユニットの積
Equity swaps, portfolio swaps, and similar products	エクイティ・スワップ、ポートフォリオ・スワップ及び類似商品	当初価格と株式数又はインデックスユニットの積
Equity variance swaps and similar products	エクイティ・バリエーション・スワップ及び類似商品	バリエーションの額
Equity volatility swaps and similar products	エクイティ・ボラティリティ・スワップ及び類似商品	ベガの想定元本の額
Equity CFDs and similar products	エクイティCFD及び類似商品	当初価格と株式数又はインデックスユニットの積

別表5 アクションタイプ・イベントタイプの組み合わせ（事項101、102関連）

次の表の「有効なアクションタイプとイベントタイプの組み合わせ」は、アクションタイプとイベントタイプの許容値の全ての有効で許容可能な組み合わせを示している。行には全ての許可されたアクションタイプがリストされ、列には全ての許可されたイベントタイプがリストされる。チェック記号(☑)が付いた白のボックスは、指定された組み合わせがレポートに許可されているかどうかを示す。他の全ての組み合わせは、データ受付を許容しない可能性がある。

Action type & Event type combinations		Event Type											
		Trade (TRAD)	Novation (NOVA)	Compression or Risk Reduction Exercise (COMP)	Early Termination (ETRM)	Clearing (CLRG)	Exercise (EXER)	Allocation (ALOC)	Clearing & Allocation (CLAL)	Credit Event (CREV)	Transfer (PTNG)	Corporate Event (CORP)	Upgrade (UPDT)
A c t i o n T y p e	New (NEWT)	☑	☑	☑		☑	☑	☑	☑		☑	☑	
	Modify (MODI)	☑	☑	☑	☑		☑	☑		☑		☑	☑
	Correct (CORR)												
	Terminate (TERM)		☑	☑	☑	☑	☑	☑	☑	☑		☑	
	Error (EROR)												
	Revive (REVI)												
	Transfer out (PRT0)										☑		
	Valuation (VALU)												
	Collateral (MARU)												

固有取引識別子（UTI）の付番等の考え方

令和 4 年 12 月

金融庁企画市場局市場課

1. 背景・概要

金融商品取引法及び令和4年8月改正後の「店頭デリバティブ取引の規制等に関する内閣府令」（以下「府令」という。）では、金融商品取引清算機関等及び金融商品取引業者等は取引情報を取引情報蓄積機関等に提供し、取引情報蓄積機関は提供を受けた取引情報について、府令第4条第1項で定める事項に関する記録を作成、保存し、保存する取引情報を内閣総理大臣に報告することが求められている。そして、府令第4条第1項で定める事項の一つとして、取引の識別に関する事項（固有取引識別子（UTI））が掲げられている。

この「固有取引識別子（UTI）の付番等の考え方」は、金融庁、業界団体、市場インフラ事業者、金融機関等が参加する意見交換会における議論等を踏まえ、UTIの付番者やUTIの共有等に関する考え方を提示するものである。

2. UTIに関する基本的な整理

(1) 定義

「固有取引識別子（UTI）の付番等の考え方」における用語の定義は以下のとおりである。

用語	内容
報告義務者	府令第1条第2項第8号に規定する「金融商品取引清算機関等」及び第2条第4項第4号イに規定する「取引情報作成対象業者」をいう。
非報告義務者	報告義務者以外の主体をいう。
クロスボーダー取引	日本及び日本以外の法域に報告される取引。
金利系デリバティブ	金利スワップ及び金利オプション又はそれに類似する商品を指す。
取引プラットフォーム	BIS 決済・市場インフラ委員会（CPMI）と証券監督者国際機構（IOSCO）の代表理事会が2017年に公表した「UTI テクニカル・ガイダンス最終版」（以下「テクニカル・ガイダンス」という。）では Trading Platform は特段定義されていない。「固有取引識別子（UTI）の付番等の考え方」では、例えば電子取引基盤を指し、清算機関は含まない。
照合プラットフォーム	電子的にコンファメーションを行うプラットフォームを指す。

(2) 固有取引識別子（UTI）とは何か

固有取引識別子（UTI：Unique Transaction Identifier）は、報告対象となる個別の取引に付番する固有のコードである。取引の報告における重複を防止し、監督当局によるグローバルなデータ集約を促進することが目的とされている。

UTIは国際標準化機構（ISO：The International Organization for Standardization）によるISO 23897:2020（Financial Services—Unique Transaction Identifier（UTI））に基づき、大文字のアルファベットA-Z及び数字の0-9で構成される最大52桁の文字列であり、うち最初の20桁は付番者の取引主体識別子（LEI：Legal Entity Identifier）とされている。

(参考) テクニカル・ガイダンスにおけるフロー

テクニカル・ガイダンスでは、新規約定時のほか、取引が途中解約され新たな取引に置き換わる場合（コンプレッション、ネットティング、分割等）、いずれかの取引当事者に関する変更があった場合（清算等）、取引が1つ又は複数の他の取引に置き換えられた場合に、新規にUTIを付番することとなっている。

また、テクニカル・ガイダンスでは、付番者について以下のとおりフロー形式で整理されている。

ステップ	判断する要件	付番者等
1	清算機関は取引のカウンターパーティに該当するか。	該当する場合、清算機関 該当しない場合は、ステップ2
2	取引のカウンターパーティは、清算機関の清算会員に該当するか。該当する場合、当該清算会員は、当該取引において、清算会員として行動しているか。	該当する場合、清算会員 該当しない場合はステップ3
3	取引は取引プラットフォームで執行されたか。	該当する場合、取引プラットフォーム 該当しない場合はステップ4
4	取引は法域を跨っているか（すなわち、取引相手は複数の国の報告に関する規則が適用されるか）。	該当する場合、ステップ10 該当しない場合はステップ5
5	双方のカウンターパーティは報告義務を有しているか。	有する場合、ステップ6 有していない場合はステップ7
6	取引は電子照合されたか、もしくは、されるか。電子照合される場合、照合プラットフォームは、適用される規則にもとづき、要求される期間内に UTI の付番が可能であり、その意思があり、許容されているか。	該当する場合、照合プラットフォーム 該当しない場合はステップ7
7	いずれのエンティティが UTI 付番責任を有すべきかを決定するに当たって、カウンターパーティの状況にもとづくアプローチ（規則の設定や登録状況等）を採用しているか。	該当する場合、ステップ8 該当しない場合は、ステップ11
8	UTI 付番目的に関して、関連する法域におけるカウンターパーティの規制上の位置づけは同一であるか。	同一の場合は、ステップ11 同一ではない場合は、ステップ9
9	適用される規則では、いずれのエンティティが UTI 付番の責任を有すべきかが定められているか。	定められている場合、指定されたエンティティ 定められていない場合は、ステップ12
10	ある法域の期限は、他の法域の期限よりも早いのか。	該当する場合、報告期限が早い法域の UTI の付番規則に準拠 該当しない場合はステップ11
11	カウンターパーティの間で、いずれのエンティティがこの取引の UTI を付番する責任を有すべきかを定める合意があるか。	該当する場合、当該合意により責任を有するエンティティ 該当しない場合はステップ12

12	取引は電子照合された、もしくはされるか。もしそうである場合、照合プラットフォームは、適用される規則にもとづき、要求される期間内に UTI の付番が可能であり、その意思があり、許容されているか。	該当する場合、照合プラットフォーム 該当しない場合はステップ 13
13	取引に関連した報告を行わなければならない単一の取引情報蓄積機関があるか。当該取引情報蓄積機関は、適用される規則の下で UTI の付番が可能であり、その意思があり、許容されているか。	該当する場合、取引情報蓄積機関 該当しない場合は、カウンターパーティの識別子の文字を逆順に並べ、並び順で一番目になったカウンターパーティを選定

3. 日本における UTI の付番

(1) 考え方

日本における UTI の付番に関して、基本的な考え方を以下のとおり記載する。

【報告義務者同士の取引】

- ① テクニカル・ガイダンスのフローに従う。
- ② 上記に則らない場合（実務的に則ることが困難な場合も含む。）は当事者合意とする。
当事者合意の内容は、取引当事者の規模等に応じて付番するといった方法等が考えられるが、過度な事務負担が生じないよう配慮することが望ましい。仮に取引プラットフォームや照合プラットフォームが一時的なシステムトラブルなどで付番ができない場合には、取引当事者が仮 UTI を報告したあとに、真正な UTI に差し替える必要がある。

府令第7条第3項及び第8条第4項並びに令和3年金融庁告示第11号「金融商品取引業者等のうち金融庁長官の指定する者及び金融庁長官の定める取引を次のように定める件」第1条及び第2条で定める前年度の各月末の店頭デリバティブ取引の平均残高が3,000億円未満である取引情報作成対象業者と3,000億円以上である取引情報作成対象業者との取引については、店頭デリバティブ取引の平均残高が3,000億円以上である取引情報作成対象業者を付番者と判定する（店頭デリバティブ取引の平均残高が3,000億円未満である取引情報作成対象業者の場合、金融庁長官及び取引情報蓄積機関に対して当該者であることを報告した場合には、一部の店頭デリバティブ取引について報告義務が免除されているため）。

【報告義務者と非報告義務者（一部の金融商品取引業者・事業法人・個人等）との取引】

報告義務者と非報告義務者（一部の金融商品取引業者・事業法人・個人等）との取引に当たって、プラットフォームで付番をせず、取引当事者のどちらかが付番する必要が生じた場合には、報告義務者が付番する。

【非報告義務者同士の取引】

非報告義務者同士の取引の報告は不要である。

(2) 商品別の付番者の考え方

(1) の考え方を日本の市場慣行に当てはめると、商品別の具体的な付番者の考え方は以下のとおりとなる。

① 金利系デリバティブ、CDS

分類①	分類②	分類③	付番者	備考
取引プラットフォーム利用	清算集中	α 取引 ¹	取引プラットフォーム (※)	クリアリングされなかった場合、金融機関等が取引を報告
		$\beta \cdot \gamma$ 取引	清算機関	清算機関 ² から取引を報告
	非清算集中		取引プラットフォーム (※)	
照合プラットフォーム利用	清算集中	α 取引	照合プラットフォーム (※)	取引プラットフォームで付番されなかった場合に限る。 クリアリングされなかった場合、金融機関等が取引を報告
		$\beta \cdot \gamma$ 取引	清算機関	清算機関から取引を報告
	非清算集中		照合プラットフォーム (※)	取引プラットフォームで付番されなかった場合に限る。
上記以外の取引			当事者合意 ³	

※ 取引・照合プラットフォームが付番に合意していない場合は「上記以外の取引」として当事者間の合意により付番者を決定する。

② エクイティデリバティブ

分類	付番者
照合プラットフォームを利用	照合プラットフォーム (※)
上記以外の取引	当事者合意

※ 照合プラットフォームが付番に合意していない場合は「上記以外の取引」として当事者間の合意により付番者を決定する。

¹ α 取引は取引当事者間の取引。清算機関は、清算機関と各取引当事者間の取引である $\beta \cdot \gamma$ 取引を報告する場合に、 α 取引のUTIがPrior UTIとして必要となることから、取引プラットフォームや照合プラットフォームと債務負担申込時などに適切に連携する必要がある。

² 平成23年金融庁告示第105号「金融商品債務引受業の対象取引から除かれる金融庁長官が指定する取引及び貸借を指定する件」において規定される清算機関を利用する場合は金融機関側から報告を行う（以下、同様の取扱い。）。

³ 一例として、紙コンファメーション作成者を付番者とすることや規模に応じて付番者を決めることなどが考えられる。

③ 通貨オプション、NDF⁴、NDO⁵

(1) の考え方に従い付番する。

スワップションの場合、新規取引時・オプション実行時（スワップ生成時）それぞれで上記分類に従い UTI の付番が必要である。

(3) クロスボーダー取引

クロスボーダー取引においては、原則としてテクニカル・ガイダンスのフローに従うが、ステップ 10「ある法域の期限は、他の法域の期限よりも早いか。」の把握等が困難である場合には、ステップ 11 以降に移行する。

※ カウンターパーティが服する規制を網羅的かつ正確に把握することが難しい場合、報告義務者はステップ 10 で求められる報告期限が最も早い管轄法域を特定する必要はないものの、相手方と事前の協議を行う必要がある。

なお、この取扱いは他の法域の UTI の付番ルールを修正するものではなく、報告義務者は、カウンターパーティの UTI の付番ルールも尊重しなければならない。

4. 日本における UTI の共有

(1) 考え方

報告義務者同士の取引では、双方が同一の UTI を報告する必要がある。取引当事者間で報告時に間に合うよう UTI を速やかに共有する必要がある。

基本的な考え方は以下のとおりであるが、個別の取引毎の判断を妨げるものではない。

取引上、利用するインフラ	UTI の共有方法
取引プラットフォーム 照合プラットフォーム	照合プラットフォーム ⁶
SWIFT	SWIFT ⁷
その他	一例として、紙コンファメーション（※）又は e-mail

※ オペレーショナル・リスクが他の方法よりも高いことに留意する。可能な限り、電子的な方法が望ましい。

また、取引情報蓄積機関への情報提供は T+2 営業日以内で実施する必要があるため、原則として、約定時に共有するなど迅速に共有を行う必要がある。ただし、報告に間に合うよう UTI の共有を行うことを前提として、付番者からの UTI の共有に時間がかかる場合、（本来の付番者ではない）報告義務者が付番を行う仮 UTI を報告することも考えられる。当該仮 UTI については、正式な UTI が付番され次第、速やかに差し替える必要がある。

⁴ non-deliverable forward

⁵ non-deliverable option

⁶ 取引プラットフォームを利用する場合、取引プラットフォームで付番した UTI を照合プラットフォームを通じて共有する場合に限る（「(2) ①」の記載も同様。）。

⁷ SWIFT メッセージにおいて、UTI のタグは「22M (UTI Namespace/Issuer Code) , 22N(Transaction Identifier)」として設定されている。

(2) 商品別の共有の考え方

(1) の考え方に基づく商品別のより詳細な共有の考え方は以下のとおりとなる。ここに記載していない商品については取引当事者間で決定する。

① 金利系デリバティブ、CDS

分類①	分類②	分類③	共有方法
取引プラットフォーム利用	清算集中	α 取引	照合プラットフォーム
		$\beta \cdot \gamma$ 取引	清算機関から共有を受ける必要がある場合は清算機関から金融機関に共有（レポート等のツールを利用）
	非清算集中		照合プラットフォーム
照合プラットフォーム利用	清算集中	α 取引	照合プラットフォーム
		$\beta \cdot \gamma$ 取引	清算機関から共有を受ける必要がある場合は清算機関から金融機関に共有（レポート等のツールを利用）
	非清算集中		照合プラットフォーム
上記以外の取引			一例として、紙コンファメーション又は e-mail

② エクイティデリバティブ

分類	共有方法
照合プラットフォームを利用	照合プラットフォーム
上記以外の取引	紙コンファメーション又は e-mail

③ 通貨オプション、NDF、NDO

SWIFT、紙コンファメーション又は e-mail で共有する。

5. その他の論点

(1) 新規付番が必要なライフサイクルイベント

テクニカル・ガイダンスに沿って、個別取引ごとに付番の必要性を検討する必要がある。

基本的な考え方は以下の通りである。なお、取引が終了し、他の1つ又は複数の取引がこれに代わる場合、新たな UTI を使用する⁸。

- (i) すでに報告されているデリバティブ取引に関する新たな情報が報告された場合、又は過去に報告された情報の一部が変更された場合、従来と同じ UTI を使って当該報告を更新する。例えば、以下のようなケースが考えられる。

⁸ スワプションにおいては、新規取引時に UTI を付すとともに、オプション実行（Exercise）時に Underlying のスワップが新たに生成されることから、当該スワップに新規の UTI を付すとともに、スワプションの新規取引時の UTI を Prior UTI として報告する。

- a. 再評価又はこれに類似した内容が報告された場合。
 - b. 取引がコンファームされたか否かといった、過去に報告された情報の一部が変更された場合。
 - c. 契約が、アモチ付スワップ又はこれに類似するものであり、契約期間に応じて想定元本が変動している場合。
 - d. 期限前契約解除といった、取引の存続が終了する事象が報告された場合⁹。
 - e. 過去に報告された情報の一部に UTI 以外の誤りがあり修正された場合。ただし、誤った情報が UTI 自体ではない場合に限る。
- (ii) 上記(i)以外のケースでは新たな UTI を付番・使用する。例えば、以下のようなケースが考えられる。
- a. いずれかのカウンターパーティに関する変更があった場合（ノベーション¹⁰や一方のカウンターパーティが清算機関となる清算集中取引等）
 - b. 関与するカウンターパーティが同じか、異なっているかに関わらず、デリバティブ取引が1つ又は複数の他のデリバティブ取引に置き換えられた場合（コンプレッション等）

（２） 既存取引の取扱い

既存取引について施行日時点をもって更新することとなる場合において、UTI に着目すると、①何ら付番がなされていないケース、②USI（Unique Swap Identifier）やテクニカル・ガイドランスに従っていない UTI など何等かの識別番号が付番されているケースがあると考えられるが、①の場合は報告義務者において新たに付番した UTI を、②の場合は当該識別番号を報告する。なお、報告義務者同士の取引の場合、①で新たに付番される UTI について、お互いに共有する必要はなく、個々に異なる UTI を付番して報告してもかまわない。

以 上

⁹ 部分的な解約（partial unwind）も同様の取扱い。

¹⁰ 完全なノベーション（full novation）の場合には、ノベーション時の（カウンターパーティが変更された）取引に新規の UTI を付すとともに、終了したオリジナル取引の UTI を Prior UTI として報告する必要がある。部分的なノベーション（partial novation）の場合、オリジナル取引の UTI に変更はなく存続し、ノベーション時の（カウンターパーティが変更された）取引には新規の UTI を付すとともにオリジナル取引の UTI を Prior UTI として報告する必要がある。