

**米国商品先物取引委員会に対する取引情報等の報告に係る
金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の取扱いの一部改正について**

I. 改正趣旨

現在、当社は、当社の金利スワップ取引清算業務に関し、米国商品取引法（Commodity Exchange Act）に基づく当社のデリバティブ清算機関（Derivative Clearing Organization (DCO)）の登録手続きを進めており、米国商品取引法に基づく当社のDCO登録義務及び清算参加者が当社で清算する取引に係る米国商品取引法上の義務について、ノーアクションレターを取得している。当該ノーアクションレターにおいて、清算参加者が、CFTCの規制に基づいて、CFTCに登録しているSwap Data Repository (SDR) に報告を行った取引を当社で清算した場合、当社は当該清算された取引について、本年4月1日以降、CFTCの規制に基づいてSDRに対して報告を行うことが求められていることから、金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の取扱いについて、別紙のとおり所要の制度改正を行う。

記

II. 改正概要

○取引情報等の報告

- ・当社は、CFTCの規制に基づき、自己取引口座及び委託取引口座ごとの清算約定等について、米国商品先物取引委員会に対し、当社営業日ごとに報告を行う。
- ・当社は、CFTCの規制に基づき、清算約定の想定元本その他経済条件に係る情報等について、SDRに対し、当社営業日ごとに報告を行う。

(備考)

金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の取扱い第47条の4

III. 施行日

平成26年4月1日から施行する。

以上

金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書の取扱いの一部改正新旧対照表

新	旧
<p>(清算約定の内容等の報告)</p> <p>第47条の4 当社は、CFTC Regulation Part 39.19 (c) (1)の規定に基づき、自己取引口座及び委託取引口座ごとの清算約定、その想定元本に係る情報、当初証拠金所要額、当初証拠金預託額、変動証拠金所要額及び決済金額について、米国商品先物取引委員会に対し当社営業日ごとに報告を行うものとする。</p> <p>2 当社は、CFTC Regulation Part 45に基づき、清算約定について、その当事者（清算約定（委託分）にあつては、当該清算約定（委託分）に係る清算委託取引の当事者である清算委託者。）及び想定元本その他の経済条件に係る情報のうち該当するものについて、Swap Data Repository (Commodity Exchange Act Section 1a (48) に規定されている者をいう。) に対し当社営業日ごとに報告を行うものとする。</p> <p style="text-align: center;">付 則</p> <p>この改正規定は、平成26年4月1日から施行する。</p>	<p>(新設)</p>