

**香港規制への対応に伴う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

2016年8月31日付で、当社は、金利スワップ取引に係る清算業務に関し、香港の Securities and Futures Ordinance(以下「SFO」という。)に基づき、Securities and Futures Commission (以下「SFC」という。)から、当社が香港法人を相手に OTC デリバティブ清算業務を行う上で必要となる Automated Trading Services の提供について承認を受け、かつ、SFO に基づく店頭デリバティブ清算集中義務を履行するために取引当事者が利用できる清算機関として指定された。当該承認において、清算約定等に係る当社から SFC への報告義務が課せられ、また、SFO において、清算約定に係る当社の Hong Kong Monetary Authority への報告義務が定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改正を行う。

II. 改正概要

1. 清算約定等に係る当社による SFC への報告

- ・ 当社は、SFC に対し、月ごと及び四半期ごとに各 Hong Kong Clearing Member (※) の清算約定に係る件数、想定元本、当初証拠金、清算基金等の情報を報告する。

(※) SFC が SFO Section 95(2)の規定に基づき交付した 2016年8月31日付 Notice of Authorization to Provide Automated Trading Services 1.1 に規定される Hong Kong Clearing member をいう。

2. 清算約定に係る当社による香港の取引情報蓄積機関への報告

- ・ 当社は、SFO 及び Securities and Futures(OTC Derivative Transactions - Reporting and Record Keeping Obligations) Rules に基づき、Hong Kong Monetary Authority に対し、清算約定に係る取引情報を報告する。

(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(以下「業務方法書の取扱い」という。)第47条の4第7項及び第8項

・ 業務方法書の取扱い第47条の4第9項

III. 施行日

2016年9月30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) 第47条の4 (略) 2～6 (略) 7 当社は、<u>Securities and Futures Commission</u> (以下「香港証券先物委員会」という。)が<u>Securities and Futures Ordinance</u> (以下「SFO」という。) <u>Section 95 (2)</u>の規定に基づき交付した2016年8月31日付<u>Notice of Authorization to Provide Automated Trading Services</u> (以下「ATS承認通知」という。) 5に定めるところに従い、四半期ごとに、香港証券先物委員会に対し、各<u>Hong Kong Clearing Member</u> (ATS承認通知 1.1に規定される<u>Hong Kong Clearing Member</u>をいう。)の清算約定に関し、その件数、想定元本、当初証拠金所要額、当初証拠金預託額、当社に預託している金利スワップ清算基金の額その他の情報について報告を行うものとする。 8 当社は、香港証券先物委員会が<u>SFO Section 101J (1)</u>の規定に基づき交付した2016年8月31日付<u>Notice of Designation 4</u>に定めるところに従い、月ごとに、香港証券先物委員会に対し、前項の情報について報告を行うものとする。 9 当社は、<u>SFO</u>及び<u>Securitie</u></p>	<p>(清算約定の内容等の報告) 第47条の4 (略) 2～6 (略) (新設) (新設) (新設)</p>

s and Futures (OTC Derivative Transactions - Reporting and Record Keeping Obligations) Rulesの規定に基づき、Hong Kong Monetary Authorityに対し、清算約定に関し、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。）、想定元本その他の情報について報告を行うものとする。

付 則

この改正規定は、平成28年9月30日から施行する。