

○金融庁告示第四十八号

金融商品取引業等に関する内閣府令（平成十九年内閣府令第五十二号）第二百二十三条第十項第五号及び第十一項第五号の規定に基づき、同条第一項第二十一号の五又は第二十一号の六に規定する措置を講じなくても公益に反し又は投資者の保護に支障を生ずるおそれがないと認められる場合を次のように指定する。

平成二十八年十月二十一日

金融庁長官 森 信親

（定義）

第一条 この告示において、次の各号に掲げる用語の意義は、当該各号に定めるところによる。

一 金融商品取引業者等 金融商品取引法（昭和二十三年法律第二十五号。以下「法」という。）第三十条四号に規定する金融商品取引業者等をいう。

二 対象外国法令等 次のイ又はロに掲げる国の区分に応じ、当該イ又はロに定める外国の法令その他の規則（これに関連する外国の法令その他の規則を含み、金融商品取引業等に関する内閣府令（以下「府令」という。）第二百二十三条第一項第二十一号の五及び第二十一号の六に規定する措置に相当する措置

に関する部分に限る。)をいう。

イ アメリカ合衆国 Dodd-Frank Wall Street Reform and Consumer Protection Act

ロ カナダ Guideline E-22 Margin Requirements for Non-Centrally Cleared Derivatives

三 対象外国当局 次のイ又はロに掲げる国の区分に応じ、当該イ又はロに定める外国の当局（当該外国の当局から対象外国法令等に関する権限の委任を受けた者を含む。）をいう。

イ アメリカ合衆国 Commodity Futures Trading Commission

ロ カナダ Office of the Superintendent of Financial Institutions

四 外国定量的計算モデル 定量的計算モデル（金融商品取引業等に関する内閣府令第二百二十三条第一項第二十一号の六イの規定に基づき、金融庁長官が定める潜在的損失等見積額を算出する方法を定める件（平成二十八年金融庁告示第十五号。第三条において「告示」という。）第一条第一項の定量的計算モデルをいう。第三条第一項において同じ。）に相当するものであって、対象外国法令等に規定されているものをいう。

（府令第二百二十三条第一項第二十一号の五に規定する措置を講じなくても公益に反し又は投資者の保護に

支障を生ずるおそれがないと認められる場合)

第二条 府令第二百二十三条第十項第五号に規定する金融庁長官が指定する場合は、当分の間、金融商品取引業者等が行った非清算店頭デリバティブ取引(同条第一項第二十一号の五に規定する非清算店頭デリバティブ取引をいう。以下この条において同じ。)に対し、同条第一項第二十一号の五の規定及び対象外国法令等が重複適用される場合において、当該金融商品取引業者等が、当該非清算店頭デリバティブ取引について当該対象外国法令等に準拠して、同号に規定する措置に相当する措置を講じている場合(当該非清算店頭デリバティブ取引の当事者に対し、当該対象外国法令等を執行する対象外国当局が適切な監督を行う場合に限る。)とする。

(府令第二百二十三条第一項第二十一号の六に規定する措置を講じなくても公益に反し又は投資者の保護に支障を生ずるおそれがないと認められる場合)

第三条 府令第二百二十三条第十一項第五号に規定する金融庁長官が指定する場合は、当分の間、次の各号に掲げる要件のいずれにも該当する場合とする。

一 金融商品取引業者等が行った非清算店頭デリバティブ取引(府令第二百二十三条第一項第二十一号の六

に規定する非清算店頭デリバティブ取引をいう。以下この号において同じ。）に対し、同号の規定及び対象外国法令等が重複適用される場合において、当該金融商品取引業者等が、当該非清算店頭デリバティブ取引について当該対象外国法令等（当該非清算店頭デリバティブ取引について当該金融商品取引業者等の相手方のみが当該対象外国法令等の適用を受ける場合にあつては、告示第一条第二項に規定する定量的計算モデルの届出及びこれに関連する規定に相当する部分を除く。）に準拠して、同号に規定する措置に相当する措置を講じていること（当該非清算店頭デリバティブ取引の当事者に対し、当該対象外国法令等を執行する対象外国当局が適切な監督を行う場合に限る。）。

二 次のイ又はロのいずれかに該当すること（前号の措置を講じる場合において、定量的計算モデル及び外国定量的計算モデルを用いない場合並びに告示第一条第二項の規定に基づく届出を行っている場合を除く。）。

イ 金融商品取引業者等（外国（第一条第二号イ及びロに掲げる国に限る。以下この号において同じ。

）の法令に準拠して設立された者及び親会社（法第五十七条の二第八項に規定する親会社をいい、他の会社（外国会社を含む。）の子会社（法第二十九条の四第三項に規定する子会社をいう。）である

ものを除く。ロにおいて同じ。）が外国の法令に準拠して設立されたものである者を除く。）が、前号の措置を講じようとする場合において、定量的計算モデルを用いようとするときに、あらかじめ、告示第七条第一項各号に掲げる事項を記載した届出書に同条第二項各号に掲げる書類を添付して金融庁長官に提出していること。

ロ 金融商品取引業者等（外国の法令に準拠して設立された者及び親会社が外国の法令に準拠して設立されたものである者に限る。）が、前号の措置を講じようとする場合において、外国定量的計算モデルを用いようとするときに、あらかじめ、次に掲げる事項を記載した届出書を金融庁長官に提出していること。

- (1) 当該外国定量的計算モデルが規定されている対象外国法令等の名称
- (2) (1)の対象外国法令等を執行する対象外国当局の名称
- (3) 当該外国定量的計算モデルの使用を開始する日
- (4) 当該外国定量的計算モデルの使用に係る責任者の氏名並びに連絡担当者の氏名及び電話番号その

他の連絡先

2 前項第二号イ又はロの届出書を提出した金融商品取引業者等は、次の各号のいずれかに該当するときは、遅滞なく、その旨及びその内容を金融庁長官に届け出るものとする。

一 前項第二号イの届出書（以下この号において「届出書」という。）を提出した場合において、次のイからハまでのいずれかに該当するとき。

イ 届出書の記載事項に変更があるとき。

ロ 届出書の添付書類の記載事項に重要な変更があるとき。

ハ 告示第三条から第六条までの規定に反することとなったとき。

二 前項第二号ロの届出書を提出した場合において、当該届出書の記載事項に変更があるとき。

附 則

1 この告示は、公布の日から適用する。

2 この告示は、平成二十八年九月一日からこの告示の適用の日の前日までの間に行われた非清算店頭デリバティブ取引（第二条又は第三条第一項第一号に規定する非清算店頭デリバティブ取引をいう。）についても適用する。この場合において、同項第二号中「あらかじめ」とあるのは、「遅滞なく」とする。

