

コメントの概要及びコメントに対する金融庁の考え方

店頭デリバティブ取引等の規制に関する内閣府令		
1	<p>報告項目を規定している第4条第1項及び第8条第1項は、現行通りであるが、報告項目に追加・変更はあるか。また、その場合定義等詳細はいつまでに公表されるかご教示願いたい。</p>	<p>今回、報告項目に追加・変更はありません。 報告項目の追加・変更は、施行後の状況や識別子の状況も踏まえつつ検討し、必要に応じ、店頭デリバティブ取引等の規制に関する内閣府令等の改正を行うこととなります。</p>
2	<p>取引情報蓄積機関又は指定外国取引情報蓄積機関に提供する情報の範囲について、金融商品取引業者等が提供する取引情報は現行と同様という理解でよいか。</p>	<p>御理解のとおりです。</p>
3	<p>営業日の定義について、ここで記載されている「営業日」とは金融商品取引業者等のそれぞれの営業日という理解でよいか。例えば銀行であれば銀行法にもとづく休日以外を営業日と考えるという理解でよいか。</p>	<p>御理解のとおりです。</p>
4	<p>非清算集中等取引情報の対象となる取引を行った場合に非清算集中等取引情報を提供しなければならない金融商品取引業者等について、金融庁ウェブサイト等でリストを公表いただきたい。</p> <p>左記の「金融商品取引業者等のうち金融庁長官の指定する者」に当てはまらない金商業者等は、①店頭デリバティブ取引に係る想定元本の合計額の平均額が3000億円以上の者、及び②同3000億円未満であってもその旨を金融庁長官及び取引情報蓄積機関又は指定外国取引情報蓄積機関に対し報告しなかった者であり、①・②は非清算集中等取引情報の対象となる取引を行った場合に、当該非清算集中等取引情報を提供しなければならないと認識している。</p> <p>①については現行貴庁が公表している「取引規模の届出を行った者の一覧」により把握可能であるが、②については把握困難である。</p> <p>非清算集中等取引情報の対象となる取引を行った場合に、当該非清算集中等取引情報を提供しなければならない者か否かは、今後施行されと考えられる、固有取引識別子（UTI）に係る付番者の判定にあたって、重要な一要素（例：双方が報告義務を有するか否か）となる可能性が高いと考</p>	<p>今後、非清算集中等取引情報の対象となる取引を行った場合に非清算集中等取引情報を提供しなければならない金融商品取引業者等のリストを公表するか否かについては、施行後の状況や固有取引識別子に係る検討状況等を踏まえ、必要に応じ、店頭デリバティブ取引等の規制に関する内閣府令等の改正を行うこととなります。</p>

	えられる。策定される付番ロジック次第ではあるが、当該リストが公表されることにより、その確認が容易となると考えられるため。	
5	第7条第4項は、やむを得ない理由（法第156条の64第2項及び第7条の2に定める理由を除く。）により期日までに非清算集中等取引情報の提供ができない場合に、金融庁長官の承認を得て、情報の提供を延長できる旨が規定しているが、金融商品取引業者等側ではなく、取引情報蓄積機関側の一時的なシステムエラーや電気通信回線の故障等が原因であっても、金融商品取引業者等側が金融庁長官の承認を得る必要があるのか。仮にその場合、多くの金融商品取引業者等に負荷が生じることとなる。	やむを得ない理由（法第156条の64第2項及び第7条の2に定める理由を除く。）は主に、金融商品取引業者等側において生じることを想定しており、基本的には金融庁長官の承認を得る必要がありますが、御指摘の事例において、承認を受ける必要があるか否かは、個別事例ごとの状況に即して、実質的に判断してまいります。
6	承認申請書および理由書の作成・送付に当たっては、印鑑レス・電磁的送付方法（メール等）を許容する等、手続きの簡素化をご検討いただきたい。 現状では、書面内容の貴庁との調整・合意、頭取印押印というプロセスを経て書面を提出することを想定しているが、不測の事態により情報の提供を延期しなければならない場合、短期間に当該書面を提出することは極めて困難と考えられる。特に昨今のコロナ禍においてはオフィスでのオペレーション自体が困難となる可能性も高く、貴庁において上述趣旨を十分に考慮し実務的に対応可能なフローとしていただきたい。	貴重な御意見ありがとうございます。 金融庁全体での検討に合わせて、検討を進めてまいります。
7	第7条の2で規定されている「やむを得ない理由」により、法第156条の64第2項にもとづき、取引情報蓄積機関又は指定外国情報蓄積機関ではなく「内閣総理大臣に報告」を行う場合、金融庁長官の承認は不要という理解でよいか。	御理解のとおりです。
8	法第156条の64第2項で規定される「災害その他内閣府令で定めるやむを得ない理由」に該当するような事象であっても、当該事象が一時的/短期的なものと判断される場合（※）には、第7条第4項の「やむを得ない理由」にもとづく取引情報蓄積機関への情報の提供の「延期」を適用可能としていただきたい。 ※例えば、災害（雪害等）による一時的な回線の切断等。	「災害その他内閣府令で定めるやむを得ない理由」があるか否かは、個別事例ごとの状況に即して、実質的に判断されるべきものですが、御指摘の事例のような、災害（雪害等）による一時的な回線の切断等といった場合は、法156条の64第2項で定める「やむを得ない理由」ではなく、府令第7条第4項の「やむを得ない理由」にもとづく取引情報蓄積機関への情報の提供の「延期」を適用することになるものと考えます。

9	<p>「非清算集中等取引情報を提供するために使用する電気通信回線の故障が発生した場合であって、回復する見込みがないこと」とは、取引情報蓄積機関、金融商品取引業者等のいずれか、もしくは両者の電気通信回線の故障等が発生した場合が含まれるという理解でよいか。</p>	<p>個別事例ごとの状況に即して、実質的に判断されるべきものですが、基本的には取引情報蓄積機関の電気通信回線の故障が発生していることが必要であり、金融商品取引業者等の電気通信回線が故障している場合には、取引情報蓄積機関への情報の提供の延期をしていただくものと考えます。</p>
10	<p>第8条第2項で規定される「非清算集中等取引情報を提供することができないとき」とは、「取引情報蓄積機関又は指定外国情報蓄積機関に」対し、情報を提供できないとき、という理解でよいか。</p>	<p>御理解のとおりです。</p>
11	<p>第9条第7項は、法第156条の64第2項及び第7条の2に規定する理由により「内閣総理大臣への報告」を行っており、かつ第9条第4項に於ける延期の手続きを行っていた場合において、</p> <p>「法第156条の64第2項及び第7条の2に規定する理由」が消滅した場合、延期の手続きにより未済となっていた内閣総理大臣への報告も含めて取引情報蓄積機関又は指定外国取引情報蓄積機関に対し、非清算集中等取引情報を提供する、という趣旨でよいか。</p> <p>「法第156条の64第2項及び第7条の2に規定する理由」と第9条第4項に規定する「やむを得ない理由」は必ずしも因果関係がないケースもあると考えられるため、確認するもの。</p>	<p>御理解のとおりです。</p>
<p>店頭デリバティブ取引等の規制に関する内閣府令（平成二十四年内閣府令第四十八号）第三条の二第四号及び第七条の二の規定に基づき、第三条の二第四号及び第七条の二第四号に規定するやむを得ない理由を指定する件</p>		
12	<p>当該告示については、「やむを得ない理由」の解消に向け対応していることを前提に、特段、契約締結や体制整備の期限は設けず、恒久的なものとする理解でよいか。時限性がある場合にはそれを明示いただきたい。</p>	<p>恒久的なものではなく、ご意見の通り、本告示の附則に、本告示の失効時期を明示しております。</p>
13	<p>「金融商品取引業者等が、取引情報蓄積機関又は指定外国取引情報蓄積機関との間で、取引情報収集契約を締結することを予定している場合」とは、取引情報蓄積機関との間で取引情報収集契約を締結することを機関決定している、取引情報蓄積機関との間で議論を進めているなど、契約締結に向けた具体的なアクションを取っている場合も含まれるという理解でよいか。</p>	<p>御理解のとおりです。</p>

14	<p>金融商品取引業者等が非清算集中等取引情報を提供するための体制整備にはシステム開発が含まれるという認識で正しいか。またその場合、システム開発等の体制整備に要する期間はどの程度と想定されているかご教示いただきたい。</p>	<p>御理解のとおりです。</p> <p>個別事例ごとの状況に即して、実質的に判断されるべきものですが、システム開発等の体制整備に要する期間は、おおむね令和4年10月末までには完了しているものと想定しております。</p>
<p>店頭デリバティブ取引等の規制に関する内閣府令（平成二十四年内閣府令第四十八号）第七条第三項及び第八条第四項の規定に基づき、金融庁長官が定める金融商品取引業者等及び取引を指定する件</p>		
15	<p>「店頭デリバティブ取引等の規制に関する内閣府令第7条第3項及び第8条第4項に規定する金融庁長官が指定する者」である旨の報告の頻度について、毎年度定期的に報告する必要があるのか、それとも、一度の報告で足りるのか。</p> <p>一度の報告で足りる場合は、想定元本額の合計額の平均額が上昇等し、当該者でなくなった場合に、その旨を報告する必要があるのか。</p>	<p>「店頭デリバティブ取引等の規制に関する内閣府令第7条第3項及び第8条第4項に規定する金融庁長官が指定する者」である旨の報告は、一度していただければ足りる。もっとも、当該報告を行った者の想定元本額の合計額の平均額が上昇等し、すべての非清算集中取引情報について、情報提供義務等が発生した後に、再度想定元本額の合計額の平均額が減少した場合において、「店頭デリバティブ取引等の規制に関する内閣府令第7条第3項及び第8条第4項に規定する金融庁長官が指定する者」に該当するためには、再度その旨を報告する必要があるものと考えます。</p>
16	<p>「当該各号に定める取引を除く取引に関する非清算集中等取引情報とする」とあるが、提供する対象は「当該各号に定める取引を除く府令第七条第一項に規定する非清算集中等取引情報の対象となる取引」に係る情報という理解でよいか。</p>	<p>御理解のとおりです。</p>
17	<p>取引情報蓄積機関（TR）の利用義務が global harmonization と TR 接続に関する経過措置終了を企図するものであると理解する。しかし一方で、取引規模の小さい金融機関について報告義務を免除するのは、harmonization の流れと逆行する。将来的な UTI 報告義務化の際に、いわゆる国際的に合意された UTI 作成の tie-breaker rule の例外になることも想定されるが、報告義務の免除にどのような意図があるのか。</p>	<p>店頭デリバティブ取引に係る平時のモニタリングを強化し、危機時における迅速・適切な対応を可能にするという取引情報の保存・報告制度の趣旨、金融庁のモニタリングへの影響を踏まえつつ、取引情報蓄積機関の利用が義務付けられることにより、行っている店頭デリバティブ取引の規模に比して、負担が増大することになる金融機関に対する負担を緩和するための措置です。</p>