

## 美国商品期货交易委员会通过掉期数据记录和报告要求的修正案

2020年11月25日，美国《联邦公报》发布了文章《美国商品期货交易委员会通过掉期数据记录和报告要求的修正案》<sup>1</sup>，规定了掉期数据存储库（SDR）、衍生品清算组织（DCO）、掉期执行机构（SEF）、指定合约市场（DCM）、掉期交易商（SD）、主要掉期参与者（MSP）以及既非SD也非MSP的掉期交易对手的掉期数据记录和报告要求。这些修正案简化了报告新掉期的要求，界定并采用了与国际技术指南相一致的掉期数据要素，减轻了既非SD也非MSP的报告对手方的报告负担。该规定将于2021年1月25日正式生效。修正案在交换数据报告规则（第45部分）中增加了全球法人识别编码体系（GLEIS）、全球法人识别编码（LEI）和全球法人识别编码监管委员会（ROC）三个定义。

美国商品期货交易委员会（以下简称“委员会”）通过清理更改以删除有关LEI的不必要的过时规章条文和更改SEF、DCM、DCO、SDR、报告方和非报告方的LEI规章的方式修订了45.6的规章。

委员会在45.6的导言部分增加了“维护”一词，以申明每个有资格获得LEI的SEF、DCM、DCO、SDR和根据45.9提交报告的实体以及任何掉期交易的交易方，都必须进行“维护”，并通

---

<sup>1</sup> 文章详见：  
<https://www.federalregister.gov/documents/2020/11/25/2020-21569/swap-data-recordkeeping-and-reporting-requirements>

过单一的 LEI 可获得所有的记录保存和掉期数据报告，且在其中被识别。

委员会增加了本地系统（LOU）和参考数据的定义。LOU 是指根据 GLEIS 的规则授权发布 LEI 的实体。参考数据是指 GLEIS 的规则中规定的，分配 LEI 的法人实体或个人的所有标识和关系信息。

委员会同时修订了自我注册和第三方注册的定义。经修订的自我注册是指法人或个人提交自己的参考数据。经修订的第三方注册是指由除提交的参考数据所标识的法人实体或组织之外的实体或组织为或可能成为掉期交易对手的法人实体或法律实体提交参考数据。第三方注册的示例包括（但不限于）SD 或 MSP 提交其掉期交易对手的参考数据，以及国家编号机构，国家注册机构或数据服务提供商提供的有关法人的参考数据代理机构或服务提供商保留信息的个人。

委员会针对 LEI 的国际标准对 45.6(b) 进行了若干修订。修订后要求所有记录保存和所有掉期数据报告中使用的 LEI，应符合根据国际标准化组织发布的 ISO 17442 标准。委员会建议删除 45.6(b) 中的技术原则、45.6(c) 中的治理原则和 45.6(e) 中 GLEIS 是否满足委员会要求程序等相关规定。委员会认为，GLEIS 已制定并已采用或符合了上述原则或规定。委员会对 45.6(e) 中的 LEI 参考数据报告进行了修订。经修订的参考数据报告表述为每种 SEF，DCM，DCO，SDR，根据 45.9 规定的实体报告以及任何

掉期对手的参考数据，均应通过自我注册，第三方注册或同时通过这两种方式报告给根据 GLEIS 设定的标准的 LOU。在发生任何此类更改或发现需要更改的数据后，应在技术上可行的情况下，尽快通过自我注册，第三方注册或同时通过这两种方式将先前报告的参考数据的所有后续更改和更正报告给 LOU。

委员会对使用 LEI 的规定提出了以下实质性更改。（1）每个 SEF，DCM，DCO，SDR，根据 45.9 报告的实体以及掉期交易对手方均应使用 LEI 在所有记录保存和根据本部分报告的所有掉期数据中识别其自身和掉期交易对手方。如果掉期交易对手方不符合 GLEIS 确定的 LEI，则应在所有记录保存和根据本部分报告的所有掉期数据中，应使用委员会根据本章 45.13(a) 规定的备用识别编码来识别该交易方。（2）每个 SD，MSP，SEF，DCM，DCO 和 SDR 均应按照 GLEIS 的要求维护和更新其 LEI。（3）每个报告交易对手的金融实体和有资格获得 LEI 但尚未分配 LEI 的交易对手进行交易，应在报告这种掉期交易的任何所需的掉期创建数据之前，尽最大努力将 LEI 分配给交易对手。如果这些努力未能在报告所需的掉期创建数据之前将 LEI 分配给交易对手，则报告交易方的金融实体应立即向委员会提供交易对手的身份和联系信息。（4）对于先前根据本部分报告的掉期交易，在委员会指定 GLEIS 之前使用由 SDR 分配的替代交易对手识别编码，每个 SDR 均应在每次此类掉期的记录中将交易对手的 LEI 对应到替代交易对手识别编码上。

原文链接:

<https://www.federalregister.gov/documents/2020/11/25/2020-21569/swap-data-recordkeeping-and-reporting-requirements>