
「公社債の店頭売買の参考値等の発表及び売買値段に関する規則」の一部改正について

日証協 平成29年8月3日

本協会では、本年8月3日付で決議された持回り自主規制会議において、平成30年5月1日から実施予定の国債決済期間の短縮（T+1）化に伴う銘柄後決めGCレポ取引の導入に対応するとともに、公社債店頭売買に係る本協会の発表内容を拡充するための各種報告書様式の再編等を行い、併せて報告義務の対象となる協会員を拡大するため、「公社債の店頭売買の参考値等の発表及び売買値段に関する規則」の一部改正を行った。

本規則改正は、国債決済期間の短縮（T+1）化の実施日（平成30年5月1日を予定）から施行する。

本件の趣旨骨子及び新旧対照表等は、以下のとおりである。

「公社債の店頭売買の参考値等の発表及び売買値段に関する規則」の一部改正について

平成 29 年 8 月 3 日
日本証券業協会

I. 改正の趣旨

今般、平成 30 年 5 月 1 日から実施予定の国債決済期間の短縮（T+1）化に伴う銘柄後決め GC レポ取引の導入に対応するとともに、公社債店頭取引に係る本協会の発表内容を拡充することとし、各種報告書様式の再編等（※）を行い、合わせて報告義務の対象となる協会員を拡大するため、「公社債の店頭売買の参考値等の発表及び売買値段に関する規則」の一部を改正することとする。

II. 改正の骨子

- (1) 「公社債種類別店頭売買高報告書」、「公社債投資家別売買高報告書」及び「国債投資家別売買高報告書」を「公社債店頭売買高報告書」に統合し、本協会からの発表資料を「公社債種類別店頭売買高」、「公社債投資家別売買高」及び「国債投資家別売買高」から「公社債店頭売買高」に統合する。

（第 10 条第 1 項、第 10 条第 2 項、第 11 条第 1 項、第 11 条第 2 項）

- (2) 報告対象の協会員について、現在、会員については東京地区協会に所属する会員が対象となっているが、東京地区協会に所属する会員以外の会員も、第 11 条の月間売買高等の報告を行うこととする。

（付則（昭 51. 12. 20）、付則（平 6. 2. 16））

III. 施行の時期

この改正は、国債決済期間の短縮（T+1）化の実施日（平成 30 年 5 月 1 日を予定）から施行する（注）。

（注）公社債店頭売買高の報告は翌月 10 日までに行うこととされていることから、国債決済期間の短縮（T+1）化が平成 30 年 5 月 1 日から実施される場合、この改正は、平成 30 年 6 月に行う報告から適用される。

(※)【参考】公社債店頭取引に係る各種報告書様式の再編等の概要は以下のとおり。

1. 国債決済期間の短縮（T+1）化に伴う見直し

国債決済期間の短縮（T+1）化に伴い導入される銘柄後決め GC レポ取引における国債バスケット取引を報告項目として追加する。なお、当該バスケット取引の報告金額は、約定金額（バスケットベースのスタート受渡金額（グロス））とする。（対象：「公社債店頭売買高報告書」及び「公社債条件付売買残高報告書」）

2. 報告書の再編

新たに、国債以外についても、投資家別の売買状況を報告することとし、「公社債種類別店頭売買高報告書」、「公社債投資家別売買高報告書」、「国債投資家別売買高報告書」を「公社債店頭売買高報告書」に統合する。

3. その他の変更

次のとおり、債券種類の区分について見直しを行う。（対象：「公社債店頭売買高報告書」）

- ① 「交通債・放送債」の区分を廃止し、「社債」中の「一般債」の区分に統合。
- ② 「金融債」の内訳である「利付」「割引」の区分を廃止。
- ③ 「社債」の内訳である「公募電債」「電力債」「一般債」のうち、「公募電債」の区分を廃止し、「一般債」の区分に統合。

4. 本協会における発表

上記1. から3. までの再編等に合わせて、本協会が発表する統計の見直しを行う。

○ 本件に関するお問い合わせ先

日本証券業協会 公社債・金融商品部 （TEL 03-3667-8456）

以 上

新	旧
<p data-bbox="204 271 600 309"><u>2</u> (現行どおり)</p> <p data-bbox="416 383 568 421">付 則</p> <p data-bbox="204 461 778 533">この改正は、国債の決済期間の短縮 (T + 1) 化の実施日から施行する。</p>	<p data-bbox="807 271 1203 309"><u>3</u> (省 略)</p>

「公社債の店頭売買の参考値等の発表及び売買値段に関する規則」の一部改正（案）
に関するパブリックコメントの結果について

平成 29 年 8 月 3 日
日 本 証 券 業 協 会

本協会では、「公社債の店頭売買の参考値等の発表及び売買値段に関する規則」の一部改正（案）につきまして、平成 29 年 6 月 21 日から平成 29 年 7 月 20 日までの間、パブリックコメントの募集を行いました。

その結果、当該期間内に寄せられた御意見はありませんでしたので、別紙のとおり改正を行うことといたします。

以 上

公社債店頭売買高（一般売買）報告

（公社債の店頭売買の参考値等の発表及び売買値段に関する規則第11条第1項の規定に基づく報告）

区分	
協会コード	
年(西暦)	
月	

年 月 日

協会員名 _____
 担当部課名 _____
 担当者名 _____
 電話番号 _____

(単位：百万円)

No.	売買等の別 種類 投資家	顧客の売 (A)																
		国 債					国債バスケット	公募地方債	政府保証債	財投機関債等	金融債	円貨建外債	社債		特定社債	新株予約権付社債	非公募債	
		超長期国債	長期国債	中期国債	割引国債	国庫短期証券等							電力債	一般債			地方債	その他
10	都市銀行	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
20	地方銀行	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
30	長期信用銀行等	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
40	信託銀行	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
50	農林系金融機関	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
60	第二地銀協加盟行	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
70	信用金庫	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
80	その他金融機関	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
90	生保・損保	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
100	投資信託	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
110	官公庁共済組合	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
120	事業法人	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
130	その他法人	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
140	外国人	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
150	個人	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
160	その他	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
170	債券ディーラー	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
999	合計	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0

本様式は現時点での案であり、今後システム開発等の都合により変更となる可能性があります。

区分	
協会コード	
年(西暦)	
月	

No.	売買等の別 種類 投資家	r	s	t	u	v	w	x	y	z	aa	ab	ac	ad	ae	af	ag	ah
		顧客の買 (B)																
		国 債						国債バスケット	公募地方債	政府保証債	財投機関債等	金融債	円貨建外債	社債			非公募債	
超長期国債	長期国債	中期国債	割引国債	国庫短期証券等	電力債	一般債	特定社債							新株予約権付社債	地方債	その他		
10	都市銀行	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
20	地方銀行	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
30	長期信用銀行等	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
40	信託銀行	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
50	農林系金融機関	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
60	第二地銀協加盟行	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
70	信用金庫	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
80	その他金融機関	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
90	生保・損保	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
100	投資信託	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
110	官公庁共済組合	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
120	事業法人	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
130	その他法人	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
140	外国人	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
150	個人	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
160	その他	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
170	債券ディーラー	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
999	合計	0	0	0	0	0	/	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0

本様式は現時点での案であり、今後システム開発等の都合により変更となる可能性があります。

公社債店頭売買高（公社債条件付売買）報告

（公社債の店頭売買の参考値等の発表及び売買値段に関する規則第11条第1項の規定に基づく報告）

区分	
協会コード	
年(西暦)	
月	

年 月 日

協会員名 _____
 担当部課名 _____
 担当者名 _____
 電話番号 _____

(単位：百万円)

No.	売買等の別 種類 投資家	a	b	c	d	e	f	g	h	i	j	k	l	m	n	o	p	q
		顧客の売 (A)																
		国 債					国債バスケット	公募地方債	政府保証債	財投機関債等	金融債	円貨建外債	社債		特定社債	新株予約権付社債	非公募債	
超長期国債	長期国債	中期国債	割引国債	国庫短期証券等	電力債	一般債							地方債	その他				
10	都市銀行	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
20	地方銀行	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
30	長期信用銀行等	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
40	信託銀行	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
50	農林系金融機関	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
60	第二地銀協加盟行	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
70	信用金庫	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
80	その他金融機関	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
90	生保・損保	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
100	投資信託	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
110	官公庁共済組合	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
120	事業法人	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
130	その他法人	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
140	外国人	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
150	個人	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
160	その他	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
170	債券ディーラー	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
999	合計	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0

本様式は現時点での案であり、今後システム開発等の都合により変更となる可能性があります。

区分	
協会コード	
年(西暦)	
月	

No.	売買等の別 種類 投資家	r	s	t	u	v	w	x	y	z	aa	ab	ac	ad	ae	af	ag	ah
		顧客の買 (B)																
		国 債					国債バスケット	公募地方債	政府保証債	財投機関債等	金融債	円貨建外債	社債		特定社債	新株予約権付社債	非公募債	
超長期国債	長期国債	中期国債	割引国債	国庫短期証券等	電力債	一般債							地方債	その他				
10	都市銀行	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
20	地方銀行	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
30	長期信用銀行等	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
40	信託銀行	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
50	農林系金融機関	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
60	第二地銀協加盟行	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
70	信用金庫	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
80	その他金融機関	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
90	生保・損保	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
100	投資信託	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
110	官公庁共済組合	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
120	事業法人	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
130	その他法人	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
140	外国人	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
150	個人	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
160	その他	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
170	債券ディーラー	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
999	合計	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0

本様式は現時点での案であり、今後システム開発等の都合により変更となる可能性があります。

記載上の留意事項

1. 貴社の本店、支店、その他の営業所において取り扱った既発債(外貨建債券を除く。国債の発行日前取引及び上場銘柄を含む。)の市場外売買分全部を、「一般売買」と「条件付売買」とでシートを分けて記載し、翌月10日(当日が休業日の場合は、前営業日)までに本協会公社債・金融商品部市場統計業務室へ協会WANを通じて提出すること。
2. 約定ベースで、額面金額により、百万円単位(単位未満は四捨五入)で記載すること。(「国債バスケット」欄を除く。)
3. 「超長期国債」欄には、償還期限が10年超の国債の売買高を記載すること。
4. 「割引国債」欄には、償還年限1年超の割引国債の売買高及び分離元本振替国債及び分離利息振替国債の売買高を記載すること。
5. 「国庫短期証券等」欄には、国庫短期証券、割引短期国債及び政府短期証券の売買高を記載すること。
- 6-1. 【一般売買用】「国債バスケット」欄は、必ず「0」が入った状態にしておくこと。
- 6-2. 【条件付売買用】「国債バスケット」欄には、銘柄後決め現先取引の売買高を約定ベースで、約定金額により、百万円単位(単位未満は四捨五入)で記載すること。
7. 「財投機関債等」欄には、財投機関債及び地方公社債の売買高を記載すること。
8. 「特定社債」欄には、金融商品取引法第2条第1項第4号に規定する特定社債券の売買高を記載すること。
9. 非分離型新株予約権付社債における権利行使後の同社債券及び分離型新株予約権付社債における分離後の同社債券並びに投資法人債券の売買高は「一般社債」欄に記載すること。
10. 「売」及び「買」は、投資家を主体に記載すること。
11. 「債券ディーラー」欄には、証券会社の売買分及び金融機関ディーラーの商品有価証券勘定の売買分を記載すること。
12. 投資家別の内訳は、別紙投資家区分表によること。
13. 店頭取引の計上方法については、次の要領により記載すること。

売買事例	記載する投資家欄	
	売	買
①自 社 → 債券ディーラー	非計上	債券ディーラー
②債券ディーラー → 自 社	債券ディーラー	非計上
③顧 客 → 自 社	顧 客	非計上
④自 社 → 顧 客	非計上	顧 客

- (注) a. 顧客とは、「債券ディーラー」を除く投資家であり、金融機関の場合は投資勘定での売買分。
 b. 債券ディーラーとは、証券会社の売買分及び金融機関ディーラーの商品有価証券の売買分。

本様式は現時点での案であり、今後システム開発等の都合により変更となる可能性があります。

公社債条件付売買残高報告書

(公社債の店頭売買の参考値等の発表及び売買値段に関する規則第11条第2項の規定に基づく報告)

年 月 日

区分	協会員コード	年(西暦)	月

協会員名 _____
 担当部課名 _____
 担当者名 _____
 電話番号 _____

(単位:百万円)

No.	残高別 相手方別	a		b		c		d	
		協会員の買入残高				協会員の売却残高			
		銘柄後決め取引 以外		銘柄後決め取引※		銘柄後決め取引 以外		銘柄後決め取引※	
10	都市銀行	0	0	0	0	0	0		
20	地方銀行	0	0	0	0	0	0		
30	長期信用銀行等	0	0	0	0	0	0		
40	信託銀行	0	0	0	0	0	0		
50	農林系金融機関	0	0	0	0	0	0		
60	第二地銀協加盟行	0	0	0	0	0	0		
70	信用金庫	0	0	0	0	0	0		
80	その他金融機関	0	0	0	0	0	0		
90	生保・損保	0	0	0	0	0	0		
100	投資信託	0	0	0	0	0	0		
110	官公庁共済組合	0	0	0	0	0	0		
120	事業法人	0	0	0	0	0	0		
130	その他法人	0	0	0	0	0	0		
140	外国人	0	0	0	0	0	0		
150	その他	0	0	0	0	0	0		
160	他の債券ディーラー	0	0	0	0	0	0		
999	合計	0	0	0	0	0	0		

※ 「銘柄後決め取引」欄には、債券の条件付売買取引において銘柄割当機関が銘柄割当機関規則等に基づき設定した債券等の種類の条件付売買残高を計上すること。

公社債条件付売買残高報告書[記載上の留意事項]

〔報告に関する留意事項〕

1. 自社の本店、支店その他の営業所において取り扱った公社債の条件付売買の全部について本用紙に記載し、毎月10日（当日が休日の場合は前営業日）までに本協会公社債・金融商品部市場統計業務室へ報告すること。
2. 売買残高は、当初個別契約で定められた受渡日を基準に記載すること。
3. 外貨建債券は除くこと。
4. 数量は、額面金額により100万円単位（単位未満は四捨五入）で記載すること。ただし、銘柄後決め取引は約定金額（スタート売買金額のグロス額）により100万円単位（単位未満は四捨五入）で記載すること。
5. 相手方別残高の「他の債券ディーラー」欄には、証券会社の売買分及び金融機関ディーラーの商品有価証券勘定の売買分を記載すること。
6. 相手方別の内訳は「投資家区分表」によること。

〔協会員コード等の入力に関する留意事項〕

1. 「区分」：半角英数2桁で入力すること。
（区分番号については、「報告協会員コード一覧表」を参照のこと。）
2. 「協会員コード」：半角英数5桁で入力すること。
（協会員コードについては、「報告協会員コード一覧表」を参照のこと。）
3. 「年」：報告対象年（西暦）を半角英数4桁で入力すること。
4. 「月」：報告対象月を半角英数で入力すること。