

社債の取引情報の報告及び公表について（案）【事務局タタキ台】

平成 23 年 11 月 30 日

社債の価格情報の透明性を高め信頼性を確保するため、米国・EU・韓国等の取組を参考に、次のとおり、社債の取引情報の報告を求め、公表することとしてはどうか。

1. 社債の取引情報の報告

日本証券業協会（以下「日証協」という。）は、証券会社に対し、次により社債の取引情報の報告を求める。

(1) 報告対象銘柄

証券保管振替機構（以下「ほふり」という。）の決済照合システムにより約定照合が行われた銘柄

(2) 報告内容

銘柄名（ISIN 銘柄コード）、約定年月日、決済年月日、約定単価及び取引数量（額面金額ベース）、対顧客取引・業者間取引の別、課税玉・非課税玉の別

(3) 報告日・報告方法

① 証券会社は、当日午後 3 時までに決済照合システムにより約定照合を行った社債の取引について、同午後 4 時までに日証協に報告を行う。

② 上記①の報告は、ほふりから日証協への報告により行う。

(4) 実施の時期

ほふりから日証協への報告システムの整備次第、実施する。

・ 日証協は、社債の取引情報の公表事務、社債の取引状況の分析、公社債店頭売買参考統計値の信頼性向上等に活用する。

2. 社債の取引情報の公表

日証協は、証券会社から上記1の報告があった社債の取引情報について、次により公表を行う。

項 目	A案	B案
(1)公表対象銘柄	証券会社から上記1の報告があった全銘柄	証券会社から上記1の報告があった社債の取引情報のうち、当面、流動性が高いと考えられる次の銘柄とする。 ① 発行総額500億円以上の銘柄 ② 一以上の格付機関からA以上の格付を取得している銘柄
(2)公表内容	約定年月日、銘柄コード、銘柄名、償還期日、表面利率、取引数量（額面金額ベース）及び約定単価	同左
(3)公表方法及び公表日	① 取引数量（額面金額ベース）10億円以上、5億円以上10億円未満、1億円以上5億円未満、1億円未満の4つに区分し、当該区分ごとに公表する。 ② 取引日の当日午後〇時に、本協会ホームページに掲載すること等により公表する。	① 取引数量（額面金額ベース）5億円以上、5億円未満の2つに区分し、当該区分ごとに公表する。 （注） 公社債店頭売買参考統計値は、額面5億円程度の売買の参考となる気配を発表 ② 取引日の翌日に、公社債店頭売買参考統計値と併せて、本協会ホームページに掲載すること等により公表する。

(4)実施の時期	日証協は、社債の取引情報の報告システムと合わせて公表システムの整備を行い実施する。なお、上記1の社債の取引情報の分析の結果、必要に応じ公表方法等を調整する。	同左
----------	--	----

以 上