

## 「社債の取引情報の発表に関する取扱いについて」の一部改正について

平成 30 年 2 月 15 日

（ 下 線 部 分 変 更 ）

新	旧
<p><b>3. 発表事項</b> 社債の取引情報の発表事項は、次に掲げるものとする。</p> <p>①～⑦ ( 現行どおり )</p> <p>⑧ <u>売買の別</u></p> <p>⑨ <u>売買参考統計値</u> ( 現行どおり ) ( 平均値 )</p> <p><b>8. 発表停止の取扱い</b> <b>(1) 発表停止措置</b> ( 現行どおり )</p> <p><b>(2) 発表停止基準</b> 「当該社債の連続する 2 営業日の売買参考統計値の差額」と「参照国債の当該 2 営業日の売買参考統計値の差額」の差額が一定以上となった社債を発表停止の対象とする。</p> <p>(注 1) 「<u>売買参考統計値</u>」は複利利回りの平均値 (ただし、複利利回りを算出する際に用いる単価は小数点第 3 位までの数値 (小数点第 4 位以下を切り捨てた数値) とする。) とする。 以下同じ。</p> <p>(注 2) ( 現行どおり )</p> <p>(注 3) ( 現行どおり )</p>	<p><b>3. 発表事項</b> ( 同 左 )</p> <p>①～⑦ ( 省 略 )</p> <p>( 新 設 )</p> <p>⑧ <u>売買参考統計値</u> ( 省 略 ) ( 平均値 )</p> <p><b>8. 発表停止の取扱い</b> <b>(1) 発表停止措置</b> ( 省 略 )</p> <p><b>(2) 発表停止基準</b> ( 同 左 )</p> <p>(注 1) 「<u>売買参考統計値</u>」は複利利回りの平均値とする。以下同じ。</p> <p>(注 2) ( 省 略 )</p> <p>(注 3) ( 省 略 )</p>

【別紙1】の一部改正

【 新 】

社債の取引情報の発表形式

(下線部分変更)

社債の取引情報								
○ 20XX年11月8日発表分								
約定年月日: 20XX年11月6日								
銘柄コード	銘柄名	償還日	利率	売買の別 注1	取引数量(額面金額ベース)5億円以上	取引数量(額面金額ベース)5億円未満	約定単価(円)	【参考】売買参考統計値(平均値) 注2
09044XXXX	〇〇〇道路44	20XX/12/20	1.XXX	売り		✓	103.983	104.1
00088XXXX	〇〇旅客鉄道 88	20XX/04/13	0.XXX	買い		✓	99.978	99.96
00430XXXX	〇〇電力 430	20XX/02/23	1.XX	買い	✓		105.041	104.86
				売り		✓	104.813	
注1 売買の別は、当該取引の報告を行った会員の取引相手方からみた「売り」又は「買い」である。								
注2 売買参考統計値(平均値)は、本協会が指定する協会員から、当日の午後3時現在における額面5億円程度の売買の参考となる気配として報告を受けた気配値(売り気配と買い気配の仲値)の平均値である。								
約定年月日: 20XX年11月7日								
銘柄コード	銘柄名	償還日	利率	売買の別 注1	取引数量(額面金額ベース)5億円以上	取引数量(額面金額ベース)5億円未満	約定単価(円)	【参考】売買参考統計値(平均値) 注2
09044XXXX	〇〇〇道路44	20XX/12/20	1.XXX	売り		✓	103.774	103.9
00024XXXX	〇〇ハウス 24	20XX/07/20	0.XX	買い		✓	99.83	99.37
00015XXXX	〇〇グループHD 15	20XX/06/13	0.XXX	売り	✓		100.139	100.14
00008XXXX	〇〇銀行劣 8	20XX/02/23	1.XXX	買い		✓	100.442	100.43
				売り		✓	100.428	
				買い		✓	100.428	
00002XXXX	〇〇〇〇日本劣 2	20XX/08/08	*	買い		✓	99.572	99.56
				売り		✓	99.44	
注1 売買の別は、当該取引の報告を行った会員の取引相手方からみた「売り」又は「買い」である。								
注2 売買参考統計値(平均値)は、本協会が指定する協会員から、当日の午後3時現在における額面5億円程度の売買の参考となる気配として報告を受けた気配値(売り気配と買い気配の仲値)の平均値である。								

(注1) 同一銘柄の取引については、約定単価の高いものから上に表示する。

(注2) 同一価格で複数の取引がある場合、行数を分けて表示する。

(注3) 例えば、約定日 20XX年11月7日における売買参考統計値は 20XX年11月7日の値(売買参考統計値の発表日付は 20XX年11月8日)を表示する。

【 旧 】

社債の取引情報の発表形式 (イメージ)

○20XX年10月3日発表分

約定年月日：20XX年10月1日

銘柄コード	銘柄名	償還期日	利率	取引数量 (額面金額ベース)	約定単価 (円)	【参考】 売買参考統計値 (平均値) *
987654321	A社 第〇回債	20XX年 XX月XX 日	1. XXX%	5億円以上	99.65	99.63
				5億円未満	99.75	

\*売買参考統計値(平均値)は、本協会が指定する協会員から、当日の午後3時現在における額面5億円程度の売買の参考となる気配として報告を受けた気配値(売り気配と買い気配の仲値)の平均値である。

約定年月日：20XX年10月2日

銘柄コード	銘柄名	償還期日	利率	取引数量 (額面金額ベース)	約定単価 (円)	【参考】 売買参考統計値 (平均値) *
123456789	B社 第〇回債	20XX年 XX月XX 日	2. XXX%	5億円以上	99.33	99.40
					99.28	
				5億円未満	99.48	
					99.48	

\*売買参考統計値(平均値)は、本協会が指定する協会員から、当日の午後3時現在における額面5億円程度の売買の参考となる気配として報告を受けた気配値(売り気配と買い気配の仲値)の平均値である。

(注1) 同一銘柄の取引については、約定単価の高いものから上に表示する。

(注2) 同一価格で複数の取引がある場合、行数を分けて表示する。

(注3) 例えば、約定日20XX年10月2日における売買参考統計値は20XX年10月2日の値(売買参考統計値の発表日付は20XX年10月3日)を表示する。

## 付 則

この改正は、平成30年10月1日から施行し、同日付けの約定分に係る発表から適用する。