

「債券等の条件付売買取引の取扱いについて」(理事会決議)等の一部改正について

平成 17 年 3 月 29 日

日本証券業協会

1. 改正の趣旨

現在、協会員が店頭において行う債券等の条件付売買取引、選択権付債券売買取引、債券等の着地取引及び債券貸借取引(以下「債券等の条件付売買取引等」という。)については、あらかじめ基本契約書を締結のうえ、個別取引約定成立の都度、個別取引明細書の交付(選択権付債券売買取引、債券等の着地取引及び債券貸借取引においては個別取引契約書の取り交わし又は個別取引明細書の交付(以下「個別取引明細書の交付等」という。))が必要とされている。

しかしながら、近年の有価証券市場の決済改革の進展に伴い、約定照合機能を有したシステムの高度化や法令による一定要件下での取引報告書の交付省略など、取引処理における業務の効率化を進める環境整備がなされてきている状況を踏まえ、今般、債券等の条件付売買取引等において、取引報告書の交付省略要件(証券会社に関する内閣府令第30条第2項第5号)と同等の要件を充足する場合に限り、個別取引明細書の交付等の省略を可能とするため、次に掲げる理事会決議を改正することとする。

2. 改正の骨子

(1)「債券等の条件付売買取引の取扱いについて」(理事会決議)の一部改正(注)

顧客が適格機関投資家等であって、書面等により当該顧客とあらかじめ個別取引明細書の交付を要しないことを合意し、かつ、当該顧客からの個別取引に関する照会に対して速やかに回答できる体制が整備されている場合は、個別取引明細書の交付を省略することとする。(「3 現先取引契約の締結等」の(3))

の適用を受ける場合、協会員は本来個別取引明細書に記載されるべき事項について、顧客との間で別途合意する方法により、確認を行うこととする。(「3 現先取引契約の締結等」の(6))

(2)「選択権付債券売買取引の取扱いについて」(理事会決議)の一部改正(注)

取引相手方が適格機関投資家等であって、書面等により当該取引相手方とあらかじめ個別取引明細書の交付等を要しないことを合意し、かつ、当該取引相手方からの個別取引に関する照会に対して速やかに回答できる体制が整備されている場合は、個別取引明細書の交付等を省略することとする。(「5 売買契約の締結」の(3))

の適用を受ける場合、協会員は本来個別取引明細書等に記載されるべき事項について、取引相手方との間で別途合意する方法により、確認を行うこととする。(「5 売買契約の締結」の(5))

(3) 「債券等の着地取引の取扱いについて」(理事会決議)の一部改正(注)

顧客が適格機関投資家等であって、書面等により当該顧客からあらかじめ個別取引明細書の交付等を要しないことを合意し、かつ、当該顧客からの個別取引に関する照会に対して速やかに回答できる体制が整備されている場合は、個別取引明細書の交付等を省略できることとする。(「2 売買契約の締結」の(3))

の適用を受ける場合、協会員は本来個別取引明細書等に記載すべき事項について、顧客との間で別途合意する方法により、確認を行うこととする。(「2 売買契約の締結」の(6))

(注) 特別会員は取引報告書の交付省略が制度上適用とならないため、改正後の理事会決議に基づき、債券等の条件付売買取引、選択権付債券売買取引及び債券等の着地取引における個別取引契約書又は個別取引明細書の交付省略を行う場合は、別途取引報告書の作成・交付が必要となることに留意する。

(4) 「債券の空売り及び貸借取引の取扱いについて」(理事会決議)の一部改正

取引相手方が適格機関投資家等であって、書面等により当該取引相手方とあらかじめ個別取引明細書の交付等を要しないことを合意し、かつ、当該取引相手方からの個別取引に関する照会に対して速やかに回答できる体制が整備されている場合は、個別取引明細書の交付等を省略できることとする。(「5 債券貸借取引契約の締結」の(3))

の適用を受ける場合、協会員は本来個別取引明細書等に記載されるべき事項について、取引相手方との間で別途合意する方法により、確認を行うこととする。(「5 債券貸借取引契約の締結」の(6))

3. 施行時期

この改正は、平成 17 年 4 月 1 日から施行する。

以 上

「債券等の条件付売買取引の取扱いについて」（理事会決議）の一部改正について

平成 17 年 3 月 29 日

（下線部分変更）

| 新 | 旧 |
|--|---|
| 1・2 (現行どおり) | 1・2 (省 略) |
| 3 現先取引契約の締結等 (1) (現行どおり) (2) (現行どおり) <u>(3) 前記 (2) にかかわらず、次の各号に掲げる要件をすべて満たす場合には、協会員は、個別取引明細書の交付を要しない。</u> <u>① 顧客が証券取引法第 2 条第 3 項第 1 号に規定する適格機関投資家又はそれに相当する外国法人等であること</u> <u>② 書面又は情報通信を利用する方法により顧客とあらかじめ個別取引明細書の交付を要しないことを合意していること</u> <u>③ 顧客からの個別現先取引の内容に関する照会に対して速やかに回答できる体制が整備されていること</u> (4) (現行どおり) (5) (現行どおり) <u>(6) 前記 (3) に基づき、個別取引明細書の交付を省略する場合には、協会員は、顧客との間で前記 (5) 各号に掲げる事項を顧客との間で合意する方法により確認するものとする。ただし、個別現先取引において該当しない項目についてはこの限りでない。</u> | 3 現先取引契約の締結等 (1) (省 略) (2) (省 略) <u>(新 設)</u> (3) (省 略) (4) (省 略) <u>(新 設)</u> |
| 4 ? (現行どおり) | 4 ? (省 略) |
| 15 | 15 |
| 付 則 | |
| この改正は、平成 17 年 4 月 1 日から施行する。 | |

（注）今後、この「理事会決議」は、自主規制会議規則第 12 条に基づき、「自主規制会議決議」として取り扱われることとなります。

| 新 | 旧 |
|---|---|
| <p>(3) (現行どおり)</p> <p>11・12 (現行どおり)</p> <p>13 選択権の消滅 選択権付債券売買取引において、<u>取引約定成立時</u>に定める行使期間の最終日における一定の時刻までに選択権の行使が行われなかった場合には、当該選択権付債券売買取引の契約は解除されるものとする。</p> <p>14 29 付 則</p> <p>この改正は、平成17年4月1日から施行する。</p> | <p>取引相手方との間で事前に確認し、「個別取引契約書」又は「個別取引明細書」にあらかじめ明記するものとする。</p> <p>(4) (省 略)</p> <p>11・12 (省 略)</p> <p>13 選択権の消滅 選択権付債券売買取引において、<u>あらかじめ「個別取引契約書」又は「個別取引明細書」</u>に定める行使期間の最終日における一定の時刻までに選択権の行使が行われなかった場合には、当該選択権付債券売買取引の契約は解除されるものとする。</p> <p>14 29 (省 略)</p> |

(注) 今後、この「理事会決議」は、自主規制会議規則第12条に基づき、「自主規制会議決議」として取り扱われることとなります。

「債券等の着地取引の取扱いについて」（理事会決議）の一部改正について

平成 17 年 3 月 29 日
(下線部分変更)

| 新 | 旧 |
|--|------------------|
| 1 (現行どおり) | 1 (省 略) |
| 2 売買契約の締結 | 2 売買契約の締結 |
| (1) (現行どおり) | (1) (省 略) |
| (2) (現行どおり) | (2) (省 略) |
| (3) <u>前記 (1) 及び (2) にかかわらず、次の各号に定める要件をすべて満たす場合には、協会員は、「個別取引契約書」の取り交わし又は「個別取引明細書」の交付を要しない。</u> | <u>(新 設)</u> |
| ① <u>顧客が証券取引法第 2 条第 3 項第 1 号に規定する適格機関投資家又はこれに相当する外国法人等であること</u> | |
| ② <u>書面又は情報通信を利用する方法により顧客とあらかじめ「個別取引契約書」の取り交わし又は「個別取引明細書」の交付を要しないことを合意していること</u> | |
| ③ <u>顧客からの着地取引の内容に関する照会に対して速やかに回答できる体制が整備されていること</u> | |
| (4) (現行どおり) | (3) (省 略) |
| (5) (現行どおり) | (4) (省 略) |
| (6) <u>前記 (3) に基づき、個別取引契約書の取り交わし又は個別取引明細書の交付を省略する場合には、協会員は、顧客との間で前記 (4) 各号に掲げる事項を顧客との間で合意する方法により確認するものとする。</u> | <u>(新 設)</u> |
| (7) (現行どおり) | (5) (省 略) |
| 3 | 3 |
| 2 (現行どおり) | 2 (省 略) |
| 10 | 10 |
| 付 則 | |
| この改正は、平成 17 年 4 月 1 日から施行する。 | |

(注) 今後、この「理事会決議」は、自主規制会議規則第 12 条に基づき、「自主規制会議決議」として取り扱われることとなります。

「債券の空売り及び貸借取引の取扱いについて」（理事会決議）の一部改正について

平成 17 年 3 月 29 日

（下線部分変更）

| 新 | 旧 |
|--|----------------------|
| 1 | 1 |
| 2 (現行どおり) | 2 (省 略) |
| 3 | 3 |
| 4 債券貸借取引契約の締結 | 4 債券貸借取引契約の締結 |
| (1) (現行どおり) | (1) (省 略) |
| (2) (現行どおり) | (2) (省 略) |
| (3) <u>前記 (2) にかかわらず、次の各号に掲げる要件をすべて満たす場合には、協会員は、「個別取引契約書」の取り交わし又は「個別取引明細書」の交付を要しない。</u> | <u>(新 設)</u> |
| ① <u>取引相手方が証券取引法第 2 条第 3 項第 1 号に規定する適格機関投資家又はこれに相当する外国法人等であること</u> | |
| ② <u>書面又は情報通信を利用する方法により取引相手方とあらかじめ「個別取引契約書」の取り交わし又は「個別取引明細書」の交付を要しないことを合意していること</u> | |
| ③ <u>取引相手方からの個別貸借取引の内容に関する照会に対して速やかに回答できる体制が整備されていること</u> | |
| (4) (現行どおり) | (3) (省 略) |
| (5) (現行どおり) | (4) (省 略) |
| (6) <u>前記 (3) に基づき、「個別取引契約書」の取り交わし又は「個別取引明細書」の交付を省略する場合には、協会員は、取引相手方との間で前記 (5) 各号に掲げる事項を取引相手方との間で合意する方法により確認するものとする。</u> | <u>(新 設)</u> |
| 5 | 5 |
| 6 (現行どおり) | 6 (省 略) |
| 15 | 15 |
| 付 則 | |
| この改正は、平成 17 年 4 月 1 日から施行する。 | |

(注) 今後、この「理事会決議」は、自主規制会議規則第 12 条に基づき、「自主規制会議決議」として取り扱われることとなります。