

金融・資本市場に関する統計情報の役割

金融・資本市場に関する統計情報は、市場の実態を正確かつ迅速に把握・分析するための必要不可欠なツール。投資環境の整備、市場の信頼性の維持・向上等に資する基礎的かつ重要なインフラの一つとして、継続的な整備・充実が必要。

統計整備の基本的な考え方

- ①統計の整備・充実
- ②金融・資本市場の環境変化への対応
- ③統計利用の利便性向上
- ④統計作成の合理化・効率化

統計を巡る問題点

- ①金融・資本市場に関する統計の体系的整備が不十分
- ②長期時系列データが未整備
- ③新たな金融商品等に関するデータが不十分
- ④統計の一元的・横断的な利用環境が未整備
- ⑤統計の提供方法等が利用者ニーズがミスマッチ
- ⑥統計データの高度な利用への対応が不十分
- ⑦統計報告者の人的及び費用負担

具体的取組状況

【横断的取組】

- ①「証券統計ポータルサイト*」（以下、「ポータルサイト」）の機能強化推進

統計データを拡充、新着情報を提供、検索機能を強化

- ②「金融・資本市場統計データ一覧」の作成

金融・資本市場に関する統計の所在情報とその概要を掲載

- ③統計データの標準化

データのファイル形式、年号表記等について、統一的な仕様を策定

- ④利用者ニーズの把握

【各証券関係機関における取組】

統計のスクラップ・アンド・ビルドの推進

今後の取組～統計利用に係るワンストップサービスの推進～

「ポータルサイト」内の「金融・資本市場統計データ一覧」からリンク設定された、各証券関係機関の主要統計情報について、統一的な仕様に準拠し統計整備を推進（平成24年上期を目途）。

中長期的課題～統計データの高度な利用環境の整備～

- ①XBRL及びSDMX技術の活用
- ②「グラフ化機能」、「詳細分析機能」、「コメント付与機能」といったより高度な機能の検討

*1証券関係機関等が公表する諸統計をインターネット上で一元的に利用できるよう、日本証券経済研究所が開設しているリンク集。

*2財務報告用の情報及び統計データ等のために、標準化されたコンピューター言語である。

金融・資本市場統計の整備に向けて (金融・資本市場統計整備懇談会報告書)

平成23年6月8日
日本証券業協会
金融・資本市場統計整備懇談会

1. はじめに

投資環境の整備の一環として、金融・資本市場に関する統計情報が多様な利用者に広く有効活用されるよう、統計情報の整備・充実が求められている。

こうした統計情報の整備のためには、金融・資本市場の変化や利用者ニーズを的確に把握するとともに、統計の作成・公表主体である証券関係機関をはじめ、関係者による横断的な検討が必要であるとの認識のもと、平成21年6月、日本証券業協会の協会員並びに証券関係機関等の協力・参画を得て、「金融・資本市場統計整備懇談会」（以下、「本懇談会」という）が発足し、以後、金融・資本市場統計の整備のあり方に係る幅広い検討を開始した。

その後、同年12月に本懇談会の下部機関として「金融・資本市場統計整備懇談会ワーキング・グループ」（以下「ワーキング・グループ」という）を設置し、より実務的・専門的な観点から検討を進めた結果、平成22年6月、ワーキング・グループにおいて、統計整備の基本的な考え方（後記2. 参照）を整理の上、その時点における問題点（後記3. 参照）、検討の方向性及び今後取り組むべき課題等を中間的に取りまとめた（「金融・資本市場統計の整備に向けた具体的な課題・取組について（金融・資本市場統計整備懇談会ワーキング・グループ中間整理）」*、以下「中間整理」という）。

本懇談会では、その後、ワーキング・グループを中心として、中間整理において掲げられた統計整備に向けて取り組むべき課題について、その実現や具体化等に向けた検討及び情報の共有を重ねてきたところであるが、今般、以下のとおり、検討結果を取りまとめた。

* 「金融・資本市場統計の整備に向けた具体的な課題・取組について（金融・資本市場統計整備懇談会ワーキング・グループ中間整理）」 http://www.jsda.or.jp/html/houkokusyo/pdf/toukeiseibi_100615.pdf 参照。

2. 統計整備の基本的な考え方

金融・資本市場に関する各種統計は、投資環境の整備、市場の信頼性の維持・向上等に資する重要なインフラの一つである。金融・資本市場を取り巻く環境が大きく変化する中で、市場の実態を正確かつ迅速に把握・分析し得る統計について、一層の整備・充実に努めることが求められている。

証券関係機関では、それぞれの業務の目的に応じて統計情報を作成・公表しているが、多様な利用者に広く有効活用されるよう、各機関の連携・協力のもと、各種統計を一元的、横断的に利用できる環境を整備していく必要がある。また、統計整備に当たっては、報告者負担の軽減に配慮することはもとより、現下の厳しい経済環境等を踏まえ、費用対効果や各機関の実情等を勘案しながら、効率的かつ効果的に整備を進めていくことが重要である。

上記のような認識のもと、金融・資本市場の変化や利用者ニーズに的確に対応し、有用で信頼性の高い統計を提供するため、証券関係機関は相互協力を図りつつ、統計整備に向けた取組を自主的かつ積極的に推進することとする。

3. 統計を巡る問題点

金融・資本市場に関する統計の現状等を巡って、以下のような問題点が指摘された。

(1) 統計の整備・充実

① 統計の体系的整備が不十分

イ. 証券関係機関が作成・公表している統計についての情報が体系的に整理されていないため、統計データの所在が不明確で、必要な情報の有無や内容等が分からない。

ロ. 証券関係機関が公表している統計は、機関を跨って利用されることを想定して作成されていないため、統計データの相互比較や結合・加工が容易ではなく、我が国市場の全体像を正確に捉えることができる統計が整備されていない*。

* 例えば、全国上場会社数・時価総額、株式売買高・売買代金等は、各証券取引所、日本証券業協会（取引所外取引）においてそれぞれの基準で作成・公表されているため、これらを集計した全国ベースのデータをタイムリーに把握することが難しい。

② 時系列データの未整備

- イ. 証券関係機関が公表している統計の中には、電子データ化に要する費用等の問題から、長期時系列データの整備が進んでいない統計もあり、全般的にデータの収録期間が短く、提供されている統計の範囲も狭い。また、過去のデータは紙媒体からしか入手できないケースも少なくない。
- ロ. 各種統計の時系列データについて、データの始期、データの収録期間が不明確なため、遡及して利用することが可能な期間や電子データにより提供されている期間が分からない。

③ 金融・資本市場の環境変化に対する対応の遅れ

- イ. 証券化商品、店頭デリバティブ等の新たな金融商品について、統計データを入手することが困難である。
- ロ. 証券関係機関において、統計の作成・公表を前提として収集したデータでないために、金融・資本市場への理解促進の観点から意義があると考えられる統計情報が十分に整備されていない。

(2) 統計利用の利便性向上

① 統計の一元的、横断的な利用環境の未整備

- イ. 現状では、体系的に整理された統計をワンストップで利用できる環境が十分に整備されていないため、金融・資本市場統計を一元的に利用できるのは、情報ベンダーが提供する高額なサービスを利用できる者に限られている。
- ロ. 金融・資本市場に関する各種の統計関係情報を一元的に利用できるサイトとして、「証券統計ポータルサイト」（以下「ポータルサイト」という。）*があるが、同サイトのリンク先は証券関係機関が無償で公表している統計データが中心であるため、伝統的な有価証券以外の金融商品に関する統計や海外の証券市場統計が少なく、また、取引所等が提供する有料情報は対象となっていない。

* 証券統計ポータルサイト(<http://www.shouken-toukei.jp/>)は、証券関係機関等が公表する諸統計をインターネット上で一元的に閲覧・利用できるようにするため、2007年4月より公益財団法人日本証券経済研究所が開設している証券統計のリンク集で、「証券関係諸団体統計ページへのリンク」、「ジャンル別統計データ」、「検索（証券統計フリーワード検索、EDINET、株式上場銘柄等検索等）」、「統計（図表）で見る日本の証券市場」等のコンテンツで構成されている。

ハ．ポータルサイトから統計データへのリンクは、同サイトのメンテナンスの関係から、証券関係機関がウェブサイトで公表している統計データへのダイレクトリンクではなく、当該統計データの上位階層（ウェブサイトのトップページや統計関係のメニューページ等）にリンクしているものが多いため、利用者は目的の統計にたどり着くまでに手間がかかる。

② 統計の提供方法等が不十分

イ．証券関係機関が公表している統計には、HTML 形式や PDF 形式のファイルもあるが、このようなファイル形式は利用者が表計算ソフト等で自らの利用目的に適した処理を行うことが難しい。

ロ．証券関係機関が公表している統計の中には、英語表記や西暦表示がなく、日本語・和暦のみで提供されている統計があり、統計利用者の利便性が損なわれている。また、統計データの定義や解説が必ずしも十分ではない統計がある。

③ 統計データの高度な利用への対応が不十分

イ．長期時系列データなど大容量のデータについては、インターネットを通じた提供のみではダウンロードに時間がかかるなど利用者にとって不便な点が存在するにもかかわらず、インターネット以外の外部記憶媒体（CD-ROM、DVD-ROM 等）による提供が不十分である。

ロ．我が国における金融・資本市場に関する学術・実証研究の発展に資するため、専門的な分析に必要な統計データの整備を図るとともに、XBRL*技術の活用等による利用環境の整備に向けた検討が行われていない。

(3) 統計作成の合理化・効率化

① 報告者の負担

イ．精度の高い統計データを作成するためには、報告者の立場に十分配慮し、データ提供に係る負担を必要最小限のものにすることが重要であるが、報告者負担及び統計作成コスト等の軽減が考慮されていない。

ロ．証券関係機関がボランティアベースでデータを収集し、統計を作成している

* XBRL：eXtensible Business Reporting Language の略。詳細は別紙参照。

場合には、データ提供者に対して負担に見合う有益な統計を作成し提供するなどのデータ提供者の理解と協力を深める工夫が十分に行われていない。

② 外部機関との連携不足

統計の速報性及び予算上の制約と統計の精度とはトレードオフの関係にある。これを補完するための、情報ベンダー等の外部機関への業務委託、連携による相互補完等の取組が一部にとどまっている。

(4) その他

統計利用者の声を吸い上げることは、ニーズの把握だけでなく統計の精度向上の面でも非常に重要である。統計に対する照会や要望など利用者の声を統計の整備等に活かす仕組みが十分に構築されていない。

4. 金融・資本市場統計整備の進捗状況

中間整理においては、現状の問題点（前記3. 参照）を踏まえ、統計整備に向けて取り組むべき課題等*が整理されたところであるが、ワーキング・グループ等における検討・情報共有に基づき、平成22年度下期以降、各証券関係機関においては、既に、以下のような取り組みがなされているところである。

(1) 横断的な取組

① 統計データの標準化

金融・資本市場に関する統計データについては、複数の機関が公表する統計の横断的利用が想定されることから、例えばデータのファイル形式や年号表記といった統計データ提供時に標準化しておくことが望ましいと思われる項目について、統一的な仕様を策定した（後記5. 参照）。

② 統計データ一覧の作成

金融・資本市場に関する統計の所在情報とその概要等について、利用者が一元的に把握できるようにするため、日本証券経済研究所が中心となって、主要な証

* (1) 横断的な取組（統計データ一覧の作成、ポータルサイト等の機能強化等、利用者ニーズの把握）
(2) 証券関係機関における取組（時系列データの整備、統計データの提供方法の改善、金融・資本市場の環境変化への対応等、統計作成の合理化・効率化）

券関係機関やその他の関係機関が作成・公表している金融・資本市場統計を網羅した「金融・資本市場統計データ一覧」*（統計の名称・概要、作成・公表機関、公表時期・頻度等）を作成し、平成23年4月1日よりポータルサイト内での掲載を開始した。

③ ポータルサイトの機能強化等

統計利用の利便性を一層向上させるため、日本証券経済研究所は証券関係機関の相互協力のもと、ポータルサイトの機能強化等に向けて以下の方策に取り組んでいるところである。

イ. 統計データの拡充

ポータルサイトで閲覧・利用できる統計データの充実を図るため、金融先物取引業協会等の国内機関、主要国における金融監督当局等の海外機関のウェブサイトへのリンクを追加した（下記参照）（平成23年4月1日現在計133機関）。

国内機関	金融先物取引	金融先物取引業協会
	各種ファンド	不動産証券化協会
海外機関	金融監督当局	FRB（米国連邦制度準備理事会）、SEC（米国証券取引委員会）、CFTC（米国商品先物取引委員会）、ESMA（欧州証券監督機関）、FSA（英国金融サービス機構）等
	機関・取引所	FINRA（米国金融取引業規制機構）、SIFMA（米国証券業金融市場協会）、ICMA（国際資本市場協会）、ISDA（国際スワップデリバティブ協会）、欧州・アジア主要国の証券取引所、中央銀行等

ロ. 新着情報等の提供及び検索機能の強化

ポータルサイトの利便性向上・利用促進の観点から、新たな機能として、証券関係機関において①新たな統計データの作成・公表、②既存の統計データの廃止、③定期的な更新を除いた既存の情報内容の変更（名称、公表時期、頻度等）があった場合、これらの情報を「新着情報」としてポータルサイトで周知することとし、平成23年4月1日より、順次提供を開始した。

* 「金融・資本市場統計データ一覧」 <http://www.shouken-toukei.jp/commentary/index.html> 参照。

また、利用者ニーズが高いと思われる「検索機能」については、既存の「証券統計フリーワード検索機能」を強化することとし、過去の利用者の利用状況等から検索用キーワードとして有効と考えられる用語の追加等、検索用の単語データファイルを更新するなどの改善を図り、検索機能を大幅に拡充した。

ハ．ポータルサイトの周知

統計利用者へのポータルサイトの認知度向上*を図るため、証券関係機関においては、各機関のウェブサイト上にポータルサイトへのリンクを設定するとともに、各機関の会員や取引参加者等に対して、各社のウェブサイトからポータルサイトへのリンクを設定することについて協力を要請した。

また、ポータルサイトの利用を促進するためには、単に同サイトの存在を周知するだけでなく、サイトの機能や閲覧・利用できる統計の内容、統計データの活用事例等を紹介することがより効果的であることから、日本証券経済研究所においては、ポータルサイトの機能等を学界、研究者をはじめ広く一般に周知するため、パンフレット等の作成、各機関が提供しているメールマガジン等の配信サービスの活用等を検討中である。

④ 利用者ニーズの把握

イ．統計整備を推進するためには、統計利用者の意見・要望等を把握することが重要である。そこで、日本証券業協会では、統計情報の利用実態と新たな統計作成に対するニーズ等を把握するため、平成23年3月、他の機関と連携しつつ、広く一般を対象としたウェブアンケートを実施した。

また併せて、金融・資本市場統計の利用頻度が高いと思われる金融機関関係者、学術関係者等については、個別のヒアリングを行い、より具体的なニーズを調査した。

ロ．統計に対する照会や利用者の声を統計整備に活用するため、日本証券経済研究所は、ポータルサイトの「お問い合わせ」に寄せられた各種統計に対する質問・意見等を整理し、各機関に対し必要に応じてフィードバックを行っている。

* ポータルサイトの1日当たりの利用件数は300件程度である（平成21年10月現在）。また、日本証券業協会が会員等を対象に平成21年4月に実施したアンケートでは、ポータルサイトについて「利用したことがある」（8.1%）、「利用したことはないが、このリンク集のことは知っている」（19.2%）と、認知度は3割弱であった。

(2) 証券関係機関における取組

金融・資本市場統計の整備に当たっては、業界横断的な取組とともに、統計を公表している証券関係機関における自主的かつ積極的な対応が必要不可欠である。

各証券関係機関においては、ワーキング・グループにおける検討・情報共有等に基づき、各機関独自の取組として、以下の施策を推進している。

日本証券業協会	・データフォーマットの Excel 化。 ・主要統計の長期時系列データの整備。 ・統計解説資料のウェブサイト上での公表。 ・英語版サイトの統計データ整備。 ・ウェブサイト内の統計情報ページのリニューアル（平成 23 年 7 月目途）。 ・既存統計のスクラップ＆ビルドを検討中。
投資信託協会	・ウェブサイト内の統計情報ページをリニューアル（平成 23 年 12 月目途）。リニューアルに際し、次の見直しを検討中。 (1) 月刊誌に掲載されている統計情報をウェブサイトへの掲載に切り替え。 (2) ウェブサイトに掲載されている統計情報の Excel 化。 (3) 長期時系列データの拡充。
日本証券投資顧問業協会	・統計・開示資料の改訂を実施（平成 23 年 3 月末データ分より）。 (1) 会員の業態に即した報告様式の策定。 (2) 情勢に応じた統計情報の集計項目の追加。 ・データフォーマットの Excel 化（平成 23 年 3 月末データ開示時より）。 ・西暦・和暦の併記（平成 23 年 3 月末データ開示時より）。
東京証券取引所	・長期時系列データの整備。 ・英語版ウェブサイトの整備。 ・日本語の用語解説等の充実。

大阪証券取引所	・ジャスダック市場及びデリバティブ取引等の統計情報を拡充し、新しく構築したウェブサイト上で公表開始（平成 22 年 10 月より）。
証券保管振替機構	・公表データの一部拡充を実施（平成 23 年 4 月分データより）。 ・平成 26 年のシステム・リプレイスに合わせ、公表データの大幅拡充（株価情報や株主属性別情報などの開示）を実施予定。
金融先物取引業協会	・データフォーマットの Excel 化、紙媒体の電子化を検討中。
日本証券経済研究所	・年次で公表中の『株式投資収益率』について、月次データを整備中。

（平成 23 年 4 月現在）

5. 具体的な取組～統計利用に係る総合的なワンストップサービスの推進～

本懇談会では、金融・資本市場に関する統計情報が多様な利用者に広く活用されるよう、証券関係機関が提供する各種の統計情報を利用者が一元的に利用できる「ワンストップサービス」の提供方法について検討を行った。

ワンストップサービスの提供方法としては、

- ① 金融・資本市場統計データベース（証券関係機関の公表している統計データを網羅的に収録し、検索、加工が可能なデータベース）の構築
- ② 証券統計ポータルサイトからのダイレクトリンク（証券関係機関の統計ページに直接アクセス可能な、現在の「証券統計ポータルサイト」の発展形）
- ③ 金融・資本市場統計要覧（金融・資本市場の主要な統計について、単位、掲載期間等を統一し収録した、エクセルデータ集）作成

の三つの提供方法を挙げ、各手法について議論を重ね評価を行った。

統計利用者の利便性の観点からは、金融・資本市場統計のデータベースを構築する

①が最も望ましいと思われるものの、統計作成者の負担感、費用面、セキュリティ面といった様々な視点から総合的に検討した結果、最も実現可能性が高く、かつ利用者の利便性向上を早期に実現可能な「ワンストップサービス」の提供方法として、既存のインフラを有効に活用可能な②「証券統計ポータルサイトからのダイレクトリンク」

(以下、「ダイレクトリンク」という)によってワンストップサービスを推進することが望ましいと判断し、ダイレクトリンクの整備を次のとおり進めていくことで合意を得た。

(1) 「ダイレクトリンク」の整備の進め方

日本証券経済研究所が開設する「証券統計ポータルサイト」に掲載された「金融・資本市場統計データ一覧」から、各証券関係機関の統計情報ページに直接、もしくはそれに準じる形で容易にアクセスできるよう、平成23年4月1日よりリンクを設定したところである。

今後、「金融・資本市場統計データ一覧」からアクセスした、各証券関係機関の統計情報が横断的に利用できるよう、主要な統計を「標準化対象統計」として選定し、これらの統計について、統計データ提供時に「標準化すべき項目」とその「目標時期」を定め、各証券関係機関は、定められた仕様に準拠して統計整備を進める。

各機関は、新たに統計を作成・公表する際においても、当該統計が標準化対象統計に該当する場合、定められた仕様に十分に配慮して、統計の作成・公表を行うこととする。

(2) 標準化対象統計の整備

個々の統計の特性によって標準化の必要性が異なるため、全統計を対象として一律に標準化を進めることは、費用対効果を勘案しても効率的ではない。

効率的な整備推進の観点から、次に該当する統計を標準化対象統計とする。

- ① 各機関において主要統計と考えられる統計
- ② 他団体で同種の統計があり、比較利用することが見込まれる統計
- ③ 外国人の利用頻度が高いと考えられる統計

①から③のいずれかに該当するとして各機関の判断において標準化対象統計とした統計については、対応可能な項目から、下記「優先項目」に掲げた仕様に準拠して整備を推進する。

(優先項目)

項 目	仕 様
ファイル形式	Excel 形式または CSV 形式と PDF 形式の併用が望ましい。
年号表記	西暦表記、もしくは西暦・和暦の併記とする。
掲載期間	日次データについては、少なくとも過去1ヶ月の時系列データを掲載。
	週次データについては、少なくとも過去1年間の時系列データを掲載。
	月次・年次データについては、少なくとも過去10年間の時系列データを掲載。
電子データ化	紙媒体で存在する統計情報の電子データ化（データ入力、OCR、画像スキャン等）について、コスト及び作業負担等を考慮しつつ対応可能な過去データ整備期間の検討を行い、電子データ化に着手。
行及び列データ系列	原則として、列（縦）系列を時間軸、行（横）系列を項目軸とする。
統計の説明、用語、数値の定義等についての解説	統計の説明、用語、数値の定義等についての解説資料の提供。
英語への対応	英語版統計データの掲載。
	英語版解説資料等の作成の検討を開始。

(用語、統計名称)

同一の概念に対し異なる用語を用いたり、異なる概念に対し同一の用語を用いたりすることは、調査対象者や統計利用者に誤解と混乱を生じさせることから、そうした用語は整合性を図る形で統一することが望ましい。しかしながら、統計データの連続性の確保、各機関における過去の統計整備に固有の経緯が存在するため、現時点においては、業界横断的な統一基準は規定しないこととする。

なお、各機関においては、統計の横断的利用の観点からみた利便性向上を念頭に、用語や統計名称の統一化を継続的に検討することとする。また、上記優先項目である統計の解説資料の一層の充実を通じて、利用者の利便性向上に資するよう努める。

（目標時期）

「優先項目」については、統計整備の目標時期を平成 24 年上期とするが、「用語、統計名称」については、特段の目標時期の設定を行わず、継続的な検討事項とする。ただし、「優先項目」の目標時期については、各機関における個々の事情を勘案するものとする。

6. 中長期的な検討事項～統計データの高度な利用環境の整備～

(1) XBRL 及び SDMX 技術の活用

金融・資本市場に関する実証研究の発展に資する観点から、より高度で専門的な分析に必要な統計データの整備、提供方法等の一つとして、XBRL 技術の活用について検討を行った。

統計データの利用環境の整備を推進するうえで、XBRL 技術の活用は有用であるものの、現状では、利用者による加工が困難な PDF 形式のみの提供にとどまっている統計が少なくない。こうした現状に鑑み、XBRL 形式による統計データの提供は中長期的課題とし、当面は利用者が目的に応じて容易に加工可能なデータ形式として、広く普及している Excel 形式又は CSV 形式の提供を着実に推進することが適当である。

XBRL と同様の XML ベースの言語を用い、統計分野において活用されつつある SDMX (Statistical Data and Metadata eXchange) が、将来的に広範に利用される可能性もある。このため、中長期的には XBRL とともに SDMX の活用も視野に入れた検討が必要と考えられる (XBRL 及び SDMX 技術については、**別紙** 参照)。

(2) その他

統計情報は個々の要素が数値化された情報であり、統計利用初心者には、その内容を的確に読み取ることが困難な側面もある。統計の利用環境のさらなる整備の観点から、新たな機能として、統計情報の内容の可視化を可能とする「グラフ作成機能」、統計データの多次元的な分析やレポート作成等を可能とする「詳細分析機能」、あるいは、統計情報の提供側とユーザーとの双方向のコミュニケーションを実現する「コメント付与機能」等、より高度な機能の実現に向けた検討も必要であろう。

7. おわりに

金融・資本市場統計は、投資環境の整備、市場の信頼性の維持・向上等に資する基礎的かつ重要なインフラの一つである。特に、2008年のリーマン・ショック以降、G20財務相・中央銀行総裁会議においても、複雑化する金融市場の実態を統計が正確に捉え切れていないといった「データギャップ」の問題が取り上げられるなど、世界的にも、金融・資本市場統計については、市場の実態を正確かつ迅速に把握・分析し得るよう、一層の整備・充実を図ることが求められている。

こうした背景の下、本懇談会では、現時点における金融・資本市場に関する統計の整備に向けた問題点と、その解決に向けた具体的方策について議論を重ねるとともに、証券関係機関において相互の連携を図りつつ、利便性向上の観点から実効性の高い統計整備に取り組んできたところである。

今回の取組により、金融・資本市場統計の利用環境は着実に向上するものと考えられるが、金融・資本市場を取り巻く環境変化、IT技術の進歩等に伴い、今後も、統計情報への利用者ニーズの更なる多様化・高度化が予想されることから、引き続き、証券関係機関をはじめ関係者各位における連携を図りつつ、利用者ニーズに即した統計整備を継続することが必要である。

将来的には、広範かつ多様な利用者ニーズに対応し得る「金融・資本市場統計データベース」が構築され、金融・資本市場に関する統計情報がより多くの利用者に広く有効活用されることを通じ、我が国金融・資本市場の投資環境の整備、市場の信頼性の維持・向上等に資することが期待される。

以 上

XBRL 及び SDMX 技術の概要

- ・XBRL は、各種財務報告用の情報を作成・流通・利用できるように標準化されたコンピュータ言語である。XBRL の仕様 (XBRL Specification) は、ソフトウェアやプラットフォームに関係なく、電子的な財務情報の作成や流通・再利用を可能とすることから、金融庁の EDINET、東証の TDnet、米国 SEC の EDGAR 等で XBRL 形式によるデータ提供が導入されている。
- ・XBRL は、①XML ベースの言語である*、②財務諸表だけでなく、企業を取り巻くあらゆる情報を記述することが当初から想定されている、③人手を介さずデータを加工できるようになるため、転記ミスや改竄等の脅威から解放される、④様々なデータ形式 (HTML、PDF、CSV 等) への変換が容易であるといった特徴がある。
- ・SDMX は、OECD (経済協力開発機構) が推進する統計データ及び付随するメタデータ交換のための言語で、OECD の統計情報提供基盤 (SIS) において、情報交換の利用促進のために標準化されたものであり、現在 OECD をはじめ 40 以上の国際機関が採用している。
- ・SDMX は、①XML ベースの言語である、②未加工の粒度の細かいデータに対してメタデータによってデータセットや多次元キューブを定義することができる、③統計データ、メタデータ、及びデータ交換プロセスをモデリングするための方法論を提供する等の特徴を持っている。
- ・金融・資本市場統計の整備に当たっては、利用者にとって使いやすいデータであることが重要であるが、最終的に使いやすい形式は利用者によって異なることから、「様々な形に加工しやすいデータ」という視点を持つ必要がある。このような観点から、技術的に将来性などを鑑みると、統計整備に XML ベースの応用言語を活用することが望ましい。ただし、XBRL、SDMX ともにはデータ量が増えやすいため、運用面での困難が伴う可能性があることに留意する必要がある。

* XML (Extensible Markup Language) は文書やデータの意味や構造を記述するためのコンピュータ言語の一つであり、①ネットワーク環境を活用できる、②文字コードの問題が解決されている、③複雑な構造のデータが記述できる、④拡張性があり、陳腐化の心配が少ないなどの特性を持っている。

「金融・資本市場統計整備懇談会」設置要綱

平成 21 年 6 月 16 日

日 本 証 券 業 協 会

1. 趣旨

本協会では、投資環境の整備の一環として、金融・資本市場に関する統計情報が多様な利用者に広く有効活用されるよう、関係機関が提供する各種の統計情報を一元的に利用できる環境を整備するなど、統計情報の整備・充実について検討を進めている。

こうした統計情報の整備には、金融・資本市場の変化や利用者ニーズを的確に把握するとともに、協会員及び関係機関の理解、協力のもと、業界横断的な検討が必要である。

そこで、金融・資本市場統計情報の整備のあり方について幅広い検討を行うため、証券戦略会議のもとに「金融・資本市場統計整備懇談会」を設置する。

2. テーマ

- (1) 関係機関における相互協力のもとでの体系的な統計整備
- (2) 統計利用に係る総合的なワンストップサービスの推進
- (3) 今後の金融・資本市場統計情報のあり方

3. 構成

- (1) 本懇談会は委員 10 名程度で構成する。
- (2) 委員は協会員及び関係機関等の役職員及び有識者のうちから、証券戦略会議議長が委嘱する。
- (3) 委員の任期は 1 年とする。

4. 運営

- (1) 本懇談会は、座長を置く。
- (2) 座長は委員から座長代理を指名し、議事進行を代理させることができる。
- (3) 座長は必要に応じて、関係者及び有識者等の出席を求め、意見を聞くことができる。
- (4) 座長は必要に応じて、専門的見地から具体的な検討を行うため、本懇談会の下にワーキング・グループを設置することができる。
- (5) 本懇談会は、審議状況に応じて、適宜、証券戦略会議に報告を行う。

5. 事務局

本懇談会の事務局は、日本証券業協会 政策本部調査部が担当する。

以 上

「金融・資本市場統計整備懇談会」名簿

座 長	古 賀 信 行	(野 村 證 券	取締役兼執行役会長 (代 表 執 行 役)
座長代理	高 橋 厚 男	(日本証券経済研究所	理 事 長)
委 員	乾 文 男	(投 資 信 託 協 会	副会長・専務理事)
〃	井 原 誠 吉	(証券保管振替機構	常 務 取 締 役)
〃	風 間 澄 之	(大 和 総 研	専 務 取 締 役)
〃	後 藤 敬 三	(金融先物取引業協会	専 務 理 事)
〃	高 谷 哲 司	(日本証券投資顧問業協会	業 務 部 長)
〃	竹 原 均	(早稲田大学大学院	ファイナンス研究科教授)
〃	古 川 英 俊	(三 井 住 友 銀 行	常 務 執 行 役 員)
〃	増 井 喜 一 郎	(日 本 証 券 業 協 会	副 会 長)
〃	丸 山 顕 義	(東 京 証 券 取 引 所	情報サービス部長)
オブザーバー	栗 田 照 久	(金 融 庁	監 督 局 証 券 課 長)
〃	櫻 庭 千 尋	(日 本 銀 行	調 査 統 計 局 審 議 役)

以上 13 名
(敬称略・五十音順)

「金融・資本市場統計整備懇談会ワーキング・グループ」の設置について

平成 21 年 12 月 2 日

金融・資本市場統計整備懇談会

1. 設置趣旨

「金融・資本市場統計整備懇談会」（以下「懇談会」という。）における議論を踏まえ、金融・資本市場統計の整備に向けて、今後取り組むべき課題及び具体的方策の検討を行うため、懇談会の下に、「金融・資本市場統計整備懇談会ワーキング・グループ」（以下「WG」という。）を設置する。

2. 構成

WG は、懇談会の委員、協会員・関係機関等の実務担当者及び有識者をもって構成する。また、主査の判断により、オブザーバーを置くことができる。

3. 運営

- (1) WG に主査を置く。
- (2) 委員が WG を欠席する場合又は検討すべき特定の分野・課題に応じて、代理人を出席させ、又は書面により意見を提出することができる。
- (3) 懇談会の委員は、WG に出席することができる。
- (4) 主査は、必要に応じて関係者及び有識者等に出席を求め、意見を聞くことができる。
- (5) WG における検討状況等について、適宜、懇談会に報告する。

4. 事務局

WG の庶務は、日本証券業協会 政策本部調査部が担当する。

以 上

「金融・資本市場統計整備懇談会ワーキング・グループ」名簿

主 査	竹 原 均	(早稲田大学大学院	ファイナンス研究科教授)
委 員	青 木 優 知	(三 井 住 友 銀 行	投資銀行統括部上席推進役)
〃	市 倉 直 幸	(投 資 信 託 協 会	シ ス テ ム 業 務 室 長)
〃	内 山 朋 規	(野 村 證 券	エクイティ・クオンツ・リサーチ部 エグゼクティブ・ディレクター)
〃	岡 崎 剛 司	(日本証券投資顧問業協会	企 画 部 部 長)
〃	工 藤 直	(大 和 総 研	統 計 情 報 部 副 部 長)
〃	鈴 木 伸 治	(証券保管振替機構	情 報 サ ー ビ ス 部 長)
〃	露 木 邦 彦	(大 阪 証 券 取 引 所	経営管理本部経営企画グループ データバンクチーム チームリーダー)
〃	豊 永 聡	(岡 三 証 券	企 画 部 部 長)
〃	野 間 幹 晴	(一 橋 大 学 大 学 院	国際企業戦略研究科准教授)
〃	松 井 哲 夫	(金融先物取引業協会	調 査 部 部 長)
〃	安 田 賢 治	(日本証券経済研究所	事 務 局 次 長)
〃	矢 田 通 典	(東 京 証 券 取 引 所	情報サービス部グループ長)
オブザーバー	戸 塚 靖	(金 融 庁	監督局証券課証券監督調整官)
〃	荻 野 覚	(日 本 銀 行	調査統計局 統計整備グループ長)

以 上 15 名

(敬称略・五十音順)

「金融・資本市場統計整備懇談会及びワーキング・グループ」審議経過

第1回懇談会（平成21年10月7日）

- 金融・資本市場統計の整備に向けた課題について（報告・意見交換）
- 今後の懇談会の進め方について

第2回懇談会（平成21年12月2日）

- 金融・資本市場統計の整備に向けた課題について（プレゼンテーション）
 - ・株式会社 大和総研 土屋 貴裕 投資調査部次長
 - ・イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社 山口 勝業 代表取締役社長
- ワーキング・グループの設置について

第1回ワーキング・グループ（平成21年12月21日）

- 金融・資本市場統計の整備に向けた課題について（意見交換）
- 今後のワーキング・グループの進め方について

第2回ワーキング・グループ（平成22年1月26日）

- ユーザーの立場からの金融・資本市場統計の整備に向けた課題
 - ・一橋大学大学院国際企業研究科 野間 幹晴 准教授
- 日本銀行における統計整備に関する考え方等について
 - ・日本銀行調査統計局 吉野 克文 統計企画担当総括企画役
- 今後のワーキング・グループの進め方について

第3回ワーキング・グループ（平成22年2月23日）

- XBRL 技術の活用と課題
 - ・法政大学経営学部経営学科 坂上 学 教授
- 統計情報の著作権等について
 - ・東洋経済新報社 駒橋 憲一 取締役データ事業局長
千葉 啓太 データ事業局プロダクト部部长

・日本経済新聞デジタルメディア NEEDS 事業本部 小山 泰弘 情報開発部次長

- 日本証券業協会の統計情報の整備について（事務局報告）

第4回ワーキング・グループ（平成22年3月19日）

- 統計整備に向けた具体的な課題・取組について（意見交換）

第5回ワーキング・グループ（平成22年4月16日）

- 統計整備に向けた具体的な課題・取組について（ワーキング・グループ中間整理）

第3回懇談会（平成22年6月2日）

- 金融・資本市場統計整備懇談会ワーキング・グループ中間整理について
（報告・意見交換）

第6回ワーキング・グループ（平成22年10月27日）

- 金融・資本市場統計整備の進捗状況について（報告・意見交換）
- 今後のワーキング・グループの進め方について

第7回ワーキング・グループ（平成22年11月24日）

- 統計整備に向けた証券関係機関における取組について（報告）
- 金融・資本市場統計データ一覧について（日本証券経済研究所報告）
- 統計利用に係る総合的なワンストップサービスの推進について（意見交換）

第4回懇談会（平成22年12月15日）

- 統計整備に向けた証券関係機関における取組について
- 金融・資本市場統計データ一覧について
- 統計利用に係る総合的なワンストップサービスの推進について

第8回ワーキング・グループ（平成23年1月27日）

- 金融・資本市場統計データ一覧について（日本証券経済研究所報告）

- 新着情報について（意見交換）

第9回ワーキング・グループ（平成23年2月28日）

- 金融・資本市場統計データ一覧の進捗状況について（日本証券経済研究所報告）
- 統計データ提供時に標準化すべき事項について（意見交換）

第10回ワーキング・グループ（平成23年4月27日）

- 金融・資本市場統計の整備に向けて（案）
（金融・資本市場統計整備懇談会報告書）

第5回懇談会（平成23年6月8日）

- 金融・資本市場統計の整備に向けて（案）
（報告・意見交換）

以 上

証券統計ポータルサイトは証券等に関する統計データへのリンク集です。また公表されている各統計の解説もご覧いただけます。

証券統計ポータルサイト

Home

サイト利用案内

お問い合わせ

サイトマップ

証券関係諸団体 統計ページへのリンク

[証券取引所]

東京証券取引所
大阪証券取引所
名古屋証券取引所
札幌証券取引所
福岡証券取引所

[証券諸団体]

日本証券業協会
証券教育広報センター
投資信託協会
日本証券投資顧問業協会
証券保管振替機構
日本証券クリアリング機構
証券・金融商品あっせん相談センター
日本国債清算機関
日本証券金融(株)
大阪証券金融(株)
東京金融取引所
金融先物取引業協会
不動産証券化協会
日本証券経済研究所
ICJ
NPO法人 投資と学習を普及・推進する会 (エイブロシス)
証券コード協議会
日本証券経済倶楽部

[政府・日銀]

内閣府
金融庁
財務省
国税庁
証券取引等監視委員会
日本銀行

[その他]

格付投資情報センター (R&I)
日本格付研究所 (JCR)
ムーディーズ・ジャパン
日本経済新聞
スタンダード & プアーズ
大和インベスター・リレーションズ
大和総研
日本インベスター・リレーションズ
協議会
財務会計基準機構
企業会計基準委員会
日本監査役協会
日本公認会計士協会
日興アイ・アール
上田ハロー

[海外取引所]

国際取引所連合 (WFE)
ニューヨーク証券取引所

ジャンル別統計データ

1. 株式発行市場
2. 株式流通市場
3. 公社債発行市場
4. 公社債流通市場
5. 証券先物・オプション取引
6. 金融商品・金融先物取引・FX
7. 投資信託・証券化市場
8. 振替制度・清算・決済
9. 証券業者・投資顧問等
10. 税・各種調査・企業業績等
11. 経済・景気・金融・為替等
12. 海外関係



収録した統計の概要と解説
(金融・資本市場統計データ一覧)

証券統計フリーワード検索

検索

EDINET (有価証券報告書等の閲覧)

株式上場銘柄等検索

証券関係年表検索

証券図書館蔵書検索

証券関係論文・記事検索

日本証券経済研究所

証券経済学会

ご注意:本サイトを利用する前にご覧ください。

◆ 新着情報等

新たに作成・公表を開始した統計データの情報等

統計(図表)で見る日本の証券市場



1. 株式発行市場
2. 株式流通市場
3. 公社債発行市場
4. 公社債流通市場
5. 証券先物・オプション取引
6. 金融商品・金融先物取引・FX
7. 投資信託・証券化市場
8. 振替制度・清算・決済
9. 証券業者・投資顧問等
10. 税・各種調査・企業業績等
11. 経済・景気・金融・為替等
12. 海外関係

主要証券年表

TOPICS

- ▶ 今月のトピックス
- ▶ 今月の講演会

このページの上へ

HOME / 金融・資本市場統計データ一覧

収録した統計の概要と解説(金融・資本市場統計データ一覧)



証券統計ポータルサイトに収録された金融・資本市場に関連する統計データの紹介と解説がご覧いただけます。

公表機関別に統計を調べることもジャンル別に調べることもできます。

公表機関別目次

ジャンル別目次

証券統計ポータルサイト

[Home](#)[サイト利用案内](#)[お問い合わせ](#)[サイトマップ](#)

HOME / 金融・資本市場統計データ一覧 / 公表機関別目次 / 日本証券業協会

日本証券業協会



この会社(組織)が作成している主な証券関係統計は、次のとおりです。

統計の解説をご覧になりたい場合は、項目名をクリックして下さい。

[日本証券業協会\(ホームページ\)](#) / [日本証券業協会統計情報](#) / [株式等](#) / [公社債等](#) / [国際取引](#) / [証券業界](#) / [その他](#) /

日本証券業協会(ホームページ)

[\(ホームページ\)](#)

[このページの上部へ](#)

日本証券業協会統計情報

[統計情報](#)

[このページの上部へ](#)

株式等

[新規公開に際して行う株券の個人顧客への配分状況](#)
[上場有価証券の発行会社の発行した店頭取扱有価証券の売買状況](#)
[株券等質借取引状況](#)
[全国上場会社のエクイティファイナンスの状況](#)
[投資部門別売買状況における個人の状況](#)
[取引所金融商品市場外取引売買等相場表](#)
[取引所金融商品市場外取引売買等相場表\(月次\)](#)

[このページの上部へ](#)

公社債等

[公社債種類別店頭売買高](#)
[公社債投資家別売買高](#)
[国債投資家別売買高](#)
[公社債投資家別条件付売買\(現先\)月末残高](#)
[債券質借取引残高等状況](#)
[選択権付債券売買取引状況](#)
[国内CP等及び私募社債の取引状況等](#)
[店頭CFD取引状況](#)

※この行をすぐ下の行と入れ替えてください

[有価証券店頭デリバティブ取引等状況](#)

[公社債発行額・償還額](#)

[公社債店頭売買参考統計値](#)

[格付マトリクス](#)

国際取引

[外貨証券の売買状況](#)
[\(外国取引一株式・ワラント・債券・短期債券・外国投信・CD・CP\)](#)
[外貨証券発行者国籍別取得処分状況](#)
[\(外国取引一株式・債券・ユーロ円・短期債券\)](#)
[外貨証券投資家別取得処分処理状況\(外国取引一株式\)](#)
[外貨証券アジア市場取得処分状況\(外国取引一株式\)](#)
[外貨証券現先売買状況\(債券\)](#)
[外国投信の運用成績一覧表](#)
[外国投信の残高一覧表](#)
[外国投信の商品別投資残高表](#)

[このページの上部へ](#)

証券業界

[会員数及び資本金の推移](#)
[業態別特別会員数の推移](#)
[証券会社の従業員数](#)
[証券会社の役員・従業員数の推移](#)
[金融商品仲介業者の登録外務員数\(会員\)](#)
[金融商品仲介業者の登録外務員数の推移\(会員\)](#)
[特別会員の従業員数](#)
[特別会員の役員・従業員数の推移](#)
[金融商品仲介業者の登録外務員数\(特別会員\)](#)
[金融商品仲介業者の登録外務員数の推移\(特別会員\)](#)
[会員の都道府県別営業所数一覧](#)
[全国証券会社主要勘定](#)
[会員の3月期決算概況](#)
[会員の9月末中間決算概況](#)
[FACT BOOK \(証券市場及び証券業界の動向\)](#)
[FACT BOOK \(証券市場及び証券業界の動向\)](#)
[FACT BOOK \(証券市場及び証券業界の動向\)](#)

[このページの上部へ](#)

その他

[インターネット取引に係るシステム障害件数](#)
[インターネット取引に係る株式売買等データ](#)
[個人情報に関する苦情処理に関する実績報告](#)

[このページの上部へ](#)

[金融・資本市場統計データ一覧トップへ戻る](#) | [公表機関別目次へ戻る](#)

▶ 統計データを見る

●名称: 日本証券業協会統計・証券業界 ●種類: 会員数及び資本金の推移

●概要: 会員数(本店、支店、その他)、会員(外国法人を除く)の資本金の合計額、資本金別の会員数(外国法人を除く)の推移をあらわしたものを。
月次

●主な公表フォーマット: Excel ●公表頻度:

毎月25日に前々月分を公表

●データ掲載期間: 月次: 直近1年 / 年次: 2001年～ / ●公表時期:

●注意事項:

1. 会員からの報告を基に集計しています。
2. 本店(外国法人は日本において本拠となる支店等)、支店及びその他の営業所別に集計しています。
3. 海外店舗は含みません。

▶ 統計データを見る

●名称: 日本証券業協会統計・証券業界 ●種類: 業態別特別会員数の推移

●概要: 業態別特別会員数の推移をあらわしたもの。都市銀行、信託銀行、政府系・系統金融機関、地方銀行、第二地銀協地銀、信用金庫、信用金庫連合会、生命保険会社、損害保険会社、短資会社、外国銀行、証券金融会社、信用組合、その他銀行、公社について掲載。

年次

●主な公表フォーマット: Excel ●公表頻度:

毎年末(12月末)現在状況を翌々月25日に公表

●データ掲載期間: 2002年12月末～ / ●公表時期:

●注意事項:

1. 特別会員からの報告を基に集計しています。
2. 各業態の構成については、特別会員名簿をご覧ください。

▶ 統計データを見る

●名称: 日本証券業協会統計・証券業界 ●種類: 証券会社の従業員数

●概要: 証券会社の従業員数をあらわしたもの。内勤従業員数と登録外務員数(一種外務員、信用取引外務員、二種外務員)を掲載。

半期

●主な公表フォーマット: Excel ●公表頻度:

毎年2月、8月の初旬

●データ掲載期間: 2002年12月末～ ●公表時期:

●注意事項:

1. 本店その他の営業所又は事務所の所在地を管轄する地区協会別に計上しています。
2. 報告基準日付(毎年6月末及び12月末)で退職した者については、報告基準日に在籍していたものとして計上しています。
3. 「登録外務員」欄には、従業員(①役員を除き、執行役員を含みます。②派遣社員、アルバイト、パート等を含みます。)のうち、現に従事している業務のいかんを問わず、報

証券統計ポータルサイト

Home

サイト利用案内

お問い合わせ

サイトマップ

HOME / 金融・資本市場統計データ一覧 / ジャンル別目次

ジャンル別目次



ジャンル名をクリックしていただくと、
関連する統計の目次と作成元が表示されます。

- | | | |
|---------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 1.株式発行市場 | 2.株式流通市場 | 3.公社債発行市場 |
| 4.公社債流通市場 | 5.証券先物・オプション取引 | 6.金融商品・金融先物取引・FX |
| 7.投資信託・証券化市場 | 8.振替制度・清算・決済 | 9.証券業者・投資顧問等 |
| 10.税・各種調査・企業業績等 | 11.経済・景気・金融・為替等 | 12.海外関係 |

1.株式発行市場

[このページの上部へ](#)

2.株式流通市場

- | | | |
|--------------------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 1.上場会社数・上場会社情報 | 2.時価総額等 | 3.売買高・売買代金 |
| 4.投資部門別動向 | 5.相場表・日報・市況 | 6.信用取引 |
| 7.貸借取引 | 8.株価指数 | 9.投資収益率・利回り・PER等 |
| 10.外国株 | 11.月報・総括表 | |

[このページの上部へ](#)

3.公社債発行市場

[このページの上部へ](#)

4.公社債流通市場

- | | | |
|----------------------------|---------------------------|-----------------------------|
| 1.売買高・売買代金 | 2.投資部門別動向 | 3.相場表・日報・気配 |
| 4.上場銘柄情報 | 5.月報・総括表 | |

[このページの上部へ](#)

5.証券先物・オプション取引

- | | | |
|----------------------------|---------------------------|-----------------------------|
| 1.売買高・売買代金 | 2.投資部門別動向 | 3.相場表・日報・市況 |
| 4.月報・総括表 | | |

[このページの上部へ](#)

6.金融商品・金融先物取引・FX

[1.金利先物](#)

[2.為替証拠金取引・FX](#)

[3.株価指数証拠金取引](#)

[4.月報・総括表](#)

[☞ このページの上部へ](#)

7.投資信託・証券化市場

[1.投資信託](#)

[2.ETF・REIT](#)

[☞ このページの上部へ](#)

8.振替制度・清算・決済

[1.株式等振替制度](#)

[2.一般債等振替制度](#)

[3.清算・決済](#)

[4.旧株券保管振替制度](#)

[☞ このページの上部へ](#)

9.証券業者・投資顧問等

[1.証券業者](#)

[2.投資顧問等](#)

[☞ このページの上部へ](#)

10.税・各種調査・企業業績等

[1.税・財政](#)

[2.各種調査](#)

[3.企業業績等](#)

[☞ このページの上部へ](#)

11.経済・景気・金融・為替等

[1.経済・景気](#)

[2.金融](#)

[3.為替等](#)

[☞ このページの上部へ](#)

12.海外関係

[1.株式発行市場](#)

[2.株式流通市場](#)

[3.公社債発行市場](#)

[4.公社債流通市場](#)

[5.証券先物・オプション取引](#)

[6.金融商品・金融先物取引・FX](#)

[7.投資信託・証券化市場](#)

[10.税・各種調査・企業業績等](#)

[11.経済・景気・金融・為替等](#)

[☞ このページの上部へ](#)

[← 金融・資本市場統計データ一覧トップへ戻る](#)

HOME / 金融・資本市場統計データ一覧 / ジャンル別目次 / 2. 株式流通市場: 2 時価総額等 / 解説データ一覧

解説データ一覧



証券統計ポータルサイトに収録された金融・資本市場に関連する統計データの紹介と解説がご覧いただけます。

公表機関別に統計を調べることもジャンル別に調べることもできます。

2 時価総額等

●名称: 株式時価総額 ●種類: 月末時価総額

1949年5月以降の月末現在の市場1部・2部・マザーズ別株式時価総額

●概要: 月次

●主な公表フォーマット: Excel ●公表頻度: 翌月第1営業日13:00

●データ掲載期間: 1949年5月以降 ●公表時期:

●注意事項:

▶ 統計データを見る

●名称: 株式時価総額 ●種類: 業種別時価総額 (市場第一部)

最近13ヶ月の各月末現在の業種別時価総額

●概要: 月次

●主な公表フォーマット: PDF ●公表頻度: 翌月第1営業日13:00

●データ掲載期間: 直近13か月分 ●公表時期:

●注意事項:

▶ 統計データを見る

●名称: 株式時価総額 ●種類: 時価額順位表

最近13ヶ月の市場1部・2部・マザーズ別時価額上位会社 (市場1部は50位、市場2部・マザーズは各25位まで掲載)

●概要: 月次

●主な公表フォーマット: PDF ●公表頻度: 翌月第1営業日13:00

●データ掲載期間: 直近13か月分 ●公表時期:

●注意事項:



FATCA 第二次ガイダンスに対する 意見書の提出について

日本証券業協会

2011年6月9日

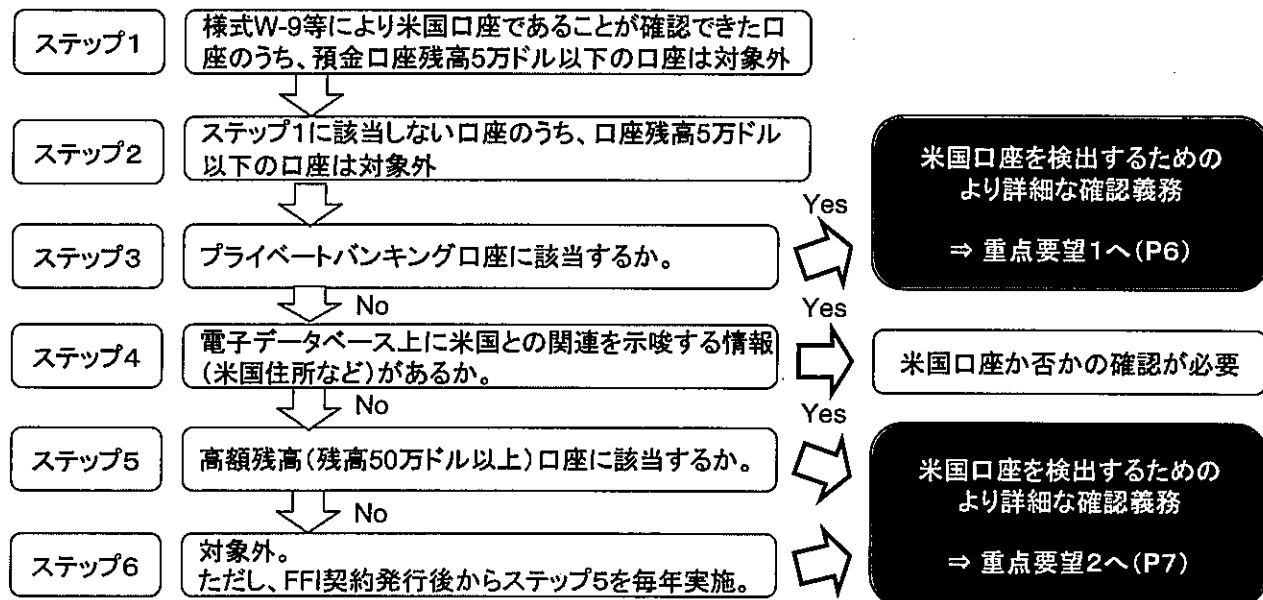


背景

- 本年4月8日(米国時間)、米国の内国歳入庁(IRS)は、「外国口座税務コンプライアンス法」(Foreign Account Tax Compliance Act: FATCA)の細則である財務省規則の骨子案に当たる第二次ガイダンス(Notice 2011-34)を公表した。
- 第二次ガイダンスでは、昨年8月に公表した第一次ガイダンスに対して各国から寄せられた膨大な数の提案・要望を踏まえ、同ガイダンスの内容が一部修正されるとともに、同ガイダンスでは触れられていなかった、「パススルー額」や「みなし遵守規定」について、米国財務省及びIRSの現時点における考え方が示されている。
- これを受けて、本協会では本年4月に証券戦略会議の下「米国における『外国口座税務コンプライアンス法』(FATCA)への対応に係るワーキング・グループ」を設置し、議論を重ねた結果、我が国証券会社にとって、依然として実務上の対応が困難な項目が多々認められることから、今回の第二次ガイダンスに対して意見書を提出することとした。
- 本意見書は、同ワーキング・グループで素案を作成の後、会員証券会社に対してメンバーズ・コメントの募集(期間:5月20日から26日まで)を行い、取りまとめたものである。

第二次ガイダンスの主要項目(その1)

■ 既存個人口座の中から米国口座を検出するための主な確認手順

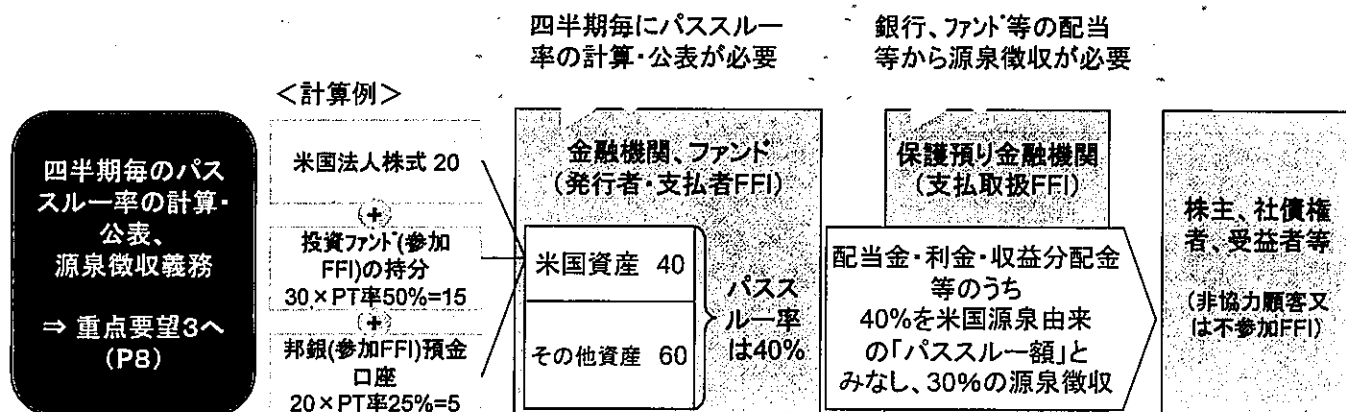


2

第二次ガイダンスの主要項目(その2)

■ パススルー額の取扱い

- ◆ 外国金融機関(FFI)は、次の者に対して支払う「パススルー額」に対して30%の源泉徴収を行う義務を負う。
 - ・ 非協力的顧客(米国口座に関する情報の開示を拒否する顧客)
 - ・ 不参加FFI(IRSとの間でFFI契約を締結しない外国金融機関)
- ◆ 「パススルー額」は、源泉徴収対象額(米国証券の利金、配当金など)についてはその全額、源泉徴収対象でない支払額については「パススルー率」を掛けた金額
- ◆ 「パススルー率」(PT率)は、発行者・支払者であるFFIの総資産に米国資産が占める割合



第二次ガイダンスの主要項目(その3)

■ FFIによる認証義務

- ◆ FFIの最高コンプライアンス役員(Chief Compliance Officer)又は同等の役員は、個人口座の特定に必要な手続きを踏んだことをIRSに認証する必要がある。
また、FFI契約発効日までの間に、経営陣が顧客に米国口座であるという判定を逃れるためのアドバイスをしていないこと等をIRSに認証する必要がある。

■ みなし遵守規定

- ◆ みなし遵守FFIとして認定されるための主な条件(地域金融機関の例)
 - ・ 拡大関連者グループ※内の1社以上が参加FFIになること
 - ・ 拡大関連者グループの各FFIが、国外に拠点を持たず、国外で勧誘行為をしないこと
 - ・ 参加FFIと同様の米国口座等の検出を行い、検出された場合に当該口座を排除すること

■ リードFFI

- ◆ FFIグループ※内に、「リードFFI」の設置が求められる。
リードFFIは、グループ各社のFFI契約等について認証を行い、グループを代表して申請手続等を行う必要がある。

※ 拡大関連者グループ：議決権、持分等が50%超で連鎖するグループ

※ FFIグループ：議決権、持分等が50%超で連鎖するFFIのグループ

4

重点要望項目

- 要望1:「プライベートバンキング口座」(ステップ3)については、より詳細な確認が求められているが、口座残高の基準を100万ドル以上とすることなど、プライベートバンキングの実態に合わせてその定義を見直すこと
- 要望2:「高額残高口座」(ステップ5)については、より詳細な確認が求められているが、リスクベース・アプローチ※の観点から電子検索のみとするか、又は口座残高の基準を1,000万ドル以上に引き上げること
- 要望3:「パススルー額」の考え方については根本的に反対であり、実効性のある手続きに改めること

※ リスクベース・アプローチ：過度なコスト負担を回避しながら租税回避行為のリスクが高い顧客層に対してフォーカスする手法

5

要望1:「プライベートバンキング口座」(ステップ3)については、口座残高の基準を100万ドル以上とすることなど、その定義を見直すこと

プライベートバンキング口座については
詳細な確認が求められる(ステップ3)

- ◆ 「プライベートバンキング口座」とは、「プライベートバンキング部門」によって管理されている口座、または「プライベートバンキングリレーションシップ」の一環で管理されている口座
- ◆ 「プライベートバンキング部門」とは、以下の(A)から(D)のいずれかに該当するもの
 - (A) 「プライベートバンキング」などの呼称がついている
 - (B) 資産家顧客へのサービスに特化している
 - (C) マネーロンダリング規制等においてプライベートバンキング部門に分類されている
 - (D) 従業員が、(i)又は(ii)を行っている
 - (i) 通常は提供されない投資アドバイス等の提供
 - (ii) 通常は収集されない顧客の財産情報等の収集
- 「プライベートバンキングリレーションシップ」とは、役職員が、上記(D)(i)又は(ii)を行うこと

【要望】

- 欧米等の「プライベートバンキング」の実態に合わせた定義見直し
 - (1) 口座残高の基準を100万ドル以上とすること
 - (2) 左記(A)～(D)については、「全て」を満たすこと
 - (3) 左記(A)については、単に呼称のみで判断しないこと
 - (4) 左記(D)の(i)及び(ii)については、「全て」を満たし、さらに以下の条件を追加すること
 - ① 同一の担当者が顧客の生涯にわたり継続的に担当すること
 - ② 自社及び系列会社以外の金融商品についても投資助言を行うこと
 - ③ 預かり資産の残高をベースに報酬を受け取ることなど

6

要望2:「高額残高口座」(ステップ5)については、リスクベース・アプローチの観点から電子検索のみとするか、又は口座残高の基準を1,000万ドル以上に引き上げること

高額残高(50万ドル以上)口座については
詳細な確認が求められる(ステップ5)

FFI契約発効後3年目から毎年、上記のステップ5について再確認することが求められる

【要望】

- リスクベース・アプローチの徹底
 - 上記のステップ3で、プライベートバンキング口座に関しては詳細な確認を行うことから、その他の口座の確認については簡素化すべき
 - 具体的には、非プライベートバンキング口座については、ステップ4の電子検索のみとすること
- 口座残高の基準引き上げ
 - 何らかの形で確認を求めるのであれば、FATCAが米国人富裕層による租税回避の防止を目的としていること等の観点から、口座残高の基準を1,000万ドル以上とすること

要望3:「パススルー額」の考え方については根本的に反対であり、実効性のある手続きに改めること

■ パススルー額の取扱いに関する問題点

◆ パススルー率の基本的考え方

今回のガイダンスでは、明らかに米国源泉所得でないもの(例えば、我が国証券会社や銀行が発行する証券の利金、配当金など)がパススルー支払に含まれ、源泉徴収対象とされていることは極めて遺憾。

◆ パススルー率の算定

多くの金融機関において、保有資産が米国資産か否か、FATCAに規定されるFFIが発行したものか否かといった分別管理は行っておらず、全ての資産について四半期毎にこのような分類を行うことは、現実的には不可能に近い。

◆ パススルー率の公表

ガイダンスの計算ルールに従えば、複数のFFIが相互に持分や債権を保有しているケースにおいて、相手方のFFIのパススルー率が確定するまで自らのパススルー率が計算できない、という関係が相互に生じ得る。このような取引関係の連鎖は金融界では極めて一般的であり、実務上、パススルー率の計算には難題が多いといわざるを得ない。

【要望】

「パススルー額」の基本的考え方として、あくまで米国源泉の利子、配当や米国資産の譲渡対価に限るべき

8

その他の主な要望・提案項目

- FFIによる認証義務【意見書10ページ参照】
責任役員等によるベストエフォートをもって免責されるよう要望
- みなし遵守規定【意見書12ページ参照】
我が国の証券会社も対象となるよう見直しを要望
- リードFFI【意見書15ページ参照】
リードFFIを利用するかどうかは、あくまでもFFI側に選択権を持たせるよう要望
- 米国口座の確認書類の範囲【意見書4ページ参照】
FFIは通常業務の範囲内で入手した書類に基づき判定すればよいことの明確化を要望
- 顧客口座の名寄せ【意見書4ページ参照】
社内で別口座として認識されている口座の名寄せ作業は不要であることの明確化を要望
- 居住性概念の導入提案【意見書4ページ参照】
リスクベース・アプローチの考え方を推し進め、FFI所在国の非居住者についてはステップ3からステップ5まで、FFI所在国の居住者についてはステップ4のみを適用することを提案
- 米国居住性の確認手続【意見書6ページ参照】
顧客の米国居住性を確認する手続については削除を要望
- 長期非協力口座の取扱い【意見書10ページ参照】
顧客情報の受け渡しについて、日米租税条約上の情報交換条項の活用等を要望
- 米国口座の報告【意見書14ページ参照】
「総入出金額」の報告が認められるよう要望

など

9