

選択権付債券売買取引取扱規程

（目 的）

第 1 条 この規程は、選択権付債券売買取引の勧誘、取引開始基準、約定処理等の基本原則に関して必要な事項について定め、選択権付債券売買取引の適切な運営と取引管理の徹底を図ることを目的とする。

（法令、規則等の遵守）

第 2 条 選択権付債券売買取引の実行に当たっては、この規程によるほか、金融商品取引法（以下「金商法」という。）その他の関係法令、日本証券業協会の規則及び取引慣行等を遵守して行うものとする。

（売買取引契約書）

第 3 条 当社は、選択権付債券売買取引を開始するときは、取引相手方と別に定める基本契約書を締結し、整理及び保管するものとする。

2 当社は、選択権付債券売買取引の約定が成立したときは、取引相手方とその都度、次の各号に掲げる事項を記載した別に定める個別取引契約書を締結し、整理及び保管するものとする。

顧客名

約定月日

対象銘柄（国債の入札前取引については、入札前取引である旨及び償還予定年月日を記載し、入札日以後に遅滞なく当該銘柄を明記するものとする。）

売買数量

売買価格（国債の入札前取引については、入札日以後に遅滞なく当該価格を明記するものとする。）

コールの保有者若しくはコールの付与者又はプットの保有者若しくはプットの付与者の区別

行使期間

行使期間の最終日における一定の時刻

選択権料

選択権の行使の方法

選択権が行使された場合の当該債券の受渡しに関する事項

3 第 1 項に規定する基本契約書を締結し、合意書を交換した場合には、前項の規定にかかわらず、個別取引契約書に代えて、前項各号に掲げる事項を記載した別に定

める個別取引明細書を作成し、当該取引相手方に交付する。

- 4 前2項にかかわらず、取引相手方が特定投資家（金商法第2条第31項に規定する特定投資家（同法第34条の2第5項の規定により特定投資家以外の顧客とみなされる者を除き、同法第34条の3第4項（同法第34条の4第6項において準用する場合を含む。）の規定により特定投資家とみなされる者を含む。）をいう。以下同じ。）である場合又は同法第28条第4項に規定する投資運用業を行う協会員との間で、同法第2条第8項第12号ロに規定する投資一任契約を締結している場合には、個別取引契約書の締結又は個別取引明細書の交付を省略することができるものとする。この場合、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締結又は個別取引明細書の交付を要しないことを合意するものとする。
- 5 前項に基づき、個別取引契約書の締結又は個別取引明細書の交付を省略する場合には、選択権付債券売買取引の約定が成立したとき、速やかに取引相手方との間で第2項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。また、取引相手方から選択権付債券売買取引の内容に関する照会があったときは、文書、口頭、電信又は電話、電子情報処理組織を使用する方法その他の方法により速やかに回答するものとする。

（契約締結時書面交付の省略）

第4条 当社は、取引相手方との間において、前条第2項に定める個別取引契約書を取り交わした場合、同条第3項に定める個別取引明細書を当該取引相手方に交付した場合又は同条第4項に基づき個別取引明細書の締結若しくは個別取引明細書の交付を省略する場合には、契約締結時書面交付の作成、交付は省略することができる。

（顧客カードの作成）

第5条 当社は、選択権付債券売買取引を行う顧客（取引相手方のうち証券会社、外国証券会社及び公共債のディーリング登録金融機関以外の者をいう。以下同じ。）について、次の各号に掲げる事項を記載した顧客カードを作成し、「顧客管理等に関する規程」の定めるところに準じて、その顧客の実情の把握等に努めるものとする。

氏名、住所及び連絡先

職業及び年齢

資産の状況

有価証券投資の経験の有無

顧客となった動機

その他当社において必要と認める事項

- 2 当社は、顧客について顧客カード等により知り得た秘密を他に洩らさないもの

とする。

(選択権付債券売買取引開始基準)

第 6 条 当社は、次の各号に掲げる基準をすべて満たした顧客と選択権付債券売買取引を行うものとする。

当該顧客が債券売買取引について十分な知識と経験があること

当該顧客が当社に保護預り口座を開設しており、預り資産が 万円以上（当社が選択権保有者となる場合においては 円以上）あること。ただし、国、地方公共団体、金商法第 2 条第 1 項第 3 号の債券発行団体、官公庁共済組合、特定投資家又はこれに準ずる事業会社及び社会的・経済的に信用のある法人はこの限りではない。

選択権付債券売買取引の対象となる債券の受渡しを行うのに十分な資力をもつ等、資産の状況等から判断して、選択権付債券売買取引を行うことが適当であること

その他当社が定める事項

(売買対象有価証券)

第 7 条 当社が、選択権付債券売買取引において取り扱う有価証券は、次の各号に掲げるものとする。

国債証券（金商法第 2 条第 1 項第 1 号に掲げる国債証券をいう。）

地方債証券（金商法第 2 条第 1 項第 2 号に掲げる地方債証券をいう。）

特別の法律により法人の発行する債券（金商法第 2 条第 1 項第 3 号に掲げる有価証券をいう。）

特定社債券（金商法第 2 条第 1 項第 4 号に掲げる特定社債券をいう。）

社債券（金商法第 2 条第 1 項第 5 号に掲げる社債券をいう。ただし、新株予約権付社債券を除く。）

投資法人債券（金商法第 2 条第 1 項第 11 号に掲げる投資法人債券をいう。）

外国又は外国の者の発行する債券で前各号の性質を有するもの

(銘 柄)

第 8 条 銘柄の決定に当たっては、次の各号に掲げるいずれかの方法により取引対象物件の範囲を特定し、取引相手方の同意を得るものとする。

公社債の種類・発行体・回号・償還年月日のすべてを特定したものを取引対象物件とする。

公社債の種類・発行体を特定し、回号・償還年月については、取引相手方との間で合意された範囲内のものを取引対象物件とする。

公社債の種類を特定し、発行体・回号・償還年月については、取引相手方との間で合意された範囲内のものを取引対象物件とする。

- 2 前項第2号又は第3号の方法に基づき取引対象物件を定める場合には、取引相手方との間で「最終利回り」について合意する等の方法により、取引対象物件に係る額面当りの売買価格の算出方法をあらかじめ定めるものとする。
- 3 個人投資家が取引相手方となる場合は、原則として、第1項第1号の方法により行うものとする。

(売買価格に関する合意)

第9条 売買価格の決定に当たっては、次の各号に掲げるいずれかの方法によって顧客の同意を得るものとする。

額面当りの単価（裸単価又は利含み単価）

最終利回り（単利又は複利）

一般に客観性・公示性のある金利等に対するスプレッド

上記各号によるほか、金商法その他関係法令、諸規則の範囲内で、市場慣行からみて 部長が妥当と認めた方法

- 2 額面当たりの単価・最終利回り等について顧客と同意する場合には、日数計算の方法及び単価と利回りの計算方法（日本式単利方式、AIBD（ISMA）方式、米国財務省証券方式等）について顧客に説明するものとする。

(リープオーダーに基づく約定の成立)

第10条 顧客から公社債の選択権付債券売買取引の希望を受けた場合において、市況の状況等から当社側が約定条件について同意できないときは、顧客の希望する条件で取引の成立が可能となった時点で、約定の成立となることをあらかじめ取り決めること（以下「リーブオーダー」という。）ができる。

- 2 リープオーダーの受注については、第3条に定める契約書に掲げる事項に加えて、次の各号に掲げる事項について顧客の同意を得るものとし、受注についての記録を作成、保存するものとする。

注文の有効期間（ 営業日以内とする。）

顧客の希望する約定条件で、希望する売買数量の一部における約定の成立

(説明書の交付等)

第11条 営業員は、顧客と選択権付債券売買取引に係る契約を締結しようとするときは、あらかじめ当該顧客（特定投資家を除く。次条において同じ。）に対し、取引の概要、取引に係る損失の危険に関する事項及び顧客の注意を喚起すべき事項を記載した説明書を交付（契約の締結前1年以内において当該顧客に対し当該説明書を

交付した場合（ただし、当該説明書を交付した日以後1年以内取引を行った場合には、当該取引に係る契約の締結をもって当該説明書を交付したものとみなす。）を除く。）し、これらの事項について十分説明し、理解させるものとする。

（確認書の徴求）

第12条 営業員は、選択権付債券売買取引の開始に当たっては、顧客の判断と責任において選択権付債券売買取引を行う旨の確認を得るため、当該顧客から確認書を徴求するものとする。

（売買証拠金預り証の交付）

第13条 当社は、取引相手方から売買証拠金を受け入れた場合には、当該取引相手方に対し、「証拠金」又は「代用証券等」の表示のある預り証を交付するものとする。

（売買残高限度額基準）

第14条 当社は、顧客のコール付与残高（コールの付与者となっている選択権付債券売買取引の額面金額の合計額）及びプット付与残高（プットの付与者となっている選択権付債券売買取引の額面金額の合計額）のうちいずれか大きい方の額から当該コール及びプットの付与残高に係る受取選択権料の合計額を控除した金額が別に定める売買残高限度額を超えない範囲内で当該顧客との間の選択権付債券売買取引を行うものとする。

2 顧客が選択権保有者となっている選択権付債券売買取引における一銘柄の売買額面の合計額は、当該銘柄の発行総額に照らして、過度にならないよう留意するものとする。

（選択権の行使の確認）

第15条 営業員は、顧客が選択権保有者となっている場合、当該顧客が行った選択権付債券売買取引の行使期間の最終日が近づいたときは、当該顧客から選択権の行使を行うか否かを確認するものとする。

（新規の選択権付債券売買取引の禁止）

第16条 当社は、別段の合意がある場合を除き、顧客が次の各号に該当する場合には、当該顧客との間で新規に選択権付債券売買取引を行わないものとする。

- 先の選択権付債券売買取引に係る受渡未済等、当社に立替金がある場合
- 売買証拠金が未入の場合
- 取引状況その他から不相当と認められる場合

(取引記録の作成及び保存)

第 17 条 約定が成立した場合には、担当部署において「選択権付債券売買取引に関する基本契約書に係る個別取引契約書」に記載する事項のほか、次の各号に掲げる事項を記載した伝票等(以下「取引連絡票」という。)を速やかに作成し、整理及び保存するものとする。

取引の成立した日時

取引の担当者名

取引を管理している責任者名

顧客が法人である場合、担当者の氏名

2 取引連絡票を作成するに当たっての前項第 1 号に規定する日時については、打刻処理により行うものとする。

(顧客との取引確認)

第 18 条 顧客との約定が成立した場合には、遅滞なく顧客と取引内容の確認を行うよう努めるものとする。

2 約定成立後、速やかにファクシミリ、テレックス等その他記録に残る方法により、顧客と取引内容の確認を行うよう努めるものとする。

(法定帳簿との関係)

第 19 条 取引連絡票については、「注文伝票」等の法定帳簿を補完するものであることから、注文伝票の作成をもってこれに代えることができるものとする。

2 取引連絡票が注文伝票に先行して作成される場合には、作成された注文伝票がどの取引連絡票に基づいたものであるかが明らかになるよう、整理及び保存するものとする。

(約定内容の補充及び変更等についての記録)

第 20 条 約定の内容の補充及び変更又は取消しが行われた場合には、次の各号に掲げる区分に従って、その理由が明確になるよう記録するものとする。

第 8 条の規定に従って、取引対象物件が特定された場合に「売買価格」等が計算された場合

第 9 条の規定に従って、「最終利回り」「スプレッド」等から「売買価格」等が計算された場合

その他の理由によって、約定の内容を変更又は取り消した場合

2 前項第 3 号に従って約定の内容を変更又は取り消した場合には、その都度、部長の承認を得るものとする。また、当該約定の内容の変更又は取消しの理由、顧客との交渉の経緯等を記録し、保存するものとする。

(売買残高等の照合)

第 21 条 当社は、選択権付債券売買取引を行っている取引相手方に対して、日本証券業協会の「有価証券の寄託の受入れ等に関する規則」の定める先物取引のある顧客の取扱いに準じて、売買残高、当社が受け入れている売買証拠金及び代用有価証券等の残高の照合を原則として年 2 回以上行うものとする。

(選択権付債券売買取引の売買管理)

第 22 条 当社の 部は、顧客の選択権付債券売買取引の売買残高、売買損益、売買証拠金、預り資産等の状況について、別に定める取扱内規によりの確に把握するとともに、部店を指導する等適正な管理を行うものとする。

(非居住者との取引)

第 23 条 非居住者との選択権付債券売買取引については、別に定めるところによる。

(権利行使後の取扱い)

第 24 条 権利行使後の公社債の店頭取引に係る取扱いについては、別に定める「公社債の店頭取引取扱規程」及び「外国証券取扱規程」によるものとする。

付 則

この規程は、平成 22 年 4 月 1 日から施行する。

1. 上記預り資産の金額は、各社が定める金額を御記入ください。
2. 上記注文の有効期間は、各社が定める日数を御記入ください。