

有価証券店頭デリバティブ取引等状況

<統計の目的>

協会が行う有価証券店頭デリバティブ取引等について、その取引等の規模を統計的に把握することにより、市場の透明性の向上や市場参加者の有用な情報の提供に資する等の観点から、有価証券店頭デリバティブの取引状況を公表しています。

<用語の定義>

- ・「有価証券店頭デリバティブ取引」とは、平成10年12月の「金融システム改革のための関係法律の整備等に関する法律」の施行により、「店頭デリバティブ取引」として全面解禁された、取引所外で行われるデリバティブ取引（例えば、株式、債券、株価指数、通貨、金利等を対象とした先渡取引、オプション取引、スワップ取引等）のうち、有価証券を原資産とするものをいいます。

なお、有価証券店頭デリバティブ取引等については、旧証券取引法上の認可業務でありましたが、平成19年9月の金融商品取引法の施行により、第一種金融商品取引業及び登録金融機関業務の登録を行った者であれば、有価証券店頭デリバティブ取引等を行うことができます。

- ・「有価証券先渡取引」とは、売買の当事者が将来の一定の時期において有価証券及びその対価の授受を約する売買であって、当該売買の目的となっている有価証券の売戻し又は買戻し等をしたときは差金の授受によって決済することができる取引をいいます。
- ・「有価証券店頭指数等先渡取引」とは、有価証券約定数値と有価証券現実数値の差に基づき算出される金銭の授受を約する取引又はこれに類似する取引をいいます。
- ・「有価証券店頭オプション取引」とは、当事者の一方の意思表示により当事者間において次に掲げる取引（有価証券の売買、有価証券先渡取引、有価証券店頭指数先渡取引、有価証券店頭指数等スワップ取引）を成立させることができる権利を相手方が当事者の一方に付与し、当事者の一方がこれに対して対価を支払うことを約する取引又はこれに類似する取引をいいます。
- ・「有価証券店頭指数等スワップ取引」とは、当事者が元本として定めた金額について当事者の一方が相手方と取り決めた有価証券の利率等若しくは有価証券指標の約定した期間における変化率に基づいて金銭を支払い、相手方が当事者の一方と取り決めた金利若しくは有価証券の利率等若しくは通貨の価格若しくは有価証券指標の約定した期間における変化率に基づいて金銭を支払うことを相互に約する取引又はこれに類似する取引をいいます。

<作成方法>

協会の本店、支店、その他の営業所における、毎年4月～9月及び10月～翌年3月に取り扱った、有価証券に係る店頭デリバティブ取引等の状況についての報告に基づき、集

計しています。

※特別会員については、登録金融機関業務に係る取扱いについてのみ報告を求めています。

<利用上の注意>

- ・取引金額及び期末残高は、想定元本ベースで集計しています（「想定元本」とは、報告基準日（3月末及び9月末）における未決済取引のグロス名目価値です。なお、想定元本が変動する商品については、基準日現在における想定元本額を集計しています）。また、倍数構造を有する派生商品取引の想定元本については、実質的な想定元本額に基づいて集計しています。
- ・外貨建てのものについては、報告基準日（3月末及び9月末）現在の為替レートにより、日本円に換算して集計しています。為替レートは「外国為替の取引等の報告に関する省令」第35条第2号に基づく為替レート（いわゆる報告省令レート）による換算又は協会員において実務上利用している社内レート（記帳レート）が市場レートに近い場合は、当該レートにより換算しています。
- ・選択権付債券売買取引を含みません。
- ・有価証券関連以外のデリバティブ取引（金利スワップ、通貨スワップ等）は集計対象外です。
- ・有価証券関連のCFD取引については、「有価証券店頭指数等先渡取引」の区分にて計上されています。

<公表時期>

原則として毎年4月及び10月の最終営業日に、本協会ホームページにて公表いたします。

<お問い合わせ先>

公社債・金融商品部市場統計業務室（TEL：03-6665-6774）

この解説資料は、本協会が提供している統計情報を一般の皆様が利用するに当たり、統計情報に用いられている用語等について理解を進めるための一助として分かりやすく説明したものであり、必ずしも法令・諸規則等における定義等に基づくものではありません。