

選定銘柄に係る売買参考統計値の発表開始日及び最終発表日の取扱いについて

平成 12 年 10 月 30 日制定
平成 21 年 3 月 10 日改正
日本証券業協会
公社債委員会

1. 目的

この取扱いは、「公社債の店頭売買の参考値等の発表及び売買値段に関する規則」(以下「規則」という。)及び「『公社債の店頭売買の参考値等の発表及び売買値段に関する規則』に関する細則」(以下「細則」という。)に基づき、選定銘柄に係る売買参考統計値の発表開始日及び最終発表日の取扱いに関して必要な事項を定める。

2. 用語の定義

この取扱いにおいて、次に掲げる用語の意義は、当該各号に定めるところによる。

選定銘柄	規則第 3 条第 2 項に規定する、公社債の店頭売買の参考となる銘柄として、同第 5 条第 2 項に基づき選定された銘柄をいう。
売買参考統計値	売買の参考として、指定報告協会員から報告を受けた気配(売り気配と買い気配の仲値)に基づき、本協会が算出する値(平均値、中央値、最高値、最低値)をいう。
指定報告協会員	規則第 3 条第 1 項に規定する、選定銘柄について本協会に気配を報告する者として本協会が指定する協会員をいう。
報告対象銘柄	規則第 5 条第 1 項に規定する、選定銘柄として本協会に気配を報告するために選択した銘柄をいう。

3. 発表開始日

細則第 3 条第 3 項に規定する選定銘柄に係る売買参考統計値の発表開始日の取扱いは、次のとおりとする。

(1) 新規発行銘柄

入札前国債

入札アナウンスメント日の翌営業日とする。

国債

イ. 分離元本振替国債及び分離利息振替国債

分離適格振替国債の発行日の翌営業日とする。

□．その他の銘柄

入札日の翌営業日とする。

地方債

発行日の翌営業日とする。

政府保証債

発行日の翌営業日とする。

財投機関債等

イ．固定利付かつ満期一括償還の銘柄

発行日の翌営業日とする。

□．その他の銘柄

指定報告協会員から特に気配報告の届出があった銘柄については、発行日の翌営業日とする。

金融債

イ．利付債

- ・ 募集債については、発行日の翌営業日とする。
- ・ その他の銘柄のうち、指定報告協会員から特に気配報告の届出があった銘柄については、発行日の翌営業日とする。

□．割引債

- ・ 前半債については、売出期間の最終日の翌営業日とする。
- ・ その他の銘柄のうち、指定報告協会員から特に気配報告の届出があった銘柄については、売出期間の最終日の翌営業日とする。

社債

イ．固定利付かつ満期一括償還の銘柄（分離募集型新株予約権付社債の社債部分を除く）

発行日の翌営業日とする。

□．その他の銘柄

指定報告協会員から特に気配報告の届出があった銘柄については、発行日の翌営業日とする。

特定社債

イ．固定利付かつ満期一括償還される銘柄で、発行額が100億円以上の銘柄

発行日の翌営業日とする。

□．その他の銘柄

指定報告協会員から特に気配報告の届出があった銘柄については、発行日の翌営業日とする。

円貨建外債

- イ．固定利付かつ満期一括償還される銘柄で、国際機関（アジア開発銀行、国際復興開発銀行、欧州投資銀行、米州開発銀行、アフリカ開発銀行の5発行体）が発行する銘柄及び国際機関以外の発行体が発行する発行額500億円以上の銘柄発行日の翌営業日とする。
- ロ．その他の銘柄
指定報告協会員から特に気配報告の届出があった銘柄については、発行日の翌営業日とする。

(2) 既発行銘柄

当該銘柄を報告対象銘柄とする指定報告協会員が、細則第3条第2項に規定する社数(5社)以上となる届出が提出された月の翌月の第1営業日とする。

4. 最終発表日

細則第3条第3項に規定する選定銘柄に係る売買参考統計値の最終発表日の取扱いは、次のとおりとする。

(1) 当該銘柄を報告対象銘柄とする指定報告協会員が細則第3条第2項に規定する社数(5社)以上存在する銘柄

入札前国債

入札日までとする。

国債

イ．国庫短期証券等

償還日の6営業日前までとする。

ロ．その他の国債

償還日の4営業日前までとする。

国債以外の銘柄

イ．割引金融債のうち選定される前半債

次月発行銘柄(前半債)の売出期間の最終日までとする。

ロ．その他の債券

原則として、償還月の前々月の最終営業日までとする。

(2) 当該銘柄を報告対象銘柄とする指定報告協会員が細則第4条第2項に規定する社数(5社)に満たないこととなる銘柄

当該銘柄を報告対象銘柄とする指定報告協会員が5社に満たないこととなる届出が提出された月の最終営業日までとする。

以 上

- (注) 平13. 3.12 改正、施行
- (注) 平13.12.14 改正
- 平14. 8. 5 施行
- (注) 平14. 9.12 改正
- 平14. 9.24 施行
- (注) 平14.12.20 改正
- 平15. 1. 6 施行
- (注) 平15.10.28 改正
- 平16. 2.23 施行
- (注) 平16. 1.13 改正
- 平16. 2.23 施行
- (注) 平17. 6.27 改正
- 平17. 8. 8 施行
- (注) 平18. 2. 2 改正
- 平18. 3.27 施行
- (注) 平19.10.18 改正、施行
- (注) 平20.12. 9 改正、施行
- (注) 平21. 3.10 改正
- 平21. 4. 6 施行

種 類	発表開始日	最終発表日
入札前国債 〔国庫短期証券等〕 〔利付国債(変動利付国債及び物価連動国債を含む。)]	入札アナウンスメント日の翌営業日 入札アナウンスメント日の翌営業日	入札日 入札日
国 債 〔国庫短期証券等〕 〔利付国債(変動利付国債及び物価連動国債を含む。)]	入札日の翌営業日 入札日の翌営業日	償還日の6営業日前 償還日の4営業日前
〔分離元本振替国債〕 〔分離利息振替国債〕	分離適格振替国債の発行日の翌営業日 分離適格振替国債の発行日の翌営業日	償還日の4営業日前 償還日の4営業日前
地 方 債 政府保証債 財投機関債等	発行日の翌営業日 発行日の翌営業日	償還月の前々月の最終営業日 償還月の前々月の最終営業日
〔財投機関債等〕 〔変動利付財投機関債等〕	発行日の翌営業日 発行日の翌営業日	償還月の前々月の最終営業日 償還月の前々月の最終営業日
金 融 債 〔利付募集債〕 〔割引債(前半債)]	発行日の翌営業日 売出期間の最終日の翌営業日	償還月の前々月の最終営業日 次月発行銘柄の売出期間の最終日
社 債 特定社債 円貨建外債 変動利付社債等	発行日の翌営業日 発行日の翌営業日 発行日の翌営業日	償還月の前々月の最終営業日 償還月の前々月の最終営業日 償還月の前々月の最終営業日
〔変動利付社債等〕 〔変動利付特定社債等〕 〔変動利付円貨建外債等〕	発行日の翌営業日 発行日の翌営業日 発行日の翌営業日	償還月の前々月の最終営業日 償還月の前々月の最終営業日 償還月の前々月の最終営業日