

国債証券等の買取等の価格設定に関する規程

【目的】

第1条 この規程は、国債証券等(国債に関する法律第2条の2の規定の適用を受ける「個人向け国債」を除く国債をいう。以下同じ。)の買取等の価格設定について必要な事項を定め、国債証券等の売買における価格形成を公正ならしめ、もって投資者の保護に資することを目的とする。

【この組合における基準となる時価】

第2条 この組合において国債証券等の買取等に当たり基準となる価格(以下「組合内時価」という。)は、日本証券業協会が発表する売買参考統計値の平均値とする。

② 日本証券業協会が売買参考統計値を発表しない銘柄については、BBレート等を組合内時価とする。

【買取等の取引価格】

第3条 国債証券等の買取等に当たり、組合内時価を基準として第4条に規定する買取値幅の範囲内において、対象銘柄の種類、市場環境、この組合が得るべき利益、銘柄固有の流動性及び信用リスク、取引金額の規模、課税・非課税の別等を考慮して取引価格を決定するものとする。

【買取値幅】

第4条 国債証券等の買取りについては、次の各号に掲げる区分に従い、当該各号に定める価格により、これを行うものとする。

- 1 償還まで1年を超える国債証券の額面500万円以下の買取りについては、組合内時価から別に定める金額を減じた額の範囲内の価格とする。
- 2 償還まで1年を超える国債証券の額面500万円超1,000万円未満の買取りについては、組合内時価から別に定める金額を減じた額の範囲内の価格とする。
- 3 償還まで1年を超える国債証券の額面1,000万円以上の買取りについては、組合内時価にその2パーセント相当額を加えた額と組合内時価からその2パーセント相当額を減じた額の範囲内の価格とする。
- 4 償還まで1年以内の国債証券の買取りについては、組合内時価から別に定める金額を減じた額の範囲内とし、円短期金利を参考に設定した価格とする。
- 5 政府保証債の買取りについては、組合内時価にその3パーセント相当額を加えた額と組合内時価からその3パーセント相当額を減じた額の範囲内の価格とする。
- 6 地方債の買取りについては、組合内時価にその4パーセント相当額を加えた額と組合内時価から、その4パーセント相当額を減じた額の範囲内の価格とする。

【買取値幅の特例】

第5条 次の各号のいずれかに該当する場合は、前条の規定にかかわらず、同条に規定する買取値幅を超える価格で、顧客と取引を行うことができるものとする。

- 1 金融商品取引所における国債証券先物取引の約定価格が、前日の終値又は当日の始値から上下1パーセント以上変動した場合、又は日本相互証券株式会社等における業者間取引において、同等とみなし得る大幅な価格の変動があった場合。

2 戦争、政変、発行体の倒産等個別銘柄の価格形成に著しい影響を与える事態が発生した場合。

【算定基礎資料の作成、保存】

第6条 第2条第2項及び前条に規定する取引を行ったときは、当該取引に係る約定価格の算定の基礎となった資料を作成し、整理、保存するものとする。

附 則

この規程は、令和6年2月1日から実施する。

「別紙」

第4条において「別に定める金額」とは、以下のとおりとする。

1. 償還まで1年を超える国債証券の額面500万円以下の買取り
100円につき40銭
2. 償還まで1年を超える国債証券の額面500万円超1,000万円未満の買取り
100円につき35銭
3. 償還まで1年以内の国債証券の買取り
100円につき40銭