

定型的電子フォーマットによる規制当局への報告についての海外の動き

1. 米国の状況

- (1) 米国では、証券取引法及び NASD 等の規則により、2001 年から、SEC、取引所、自主規制機関から要請があった場合には、Electronic Blue Sheets(EBS)という統一的な電子フォーマットにより、取引に関するデータを規制当局、取引所、自主規制機関に提出することとされている。
- (2) 提出することとされているデータは、取引日、決済日、注文量、金額、売買の別、空売りの有無、価格、証券会社のコード、顧客名と住所などである。

2. カナダの状況

- (1) カナダでは、証券当局と自主規制機関が共同で、TREATS(Transaction Reporting and Electronic Audit Trail System:取引報告・電子検査追跡システム)と呼ばれる制度を制定すべく作業を進めており、注文の記録保持と規制当局への提出は、2007 年 1 月 1 日以降(期日は延長の可能性あり)は、電子的フォーマットによることとされている。
- (2) 提出することとされているデータは、発注者の識別子、証券会社のコード、注文日、価格、数量、売買の別、空売りの有無、通貨の種類、内部者登録、などである。

3. EU の状況

- (1) EU では 2004 年に、EU に単一金融商品市場を作り出すとともに、統一的な投資者保護を定めることを目的として、Mifid(Markets in Financial Instruments Directive : 金融商品市場指令)が制定されている。
- (2) この技術的な実施手段を定めるための EU 指令・規則のドラフトが本年 2 月 6 日に公表されており、その中で、規制当局に対する取引データの報告は、電子フォーマットにより行うこととされ、この電子フォーマットは権限ある当局の求めるものでなければならないとされている(EU 規則 11 条)。
- (3) 提出することとされているデータは、証券会社のコード、注文日時、価格、数量、売買の別、空売りの有無、通貨の種類、などである。

(注 1) 報告された情報は EU25 カ国の規制当局で交換することが前提とされ、報告内容の詳細について定めている(EU 規則 12 条)。

(注 2) 当該 EU 指令・規則は、本年 7 月に EU 議会で採択され、2007 年 11 月に施行される予定となっている。