

発行日取引の売買証拠金の代用有価証券に関する規則

現物非清算参加者（取引参加者規程第24条第1項に規定する現物非清算参加者をいう。以下同じ。）が、清算・決済規程第17条第2項の規定に基づき、発行日取引の売買証拠金の代用として、指定現物清算参加者（清算・決済規程第5条に規定する指定現物清算参加者をいう。以下同じ。）に預託することができる有価証券の種類及びその代用価格は別表に定めるところによる。

付 則

本規則は、昭和60年12月2日から施行する。ただし、第4条第1項第13号の規定、同条第2項第4号の規定及び同条第3項の規定中同条第2項第4号に係る部分の規定は、昭和61年3月3日から施行する。

付 則

本規則は、昭和61年11月1日から施行する。ただし、第4条第1項及び第2項の規定は、本所が定める日から施行する。

（注）「本所が定める日」は昭和62年2月9日

付 則

この規則は、平成11年11月10日から施行し、この規則施行の日前に合併期日が到来した合併に係るものについては、なお従前の例による。

付 則

この規則は、特定目的会社による特定資産の流動化に関する法律等の一部を改正する法律（平成12年法律第97号）の施行の日から施行する。

(注) 「法律の施行の日」は平成12年11月30日

付 則

この規則は、平成13年4月1日から施行する。

なお、この改正規定は、施行期日を同じくする「組織変更に伴う定款等諸規則の一部改正等」の施行に次いで改正するものとする。

付 則

この規則は、平成14年2月4日から施行する。ただし、この改正規定施行前に発行日取引を開始した銘柄については、改正後の第2条及び第3条の規定にかかわらず、なお従前の例による。

付 則

この規則は、平成14年8月5日から施行する。

付 則

この規則は、平成15年1月14日から施行する。

付 則

この規則は、平成15年1月27日から施行する。

付 則

この規則は、平成15年4月1日から施行する。

付 則

この規則は、平成16年10月1日から施行する。

付 則

- 1 この規則は、本所の定める日から施行する。
- 2 この規則施行の日（以下「施行日」という。）の前日において日本証券業協会に登録されていた有価証券を施行日及び施行日の翌日に差し入れる場合における改正後の別表第2項の規定の適用は、施行日の前々日及び前日に日本証券業協会が公表した最終価格（午後3時現在における直近の売買価格）を各々の日における国内の証券取引所の売買立会における最終価格とみなす。

付 則

この規則は、平成18年1月10日から施行する。

付 則

- 1 この規則は、平成18年5月1日から施行する。
- 2 この規則施行の日前に募集の決議があった改正前の別表（注）に規定する転換社債型新株予約権付社債券については、改正後の別表（注）に規定する転換社債型新株予約権付社債券とみなして、改正後の規定を適用する。

付 則

この規則は、平成19年1月4日から施行する。

付 則

この規則は、平成19年5月21日から施行する。

付 則

この規則は、平成19年9月30日から施行する。

付 則

この規則は、平成25年1月1日から施行する。

付 則

この規則は、平成25年1月4日から施行する。

別表

代用有価証券の種類及びその代用価格等に関する表

- 1 有価証券の代用価格は、当該有価証券の預託日の前々日（休業日に当たるときは、順次繰り上げる。）における時価に本所の定める率を乗じた額とする。ただし、本所は、相場に著しい変動を生じた場合等特に必要があると認めた場合には、代用価格を変更することができる。
- 2 前項の有価証券の種類、時価及び本所の定める率は以下のとおりとする。

有価証券の種類	時 価	時価に乗すべき率	
国債証券	日本証券業協会が 売買参考統計値を 発表するもの	当該売買参考統計値の うち平均値	100分の95
	売買参考統計値が 発表されていない もののうち国内の 証券取引所におい て上場されている もの	金融商品取引所（注1） における最終価格（注 2）	
政府保証債券 金融商品取引 法施行令第2 条の11に定め る債券である 円貨債券（注 3）	日本証券業協会が 売買参考統計値を 発表するもの	当該売買参考統計値の うち平均値	100分の90
	売買参考統計値が 発表されていない もののうち国内の 金融商品取引所 において上場されて いるもの	金融商品取引所（注1） における最終価格（注 2）	
アメリカ合衆国財務省証券		ニューヨーク市場にお ける前日の最終の気配 相場	
地方債証券 （注3）	日本証券業協会が 売買参考統計値を 発表するもの	当該売買参考統計値の うち平均値	100分の85

<p>特殊債券（政府保証債券を除く。）</p> <p>社債券（新株予約権付社債券及び交換社債券を除く。）（注3）（注4）（注5）</p> <p>円貨建外国債券（金融商品取引法施行令第2条の11に定める債券である円貨債券，転換社債型新株予約権付社債券及び交換社債券を除く。）（注3）（注4）</p>	<p>売買参考統計値が発表されていないもののうち国内の金融商品取引所において上場されているもの</p>	<p>金融商品取引所（注1）における最終価格（注2）</p>	
<p>公社債投資信託の受益証券</p>	<p>投資証券のうち一般社団法人投資信託協会が前日の時価を発表するもの</p>	<p>当該時価</p>	
<p>転換社債型新株予約権付社債券（注3）（注5）</p> <p>交換社債券（注3）（注6）</p>	<p>国内の金融商品取引所に上場されているもの</p>	<p>金融商品取引所（注1）における最終価格（注2）</p>	<p>100分の80</p>
<p>株券</p> <p>優先出資証券（注7）</p>	<p>国内の金融商品取引所に上場されているもの</p>	<p>金融商品取引所（注1）における最終価格（注2）</p>	<p>100分の70</p>
<p>投資信託の受益証券（公社債投資信託の</p>	<p>国内の金融商品取引所に上場されているもの</p>	<p>金融商品取引所（注1）における最終価格（注2）</p>	

受益証券を除く。） 投資証券	一般社団法人投資信託協会が前日の時価を発表するもの	当該時価	
-------------------	---------------------------	------	--

- (注) 1 複数の金融商品取引所に上場している銘柄については、本所が定める順位により選択した金融商品取引所とする。
- 2 最終価格については、当該金融商品取引所において気配表示が行われている場合は当該最終気配値段をいう。
- 3 発行に際して元引受契約が金融商品取引業者により締結されたものに限る。
- 4 転換社債型新株予約権付社債券とは、業務規程第2条第1項第2号に規定する転換社債型新株予約権付社債券をいう。
- 5 社債券（新株予約権付社債券及び交換社債券を除く。）及び転換社債型新株予約権付社債券については、国内の金融商品取引所にその株券が上場されている会社が発行するものに限る。
- 6 交換社債券とは、社債券（外国法人により発行されるものを含む。）であって、それを保有する者の請求により発行者以外の特定の会社の株券により償還されるものをいう。
- 7 優先出資証券とは、協同組織金融機関の発行する優先出資証券をいう。
- 3 前項の規定における本所が定める順位は、第一順位は、本所とし、それ以降は、取引所・業界団体等コード（証券コード協議会の定めるものをいう。）の順序とする。ただし、国債証券にあつては、取引所・業界団体等コード（証券コード協議会の定めるものをいう。）の順序とする。
- 4 代用価格の端数金額の調整は次のとおりとする。
- (1) 内国法人の発行する株券、優先出資証券、投資信託の受益証券及び投資証券については、円位未満の端数金額は、これを切り捨てる。
- (2) 前号に規定する有価証券以外の有価証券については、銭位未満の

端数金額は，これを切り捨てる。

- 5 現物非清算参加者が第2項に規定する債券（転換社債型新株予約権付社債券及び交換社債券を除く。）又は投資信託の受益証券（国内の金融商品取引所に上場されているものを除く。）を指定現物清算参加者に預託する場合には，社債等の振替に関する法律（平成13年法律第75号）に基づき日本銀行に開設された本所名義の口座への振替により当該預託を行うものとし，当該預託を行うときは，あらかじめ指定現物清算参加者の同意を得るものとする。
- 6 現物非清算参加者が次の各号に掲げる有価証券を指定現物清算参加者に預託する場合には，株式会社証券保管振替機構に開設された本所名義の口座への振替により当該預託を行うものとし，当該預託を行うときは，あらかじめ指定現物清算参加者の同意を得るものとする。
 - (1) 転換社債型新株予約権付社債券，内国法人の発行する株券及び優先出資証券
 - (2) 投資信託の受益証券（公社債投資信託の受益証券を除く。）及び投資証券のうち国内の金融商品取引所に上場されているもの
- 7 現物非清算参加者が，第2項に規定するアメリカ合衆国財務省証券を指定現物清算参加者に預託する場合には，預託の都度，指定現物清算参加者の同意を得るものとする。
- 8 第2項の規定にかかわらず，商号変更の場合において同第11条の規定により決済物件として認められることとなった商号変更前の株券は，決済物件として認められている期間に限り，取引証拠金の代用有価証

券につき、株券に代わるものとして取り扱う。

- 9 前項の規定は、株式会社日本証券クリアリング機構（以下「クリアリング機構」という。）又は国内の他の金融商品取引所の規則により、クリアリング機構又は当該金融商品取引所において決済物件として認められている被合併会社株券及び商号変更前の株券について準用する。
- 10 第2項の規定にかかわらず、国内の金融商品取引所に上場されている株券（優先出資証券、投資信託の受益証券及び投資証券を含む。以下この項及び次項において同じ。）が、その上場されている国内のすべての金融商品取引所において、当該金融商品取引所の定める上場廃止の基準に該当した場合（次の各号に定める場合を除く。）には、該当した日の翌日（休業日に当たるときは、順次繰り下げる。以下同じ。）から、当該株券及び当該株券（投資信託の受益証券を除く。）の発行者が発行する社債券を、代用有価証券から除外する。
- (1) 当該株券の発行者が株式交換又は株式移転により国内の金融商品取引所の上場会社の完全子会社となる場合
 - (2) 当該株券の発行者が国内の金融商品取引所の上場会社に吸収合併される場合
 - (3) その他当該株券が上場廃止となる場合であって、当該株券と引換えに交付される株券が国内の金融商品取引所に速やかに上場される見込みがあるとき
- 11 前項の規定は、債券の発行者が当該債券の期限の利益を喪失した場合の当該債券について準用する。

清算・決済規程施行規則

(目的)

第1条 この規則は、清算・決済規程（以下「規程」という。）に基づき、本所が定める事項について規定する。

第2条から第5条まで 削除

(現物非清算参加者の決済の繰延べの取扱い)

第6条 現物非清算参加者である取引参加者は、クリアリング機構の業務方法書に規定するDVP決済の対象となる取引に係る有価証券の引渡しについて、クリアリング機構が必要と認めて証券決済未了を発生させてはならないと定める日においては、規程第12条に規定する繰延べを行うことができない。

2 現物非清算参加者である取引参加者が前項に規定する取引以外の取引に係る有価証券の引渡しの繰延べを行った場合における当該繰延べに係る有価証券の引渡しは、当該有価証券の引渡しを繰り延べた日から起算して5日目（休業日（業務規程第3条第1項に規定する休業日をいい、同条第2項に規定する臨時休業日を含む。以下同じ。）を除外する。以下日数計算について同じ。）の日（以下この条において「繰延べに係る有価証券の引渡し期限」という。）までに行うものとする。ただし、当該有価証券の引渡しを繰り延べた日から繰延べに係る有価証券の引渡し期限までの間に次の各号に掲げる日が到来する場合の当該繰延べに係る有価証券の引渡しは、指定現物清算参

加者の承諾を受けたときを除き，当該各号に掲げる日の前日（休業日に当たるときは，順次繰り上げる。以下同じ。）までに行わなければならない。

- (1) 株主（優先出資者，受益者及び投資主を含む。）を確定するための基準日等の日
- (2) 種類株（業務規程第25条に規定する種類株をいう。）の発行者の定める取得対価の変更（取得請求期間の中断を含む。）が行われる日の前日（当該前日に株式会社証券保管振替機構（以下「保管振替機構」という。）において取得請求の取次ぎが停止されているときは，変更前の条件での取得請求が可能な期間の最終日），外国株預託証券に係る預託機関の定める表示株式数の変更が行われる日（当該預託機関により，外国株預託証券と当該外国株預託証券に表示される権利に係る外国株券との交換が停止又は制限される期間が設けられる場合にあっては，当該期間の開始日）の前日（当該日以外の日を別に定める必要があると本所が認めるときは，本所がその都度指定する日）及び転換社債型新株予約権付社債券の発行者の定める行使条件の変更（行使期間の中断を含む。）が行われる日の前日（当該前日に保管振替機構において行使請求の取次ぎが停止されているときは，変更前の行使条件での行使請求が可能な期間の最終日）
- (3) 期中償還請求権が付されている転換社債型新株予約権付社債券及び交換社債券の期中償還請求期間満了の日
- (4) 投資信託受益証券について，保管振替機構において受益者登録請求の取次ぎが行われる場合の当該受益者を確定するための期日

(5) 受益証券発行信託の受益証券について、保管振替機構において受益者の報告が行われる場合の当該受益者を確定するための期日

(6) 利付債券（国債証券を除く。）の利払期日の前日

- 3 現物非清算参加者である現物取引参加者は、規程第19条の規定により国債証券の引渡しを繰り延べた場合は、決済日から起算して5日目の日までの日（決済日から起算して5日目の日が当該国債証券の利払期日前3日間（銀行休業日を除外する。）のいずれかの日に当たる場合にあっては、当該利払期日の3日前（銀行休業日を除外する。）の日の前日までの日又は当該利払期日（休業日に当たる場合は、順次繰り下げる。）のいずれかの日）（休業日を除く。）に当該国債証券の引渡しを行わなければならない。

（売買証拠金の額）

- 第7条 規程第17条第1項に規定する売買証拠金の額は、クリアリング機構が定める売買証拠金基準値段に100分の10を乗じて算出した額（円位未満の端数金額は、これを1円に切り上げる。）以上の額とする。

（先物・オプション取引に係る転売又は買戻しの申告時限）

- 第8条 規程第20条第1項、第25条第1項並びに第32条第1項に規定する転売又は買戻しの申告は、当該転売又は買戻しが成立した取引日の終了する日において午後5時までに行うものとする。

(オプション取引に係る権利行使の申告時限)

第9条 規程第27条第1項及び第34条第1項に規定する権利行使の申告は、権利行使日において午後5時までに行うものとする。

(取引所FX取引に係る建玉の申告時限)

第10条 規程第36条の2第1項に規定する取引所FX取引に係る建玉の申告は、当該取引日の終了する日(休業日(取引所FX取引特例第6条第1項に規定する休業日をいい、同条第2項に規定する臨時休業日を含む。))に当たるときは、順次繰り下げる。)の午前10時までに行うものとする。

2 前項の規定にかかわらず、本所は、必要があると認めるときは、同項の申告時限を臨時に変更することができるものとする。この場合においては、あらかじめその旨をFX非清算参加者に通知する。

付 則

- 1 この規則は、平成15年1月14日から施行する。
- 2 この規則施行の際現に発行されている有価証券引渡票に係る貸借の決済については、なお従前の例による。

付 則

この規則は、平成15年4月2日から施行する。

付 則

この規則は、平成16年2月2日から施行する。

付 則

この規則は、平成16年5月6日から施行する。

付 則

この規程は、平成17年4月1日から施行する。

付 則

この規則は、平成18年1月10日から施行する。

付 則

この規則は、平成18年2月27日から施行する。

付 則

- 1 この規則は、平成18年4月1日から施行する。
- 2 前項の規定にかかわらず、本所が指定する銘柄に関するこの規則の適用については、本所が銘柄ごとに定める日までは、なお従前の例による。

付 則

この規則は、平成18年5月1日から施行する。

付 則

この規則は、平成19年9月18日から施行する。

付 則

- 1 この規則は、平成20年1月4日から施行する。ただし、第6条第2項第5号及び第6号の規定は、平成19年12月14日から施行する。
- 2 この改正規定施行の際、現に本所に上場されている投資信託受益証券については、平成20年1月4日を決済日とする売買から改正後の規定を適用する。

付 則

この規則は、平成20年4月14日から施行する。

付 則

- 1 この規則は、平成21年1月5日から施行する。

2 この規則施行の際，現に本所に上場されている新株予約権証券の売買に係る清算及び決済については，なお従前の例による。

付 則

この規則は，平成21年6月16日から施行する。

付 則

この規則は，平成21年12月30日から施行する。

付 則

この規則は，平成22年4月1日から施行する。

付 則

この規則は，平成22年10月12日から施行する。

付 則

この規則は，平成25年1月1日から施行する。