

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。

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	時価に乘すべき率	
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

特殊債券（政府保証債券を除く。） 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)	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）	
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)			
公社債投資信託の受益証券	投資証券のうち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	
転換社債型新株予約権付社債券（注3） (注5) 交換社債券 (注3) (注6)	国内の金融商品取引所に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）	100分の80
株券 優先出資証券 (注7)	国内の金融商品取引所に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）	100分の70
投資信託の受益証券（公社債投資信託の	国内の金融商品取引所に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）	

受益証券を除く。) 投資証券	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、国債証券にあっては、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
- 5 現物非清算参加者が第2項に規定する国債証券を指定現物清算参加者に差し入れる場合においては、本券のほか振決国債（日本銀行が定める日本銀行国債振替決済業務規程に基づく国債振替決済制度において取り扱う国債証券をいう。以下同じ。）を差し入れができるものとし、振決国債を差し入れるときには、差入れの都度、指定現物清算参加者の同意を得るものとする。
- 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。