

円位未満の呼値の単位が定められる株券に係るDVP清算値段及び代用有価証券の時価等の取扱いの改正について

平成26年6月25日
株式会社日本証券クリアリング機構

項目	概要	備考
I. 趣旨	<ul style="list-style-type: none"> 当社は、株式会社東京証券取引所及び株式会社名古屋証券取引所において平成26年7月22日より一部上場銘柄について1円未満の呼値の単位が発生することから、同日以降のDVP清算値段及び代用有価証券の時価等について、関係機関等におけるシステム対応状況等を踏まえ、1円未満の数值を切り捨てる取扱いとする旨の規則改正を実施いたしますが、平成25年9月25日付制度要綱¹の備考欄に記載のとおり、平成27年度中を目途として1円未満の数值をDVP清算値段及び代用有価証券の時価等に採用すべく、所要の制度改正を行うこととします。 	
II. 改正の概要等 1. DVP清算値段 2. バイイン実行の際の売付申込値段の基	<ul style="list-style-type: none"> DVP清算値段は、指定金融商品市場における前営業日の最終値段（気配表示された最終気配値段を含む。）とする。（<u>1円未満の数值の切り捨ては行わない。</u>） 前営業日において指定金融商品市場のいずれにおいても約定値段（気配表示された最終気配値段を含む。）がない場合は、指定金融商品市場における当該前営業日の基準値段をDVP清算値段とする。（<u>1円未満の数值の切り捨ては行わない。</u>） バイイン実行の際の売付申込値段の基準価格は、原則として指定金融商品市場におけるバイイン実行日における最終値段（気配表示された最終気配値段 	<ul style="list-style-type: none"> DVP清算値段を用いて算出する現物清算資格に係る清算基金所要額及びフェイル発生時の遅延損害金・遅延違約金についても左記と同様の取扱いとする。 バイイン実行日において最終値段がないとき又はバイイン実行日がバ

¹ 平成25年9月25日付制度要綱「(株)東京証券取引所の現物立会市場における呼値の単位の段階的な適正化に伴う制度改正について」

項 目	概 要	備 考
<p>準価格</p> <p>3. 取引証拠金及び清算預託金の代用有価証券の時価</p> <p>Ⅲ. 実施時期</p>	<p>を含む。)とする。(1円未満の数値の切り捨ては行わない。)</p> <p>・取引証拠金及び清算預託金の代用有価証券として当社に預託される株券等の代用価格を算出する際の時価は、金融商品取引所における最終値段(気配表示が行われている場合には最終気配値段。)とする。(1円未満の数値の切り捨ては行わない。)</p> <p>・平成27年10月13日を目途に実施する。</p>	<p>イイン対象銘柄の基準日等の日の2営業日前若しくは前営業日にあたる時は、当社がその都度定める値段とする。</p> <p>・なお、当該時価に当社が定める率(掛目)を乗じて導出される代用価格については、従前どおり1円未満を切り捨てるものとする。</p> <p>・日本銀行における新日銀ネットの稼働時期と同時期を目途とする。</p>

以 上