

株式等の決済期間の短縮化に伴う「業務方法書」等の一部改正について

I. 改正趣旨

株式等の決済期間の短縮化に伴い、業務方法書等について、別紙のとおり所要の改正を行う。

II. 改正概要

- | | (備 考) |
|---|--|
| 1. 証券決済未了の制限日（フェイル禁止日）の変更 | |
| ・いずれの金融商品取引所においても上場廃止となった銘柄について、上場廃止日の前日から起算して3営業日目の日を証券決済未了の制限日（フェイル禁止日）とする。 | ・証券決済未了の場合及びバイインの取扱いに関する規則第2条 |
| 2. 証券決済未了（フェイル）に係る遅延損害金の算出方法の変更 | |
| ・証券決済未了（フェイル）に係る遅延損害金の算出方法について、現行の営業日ベースのカウント方法から、暦日ベースでのカウント方法に変更する。 | ・証券決済未了の場合及びバイインの取扱いに関する規則第3条、有価証券引渡票に関する規則第5条 |
| 3. バイイン実行タイミングの前倒し | |
| ・バイインの実行タイミングについて、現行から1営業日前倒しし、バイイン請求日から起算して3日目の日にバイイン実行を行うものとする。 | ・証券決済未了の場合及びバイインの取扱いに関する規則第13条、14条、15条 |
| 4. 有価証券引渡票に係る有価証券の貸借の決済期限 | |
| ・有価証券引渡票（Due Bill）に係る有価証券の貸借の決済は、原則として有価証券引渡票発行の日から起算して4日目の日までに行うものとする。 | ・業務方法書第64条 |

5. 銘柄別受方参加者順位劣後化申告の導入

- ・清算参加者は、当社から受領予定の証券決済数量（バイインの請求済みの数量を除く）が存在する銘柄について、銘柄別受方参加者順位を劣後させても差し支えない数量を当社に申告することができるものとする。
- ・銘柄別受方参加者順位劣後化申告を行う参加者は、あらかじめ、当社の定める事項を記入した書面を当社に提出することによりスキーム利用開始の申請を当社に行い、当社の承認を得るものとする。
- ・銘柄別受方参加者順位劣後化申告が行われた受領予定の証券決済数量に対し、証券決済未了（フェイル）が割り当てられた場合、当社は、当該証券決済未了（フェイル）に係る受方参加者に対して、フェイル金額（その日のDVP清算値段に当該証券決済未了数量を乗じた額）100円につき3銭の遅延損害金（通常の遅延損害金4銭に替えて3銭）を支払うこととする。

・業務方法書の取扱い第14条

・証券決済未了の場合及びバイインの取扱いに関する規則第3条

6. その他

- ・権利確定日における証券決済未了（フェイル）発生時において、証券決済未了渡方清算参加者と当社が指定する証券決済未了受方清算参加者は、配当金、権利等に係る取扱いについて、協議を行い、当社の定める指針を尊重して配当金、権利等に係る調整処理を行うよう努めるものとする。

・証券決済未了の場合及びバイインの取扱いに関する規則第5条

II. 施行日

2019年7月16日から施行する。

※ただし、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社が設置するシステムの稼働に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、2019年7月16日から施行することが適当でないと当社が認める場合には、同日以後の当社が定める日から施行する。

以 上

株式等の決済期間の短縮化に伴う関連諸規則の一部改正について

目 次

	(ページ)
1 業務方法書の一部改正新旧対照表	2
2 業務方法書の取扱いの一部改正新旧対照表	3
3 証券決済未了の場合及びバイインの取扱いに関する規則の一部改正新旧対照表	5
4 有価証券引渡票に関する規則の一部改正新旧対照表	10

業務方法書の一部改正新旧対照表

新	旧
<p>(有価証券引渡票による決済)</p> <p>第64条 (略)</p> <p>2 (略)</p> <p>3 有価証券引渡票に係る有価証券の貸借の決済は、有価証券引渡票発行の日から起算して<u>4日目</u>の日(以下この条において「有価証券引渡票に係る有価証券の貸借の決済期限」という。)までに行うものとする。ただし、当該有価証券引渡票発行の日から有価証券引渡票に係る有価証券の貸借の決済期限までの間に次の各号に掲げる日が到来する場合の有価証券引渡票に係る有価証券の貸借の決済は、有価証券引渡票受方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(当該各号に掲げる日が休業日に当たるときは2日前の日)までに行わなければならない。</p> <p>(1)～(6) (略)</p> <p>4・5 (略)</p> <p style="text-align: center;">付 則</p> <p>1 この改正規定は、平成31年7月16日から施行し、この改正規定施行の日以後に発行される有価証券引渡票に係る有価証券の貸借の決済から適用する。</p> <p>2 前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社が設置するシステムの稼動に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、改正後の規定を適用することが適当でない当社が認める場合には、平成31年7月16日以後の当社が定める日から施行する。</p>	<p>(有価証券引渡票による決済)</p> <p>第64条 (略)</p> <p>2 (略)</p> <p>3 有価証券引渡票に係る有価証券の貸借の決済は、有価証券引渡票発行の日から起算して<u>5日目</u>の日(以下この条において「有価証券引渡票に係る有価証券の貸借の決済期限」という。)までに行うものとする。ただし、当該有価証券引渡票発行の日から有価証券引渡票に係る有価証券の貸借の決済期限までの間に次の各号に掲げる日が到来する場合の有価証券引渡票に係る有価証券の貸借の決済は、有価証券引渡票受方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(当該各号に掲げる日が休業日に当たるときは2日前の日)までに行わなければならない。</p> <p>(1)～(6) (略)</p> <p>4・5 (略)</p>

業務方法書の取扱いの一部改正新旧対照表

新	旧
<p><u>(有価証券の引渡しの順位の劣後化申告)</u></p> <p><u>第14条 受方現物清算参加者は、前条に規定する当社から受方現物清算参加者への有価証券の引渡しの数量（証券決済未了の場合及びバイインの取扱いに関する規則第10条に規定するバイインの請求が行われている数量を除く。）のうち、引渡しの順位を最下位に設定しても差し支えない数量を当社が定める方法により銘柄ごとに当社に申告することができる。</u></p> <p><u>2 前項に規定する申告が行われた場合、当社は、前条の規定にかかわらず、当該申告が行われた銘柄及び数量に係る引渡しの順位を最下位に設定することとする。ただし、決済日及び銘柄を同一とする申告が複数の受方現物清算参加者から行われた場合における当該受方現物清算参加者間の当該申告が行われた銘柄及び数量に係る引渡しの順位については、当社が定めるところによるものとする。</u></p> <p><u>3 現物清算参加者は、第1項に規定する申告を行おうとする場合には、あらかじめ、当社所定の申請書に当社が必要と認める書類を添付して当社に申請し、当社の承認を得るものとする。</u></p> <p style="text-align: center;">付 則</p> <p>1 この改正規定は、平成31年7月16日から施行する。</p> <p>2 前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社が設置するシステムの稼動に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、改正後の規定を適用することが適当でない当社が認める場合には、平成31年7月16日以後の当社が定める日から施</p>	<p><u>第14条 削除</u></p>

行する。

証券決済未了の場合及びバイインの取扱いに関する規則の一部改正新旧対照表

新	旧
<p>(証券決済未了の制限)</p> <p>第2条 業務方法書第62条の2第1項に規定する当社が必要と認めて定める日は、次の各号に掲げる日とする。</p> <p>(1) いずれの金融商品取引所(指定市場開設者であるものに限る。)においても上場廃止となった銘柄(同時に他の指定金融商品市場に上場する場合を除く。)について、上場廃止の日の前日から起算して<u>3日目</u>の日(休業日を除外する。以下日数計算について同じ。)。ただし、当該銘柄のうち転換社債型新株予約権付社債券について、当該<u>3日目</u>の日が業務方法書第64条第3項第2号から第4号までに掲げる日に当たる場合には<u>4日目</u>の日とし、次のa又はbに定める場合には<u>5日目</u>の日とする。</p> <p>a 上場廃止の日の前日から起算して<u>3日目</u>の日が、業務方法書第64条第3項第2号又は第3号に定める日の前日であって、かつ、同項第4号に定める日に当たる場合</p> <p>b 上場廃止の日の前日から起算して<u>3日目</u>の日が、業務方法書第64条第3項第2号又は第3号に定める日に当たり、かつ、その翌日が同項第4号に定める日に当たる場合</p> <p>(2)～(4) (略)</p> <p>2 (略)</p>	<p>(証券決済未了の制限)</p> <p>第2条 業務方法書第62条の2第1項に規定する当社が必要と認めて定める日は、次の各号に掲げる日とする。</p> <p>(1) いずれの金融商品取引所(指定市場開設者であるものに限る。)においても上場廃止となった銘柄(同時に他の指定金融商品市場に上場する場合を除く。)について、上場廃止の日の前日から起算して<u>4日目</u>の日(休業日を除外する。以下日数計算について同じ。)。ただし、当該銘柄のうち転換社債型新株予約権付社債券について、当該<u>4日目</u>の日が業務方法書第64条第3項第2号から第4号までに掲げる日に当たる場合には<u>5日目</u>の日とし、次のa又はbに定める場合には<u>6日目</u>の日とする。</p> <p>a 上場廃止の日の前日から起算して<u>4日目</u>の日が、業務方法書第64条第3項第2号又は第3号に定める日の前日であって、かつ、同項第4号に定める日に当たる場合</p> <p>b 上場廃止の日の前日から起算して<u>4日目</u>の日が業務方法書第64条第3項第2号又は第3号に定める日に当たり、かつ、その翌日が同項第4号に定める日に当たる場合</p> <p>(2)～(4) (略)</p> <p>2 (略)</p>
<p>(遅延損害金の授受)</p> <p>第3条 証券決済未了に係る渡方現物清算参加者(以下「証券決済未了渡方清算参加者」という。)は、証券決済未了の場合、その日のDVP清算値段に証券決済未了に係る有価証券の数量を乗じた額(当該日<u>が休業日の前日に当たる場合は、当該日の</u></p>	<p>(遅延損害金の授受)</p> <p>第3条 証券決済未了に係る渡方現物清算参加者(以下「証券決済未了渡方清算参加者」という。)は、証券決済未了の場合、その日のDVP清算値段に証券決済未了に係る有価証券の数量を乗じた額100円につき4銭の遅延損害金を当社に支払</p>

DVP清算値段に証券決済未了に係る有価証券の数量を乗じた額に、当該日の翌日までの休業日の日数に1を加えた数を乗じた額 100円につき4銭の遅延損害金を当社に支払わなければならない。

2 証券決済未了渡方清算参加者は、利付轉換社債型新株予約権付社債券について、業務方法書第64条第3項第4号に定める日の前日における証券決済未了の場合、前項の規定による遅延損害金に加え、当該定める日におけるDVP清算値段に証券決済未了に係る有価証券の数量を乗じた額（当該日が休業日の前日に当たる場合は、当該日のDVP清算値段に証券決済未了に係る有価証券の数量を乗じた額に、当該日の翌日までの休業日の日数に1を加えた数を乗じた額）100円につき4銭の遅延損害金を当社に支払わなければならない。

3 当社は、前2項の規定により受領した遅延損害金を、証券決済未了に係る受方現物清算参加者（以下「証券決済未了受方清算参加者」という。）に交付する。ただし、当該証券決済未了受方清算参加者が、業務方法書の取扱い第14条の規定に基づく申告を証券決済未了に係る有価証券の銘柄について行っていた場合においては、当社は、当該申告に係る数量（証券決済未了に係る数量に限る。）について、前2項の規定により受領した遅延損害金の4分の3に相当する額の金銭を、当該証券決済未了受方清算参加者に交付する。

4 （略）

（配当金又は権利の引渡通知書）

第5条 業務方法書第64条第3項第1号に定める日（休業日に当たるときは、順次繰り上げる。）において、証券決済未了により決済を繰り延べた場合には、証券決済未了渡方清算参加者と当社が指定する証券決済未了受方清算参加者は、配当金、権

わなければならない。

2 証券決済未了渡方清算参加者は、利付轉換社債型新株予約権付社債券について、業務方法書第64条第3項第4号に定める日の前日における証券決済未了の場合、前項の規定による遅延損害金に加え、当該定める日におけるDVP清算値段に証券決済未了に係る有価証券の数量を乗じた額 100円につき4銭の遅延損害金を当社に支払わなければならない。

3 当社は、前2項の規定により受領した遅延損害金を、証券決済未了に係る受方現物清算参加者（以下「証券決済未了受方清算参加者」という。）に交付する。

4 （略）

（配当金又は権利の引渡通知書）

第5条 業務方法書第64条第3項第1号に定める日（休業日に当たるときは、順次繰り上げる。）において、証券決済未了により決済を繰り延べた場合には、証券決済未了渡方清算参加者と当社が指定する証券決済未了受方清算参加者は、配当金、権

利等に係る取扱いについて、協議を行い、当社の定める指針を尊重して配当金、権利等に係る調整処理を行うよう努めるものとする。この場合においては、当該証券決済未了渡方清算参加者は、所定の「配当金・権利等引渡通知書」を当該証券決済未了受方清算参加者に交付するものとする。

2 (略)

(バイインの請求の取下げ)

第13条 証券決済未了受方清算参加者は、バイインの請求日から起算して4日目の日以降は、当該請求を取り下げることができる。この場合において、当該請求の取下げはバイインの請求日の早いものから順に行うものとし、請求日を同一とする請求についてはそのすべてを取り下げるものとする。

2・3 (略)

(バイインによる売買の買方現物清算参加者の指定及び買付申込み)

第14条 証券決済未了受方清算参加者がバイインの請求を行った場合において、当該請求日から起算して3日目の日のDVP決済に係る決済時限を超えてもなお当該証券決済未了受方清算参加者の決済が繰り延べられている場合には、当社は、当該請求が行われた時点以前において証券決済未了渡方清算参加者となっていた現物清算参加者のうちから、バイインの買付けを行うべき現物清算参加者を指定する。この場合においては、当該現物清算参加者は、当該指定の日に当社が指定する数量について自己の計算においてバイインの買付けの申込みを行ったものとみなす。

2・3 (略)

(バイインによる売買の売付申込み)

第15条 バイインの買付けに対する売付けの申込みは、現物清算参加者が、次の各

利等に係る取扱いについて、協議するものとする。この場合においては、当該証券決済未了渡方清算参加者は、所定の「配当金・権利等引渡通知書」を当該証券決済未了受方清算参加者に交付するものとする。

2 (略)

(バイインの請求の取下げ)

第13条 証券決済未了受方清算参加者は、バイインの請求日から起算して5日目の日以降は、当該請求を取り下げることができる。この場合において、当該請求の取下げはバイインの請求日の早いものから順に行うものとし、請求日を同一とする請求についてはそのすべてを取り下げるものとする。

2・3 (略)

(バイインによる売買の買方現物清算参加者の指定及び買付申込み)

第14条 証券決済未了受方清算参加者がバイインの請求を行った場合において、当該請求日から起算して4日目の日のDVP決済に係る決済時限を超えてもなお当該証券決済未了受方清算参加者の決済が繰り延べられている場合には、当社は、当該請求が行われた時点以前において証券決済未了渡方清算参加者となっていた現物清算参加者のうちから、バイインの買付けを行うべき現物清算参加者を指定する。この場合においては、当該現物清算参加者は、当該指定の日に当社が指定する数量について自己の計算においてバイインの買付けの申込みを行ったものとみなす。

2・3 (略)

(バイインによる売買の売付申込み)

第15条 バイインの買付けに対する売付けの申込みは、現物清算参加者が、次の各

号に定めるところにより行うものとする。

(1)～(4) (略)

(5) 売付申込値段の制限

売付申込値段は、バイインによる売買を行う日の一定の順位により選択された指定金融商品市場（取引所金融商品市場に限る。）における最終値段（指定市場開設者の定める気配表示が行われているときは、当該最終気配値段を含み、当該バイインを行う日に最終値段（当該最終気配値段を含む。）がないとき又は業務方法書第64条第3項各号（第4号を除く。）に掲げる日の前日においては当社がその都度定める値段とする。）と当該値段からその10%相当額を加えた値段の範囲内の値段とする。ただし、当社は、必要があると認めるときは、当該売付申込値段の範囲を臨時に変更することができる。

2 (略)

付 則

- 1 この改正規定は、平成31年7月16日から施行する。ただし、第3条第1項及び第2項の改正規定は、同月1日から施行する。
- 2 改正後の第2条第1項第1号の規定は、平成31年7月17日以後に第2条に規定するいずれの金融商品取引所においても上場廃止となった銘柄から適用する。
- 3 改正後の第13条から第15条までの規定は、この改正規定施行の日以後に行われるバイインの請求から適用する。
- 4 前3項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社が設置するシステムの稼動に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、改正後の規定を適用することが適当でない当社が認める場合には、平成31年7月16日以後の当社が定め

号に定めるところにより行うものとする。

(1)～(4) (略)

(5) 売付申込値段の制限

売付申込値段は、バイインによる売買を行う日の一定の順位により選択された指定金融商品市場（取引所金融商品市場に限る。）における最終値段（指定市場開設者の定める気配表示が行われているときは、当該最終気配値段を含み、当該バイインを行う日に最終値段（当該最終気配値段を含む。）がないとき又は業務方法書第64条第3項各号（第4号を除く。）に掲げる日の2日前若しくは前日においては当社がその都度定める値段とする。）と当該値段からその10%相当額を加えた値段の範囲内の値段とする。ただし、当社は、必要があると認めるときは、当該売付申込値段の範囲を臨時に変更することができる。

2 (略)

る日から施行する。

有価証券引渡票に関する規則の一部改正新旧対照表

新	旧
<p>(品借料の徴収)</p> <p>第5条 (略)</p> <p>2 (略)</p> <p>3 品借料の計算期間は、有価証券引渡票の発行の日の翌日から当該有価証券引渡票に係る有価証券の貸借の決済を履行する日まで(休業日を含む。)とする。ただし、渡方現物清算参加者が有価証券引渡票を発行した日のうちに当該有価証券の貸借の決済を履行した場合は、品借料は1日分として計算する。</p> <p style="text-align: center;">付 則</p> <p>1 この改正規定は、平成31年7月16日から施行し、この改正規定施行の日以後に発行される有価証券引渡票から適用する。</p> <p>2 前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者との間の決済を行うために必要な当社が設置するシステムの稼働に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、改正後の規定を適用することが適当でない当社が認める場合には、平成31年7月16日以後の当社が定める日から施行する。</p>	<p>(品借料の徴収)</p> <p>第5条 (略)</p> <p>2 (略)</p> <p>3 品借料の計算期間は、有価証券引渡票の発行の日の翌日から当該有価証券引渡票に係る有価証券の貸借の決済を履行する日まで(休業日を除外する。)とする。ただし、渡方現物清算参加者が有価証券引渡票を発行した日のうちに当該有価証券の貸借の決済を履行した場合は、品借料は1日分として計算する。</p>