有価証券上場規程施行規則の一部改正新旧対照表

| 新 | 旧 |
| --- | --- |
| （上場廃止基準の取扱い）<br>第９４４条　（略）<br>２～８　（略）<br>９　規程第９５１条第１項第３号ｂに規定する基準の審査については、次の各号に掲げるとおり取り扱うこととする。<br>（１）　（略）<br>（１）の２　規程第９５１条第１項第３号ｂの規定について、相関係数が０．９未満となるかどうかの審査は、１２月末日を基準日として毎年行うものとする。<br>（２）　第１号に規定する上場ＥＴＮ信託受益証券に係る受託有価証券であるＥＴＮの一証券あたりの償還価額の前月比は、最近６０か月（「最近」の計算は直前の基準日（前号に規定する基準日をいう。以下この項において同じ。）を起算日としてさかのぼり、計算期間が６０か月に満たない場合にあっては当該計算期間）の各月において次の算式により算出するものとする。<br>算式<br>（Ｄ÷Ｅ）－１<br>算式の符号<br>Ｄ　当月末日における上場ＥＴＮ信託受益証券に係る受託有価証券であるＥＴＮの一証券あたりの償還価額<br>Ｅ　前月末日における上場ＥＴＮ信託受益証券に係る受託有価証券であるＥＴＮの一証券あたりの償還価額<br>（３）　前号に規定する当月末日における上場ＥＴＮ信託受益証券に係る受託有価証券であるＥＴＮの一証券あたりの償還価額及び前月末日における上場ＥＴＮ信託受益証券に係る受託有価証券であるＥＴＮの一証券あたりの償還価額については、第１号に規定する相関係数が０．９未満となるおそれがある場合には、分配金等を勘案するものとする。<br>（４）　（略）<br>（５）　第１号に規定する特定の指標の前月比は、最近６０か月（「最近」の計算は直前の基準日を起算日としてさかのぼり、計算期間が６０か月に満たない場合 | （上場廃止基準の取扱い）<br>第９４４条　（略）<br>２～８　（略）<br>９　規程第９５１条第１項第３号ｂに規定する基準の審査については、次の各号に掲げるとおり取り扱うこととする。<br>（１）　（略）<br>（新設）<br>（２）　前号に規定する上場ＥＴＮ信託受益証券に係る受託有価証券であるＥＴＮの一証券あたりの償還価額の前月比は、上場日の属する月の翌月から審査を行う月までの各月において次の算式により算出するものとする。<br>算式<br>（Ｄ÷Ｅ）－１<br>算式の符号<br>Ｄ　当月末日における上場ＥＴＮ信託受益証券に係る受託有価証券であるＥＴＮの一証券あたりの償還価額<br>Ｅ　前月末日における上場ＥＴＮ信託受益証券に係る受託有価証券であるＥＴＮの一証券あたりの償還価額<br>（３）　前号に規定する当月末日における上場ＥＴＮ信託受益証券に係る受託有価証券であるＥＴＮの一証券あたりの償還価額及び前月末日における上場ＥＴＮ信託受益証券に係る受託有価証券であるＥＴＮの一証券あたりの償還価額については、当該当月末日及び当該前月末日における分配金等を勘案するものとする。<br>（４）　（略）<br>（５）　第１号に規定する特定の指標の前月比は、上場日の属する月の翌月から審査を行う月までの各月について次の算式によるものとする。 |

| | |
|---|---|
| にあっては当該計算期間）の各月において次の算式により算出するものとする。<br>算式<br>（Ｆ÷Ｇ）－１<br>算式の符号<br>Ｆ　当月末日における当該特定の指標の終値<br>Ｇ　前月末日における当該特定の指標の終値 | 算式<br>（Ｆ÷Ｇ）－１<br>算式の符号<br>Ｆ　当月末日における当該特定の指標の終値<br>Ｇ　前月末日における当該特定の指標の終値 |
| （６）　規程第９５１条第１項第３号ｂに規定する１年以内に０．９以上とならないときとは、相関係数が０．９未満となった審査における基準日の翌日から起算して１年を経過する日を基準日として行う審査において相関係数が０．９以上とならないときをいう。 | （６）　規程第９５１条第１項第３号ｂに規定する１年以内に０．９以上とならないときとは、相関係数が０．９未満となった審査日の翌日から起算して１年を経過した日の属する月までの期間において相関係数が０．９以上とならないときをいう。 |
| （７）　前号の相関係数が０．９未満となった審査における基準日の翌日から起算して１年を経過する日を基準日として行う審査における第２号及び第５号の適用については、第２号及び第５号中「最近６０か月（「最近」の計算は直前の基準日を起算日としてさかのぼり、計算期間が６０か月に満たない場合にあっては当該計算期間）」とあるのは、「相関係数が０．９未満となった審査における基準日の翌日から起算して１年を経過する日の属する月まで」とする。 | （新設） |
| （８）　第６号の相関係数が０．９未満となった審査における基準日の翌日から起算して１年を経過する日を基準日として行う審査において相関係数が０．９以上となった場合で、当該審査後に実施する審査における第２号及び第５号の適用については、第２号及び第５号中「最近６０か月（「最近」の計算は、直前の基準日を起算日としてさかのぼり、計算期間が６０か月に満たない場合にあっては当該計算期間）」とあるのは、「相関係数が０．９未満となった審査における基準日の翌日の属する月から直前の基準日までのうち最近６０か月（「最近」の計算は、直前の基準日を起算日としてさかのぼり、計算期間が６０か月に満たない場合にあっては当該計算期間）」とする。 | （新設） |
| （９）　第２号及び第５号（前２号の規定により読み替えて適用する場合を含む。）に規定する計算期間は、上場ＥＴＮ信託受益証券に係る特定の指標が新た | （新設） |

| | |
|---|---|
| な指標へ変更された月及び天災地変等、上場ＥＴＮ信託受益証券に係る発行者の責めに帰すべからざる事由により資産の運用が困難となったと当取引所が認めた月を除き、さかのぼるものとする。 | |
| （１０）　（略） | （７）　（略） |
| （削る） | （８）　規程第９５１条第１項第３号ｂの規定について、相関係数が０．９未満となるかどうかの審査は、当分の間、１２月末日に行うものとし、１年以内に０．９以上となるかどうかの審査は、毎月末日に行うものとする。 |
| １０～１２　（略） | １０～１２　（略） |
| （上場廃止基準の取扱い） | （上場廃止基準の取扱い） |
| 第１１１３条　（略） | 第１１１３条　（略） |
| ２～１１　（略） | ２～１１　（略） |
| １２　規程第１１１２条第１項第３号ｅ（同条第２項第３号ａ及び同条第３項第５号ａによる場合を含む。以下この項において同じ。）に規定する基準の審査については、次の各号に掲げるとおり取り扱うこととする。 | １２　規程第１１１２条第１項第３号ｅ（同条第２項第３号ａ及び同条第３項第５号ａによる場合を含む。以下この項において同じ。）に規定する基準の審査については、次の各号に掲げるとおり取り扱うこととする。 |
| （１）　（略） | （１）　（略） |
| （１）の２　規程第１１１２条第１項第３号ｅの規定について、相関係数が０．９未満となるかどうかの審査は、１２月末日を基準日として毎年行うものとする。 | （新設） |
| （２）　第１号に規定する上場ＥＴＦ一口あたりの純資産額の前月比は、最近６０か月（「最近」の計算は直前の基準日（前号に規定する基準日をいう。以下この項において同じ。）を起算日としてさかのぼり、計算期間が６０か月に満たない場合にあっては当該計算期間）の各月において次の算式により算出するものとする。 | （２）　前号に規定する上場ＥＴＦ一口あたりの純資産額の前月比は、上場日の属する月の翌月から審査を行う月までの各月において次の算式により算出するものとする。 |
| 算式<br>（Ｄ÷Ｅ）－１<br>算式の符号<br>Ｄ　当月末日における上場ＥＴＦ一口あたりの純資産額<br>Ｅ　前月末日における上場ＥＴＦ一口あたりの純資産額 | 算式<br>（Ｄ÷Ｅ）－１<br>算式の符号<br>Ｄ　当月末日における上場ＥＴＦ一口あたりの純資産額<br>Ｅ　前月末日における上場ＥＴＦ一口あたりの純資産額 |
| （３）　前号に規定する当月末日における上場ＥＴＦ一口あたりの純資産額及び前月末日における上場ＥＴＦ一口あたりの純資産額については、第１号に規定する | （３）　前号に規定する当月末日における上場ＥＴＦ一口あたりの純資産額及び前月末日における上場ＥＴＦ一口あたりの純資産額については、当該末日における |

| | |
|---|---|
| 相関係数が０．９未満となるおそれがある場合には、収益分配金、分配金又は信託財産に係る給付金を勘案するものとする。 | 収益分配金、分配金又は信託財産に係る給付金を勘案するものとする。 |
| （４）　（略） | （４）　（略） |
| （５）　第１号に規定する特定の指標の前月比は、最近６０か月（「最近」の計算は直前の基準日を起算日としてさかのぼり、計算期間が６０か月に満たない場合にあっては当該計算期間）の各月において次の算式により算出するものとする。 | （５）　第１号に規定する特定の指標の前月比は、上場日の属する月の翌月から審査を行う月までの各月について次の算式によるものとする。 |
| 算式<br>（Ｆ÷Ｇ）－１<br>算式の符号<br>Ｆ　当月末日（第２号に規定する当月末日における上場ＥＴＦ一口あたりの純資産額の算出にあたり、当月末日より前の日の相場により投資信託財産、信託財産又は資産の評価を行っている場合においては、当該日）における当該特定の指標の終値<br>Ｇ　前月末日（第２号に規定する前月末日における上場ＥＴＦ一口あたりの純資産額の算出にあたり、前月末日より前の日の相場により投資信託財産、信託財産又は資産の評価を行っている場合においては、当該日）における当該特定の指標の終値 | 算式<br>（Ｆ÷Ｇ）－１<br>算式の符号<br>Ｆ　当月末日（第２号に規定する当月末日における上場ＥＴＦ一口あたりの純資産額の算出にあたり、当月末日より前の日の相場により投資信託財産、信託財産又は資産の評価を行っている場合においては、当該日）における当該特定の指標の終値<br>Ｇ　前月末日（第２号に規定する前月末日における上場ＥＴＦ一口あたりの純資産額の算出にあたり、前月末日より前の日の相場により投資信託財産、信託財産又は資産の評価を行っている場合においては、当該日）における当該特定の指標の終値 |
| （６）　規程第１１１２条第１項第３号ｅに規定する１年以内に０．９以上とならないときとは、相関係数が０．９未満となった審査における基準日の翌日から起算して１年を経過する日を基準日として行う審査において相関係数が０．９以上とならないときをいう。 | （６）　規程第１１１２条第１項第３号ｅに規定する１年以内に０．９以上とならないときとは、相関係数が０．９未満となった審査日の翌日から起算して１年を経過した日の属する月までの期間において相関係数が０．９以上とならないときをいう。 |
| （７）　前号の相関係数が０．９未満となった審査における基準日の翌日から起算して１年を経過する日を基準日として行う審査における第２号及び第５号の適用については、第２号及び第５号中「最近６０か月（「最近」の計算は直前の基準日を起算日としてさかのぼり、計算期間が６０か月に満たない場合にあっては当該計算期間）」とあるのは、「相関係数が０．９未満となった審査における基準日の翌日から起算して１年を経過する日の属する月まで」とする。 | （新設） |
| （８）　第６号の相関係数が０．９未満となった審査における基準日の翌日から起 | （新設） |

| | |
|---|---|
| 算して１年を経過する日を基準日として行う審査において相関係数が０．９以上となった場合で、当該審査後に実施する審査における第２号及び第５号の適用については、第２号及び第５号中「最近６０か月（「最近」の計算は、直前の基準日を起算日としてさかのぼり、計算期間が６０か月に満たない場合にあっては当該計算期間）」とあるのは、「相関係数が０．９未満となった審査における基準日の翌日の属する月から直前の基準日までのうち最近６０か月（「最近」の計算は、直前の基準日を起算日としてさかのぼり、計算期間が６０か月に満たない場合にあっては当該計算期間）」とする。 | |
| （９）　第２号及び第５号（前２号の規定により読み替えて適用する場合を含む。）に規定する計算期間は、上場ＥＴＦに係る特定の指標が新たな指標へ変更された月及び天災地変等、上場ＥＴＦに係る管理会社の責めに帰すべからざる事由により資産の運用が困難となったと当取引所が認めた月を除き、さかのぼるものとする。 | （新設） |
| （１０）　（略） | （７）　（略） |
| （削る） | （８）　規程第１１１２条第１項第３号ｅの規定について、相関係数が０．９未満となるかどうかの審査は、当分の間、１２月末日に行うものとし、１年以内に０．９以上となるかどうかの審査は、毎月末日に行うものとする。 |
| １３～１６　（略） | １３～１６　（略） |
| 付　　則<br>この改正規定は、令和４年１２月２６日から施行する。 | |