

## 清算預託金の代用有価証券に関する規則

### (目的)

第1条 この規則は、業務方法書第31条第4項の規定に基づき、清算参加者が清算預託金の代用物として本取引所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等に関し、必要な事項を定める。

(平成16年4月1日、平成19年9月30日、平成20年6月2日、平成20年7月31日、平成22年10月1日 変更)

### (代用有価証券の種類、代用価格及び評価替)

第2条 清算参加者が清算預託金の代用物として本取引所に預託することができる有価証券(以下「清算預託金の代用有価証券」という。)の種類は、別表に掲げるものとし、その預託の際における代用価格は、預託する営業日(業務規程第6条の2に規定する営業日をいう。以下同じ。)の前々営業日(当該営業日が国内の金融商品取引所の休業日に当たるときは、順次繰り上げる。)における同表注2に規定する時価に同表に掲げる率を乗じた額を超えない額とする。

2 すでに預託されている代用有価証券については、前営業日(当該営業日が国内の金融商品取引所の休業日に当たるときは、順次繰り上げる。)における別表注2に規定する時価に同表に掲げる率を乗じて各営業日の日中取引時間帯(業務規程第5条第1項第2号イに規定する日中取引時間帯をいう。)終了後にその代用価格を算出する。

3 前項の算出の結果、清算預託金に不足を生じた清算参加者は、当該算出を行った営業日の翌営業日の午前11時00分までに、前項の代用価格の算出により生じた不足額に相当する額以上の金銭又は有価証券を清算預託金として本取引所に預託しなければならない。ただし、本取引所が必要と認めるときは、別に預託期限を定めることができる。

(平成3年2月8日、平成6年9月30日、平成8年4月8日、平成15年4月28日、平成16年4月1日、平成18年7月3日、平成19年9月30日、平成20年6月2日、平成24年10月1日、平成29年7月3日 変更)

### (端数金額の調整)

第3条 別表に掲げる有価証券について代用価格を算出する場合の端数金額の調整は、次のとおりとする。

- (1) 別表第2項に規定する株券については、円位未満の端数金額を切り捨てる。
- (2) 前号に規定する有価証券を除く有価証券については、銭位未満の端数金額を切り捨てる。

(平成20年6月2日、平成29年7月3日 変更)

### (代用有価証券の預託方法)

第4条 別表第1項に規定する国債証券の本取引所への預託は、日本銀行に開設された本取引所名義の口座への振替により行うものとする。

2 別表第2項に規定する株券の本取引所への預託は、株式会社証券保管振替機構に開設された本取引所名義の口座への振替により行うものとする。

(平成9年6月5日、平成20年6月2日、平成29年7月3日 変更)

#### **(代用有価証券からの除外)**

第5条 清算預託金の代用有価証券として指定されている別表第2項の株券が、当該有価証券が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上場廃止の基準に該当した場合(次の各号に掲げる場合を除く。)には、該当した日の翌営業日から、当該株券を、清算預託金の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取引所金融商品市場に株券が上場されている会社(以下「上場会社という。」)の完全子会社となる場合
- (2) 当該株券の発行者が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取引所金融商品市場に速やかに上場される見込みがあるとき

(平成16年4月1日、平成19年9月30日、平成20年6月2日、平成21年9月28日、平成29年7月3日 変更)

#### **第6条 (削除)**

(平成16年4月1日、平成19年9月30日、平成20年6月2日、平成24年10月1日 変更)

#### **(代用有価証券の所有者)**

第7条 清算参加者は、自身が実質的な所有者である有価証券のみを代用有価証券とすることができる。

(平成16年4月1日、平成19年9月30日、平成20年6月2日 変更)

#### **第8条 (削除)**

(平成20年6月2日 追加、平成29年7月3日 削除)

#### **(自己等が発行する有価証券の代用の禁止)**

第9条 清算参加者は、次に掲げる者が発行する有価証券を代用有価証券とすることができない。

- (1) 自己

- (2) 自己の親会社（財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和 38 年大蔵省令第 59 号）第 8 条第 3 項に規定する親会社をいう。第 4 号において同じ。）
  - (3) 自己の子会社（財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則第 8 条第 3 項に規定する子会社をいう。次号において同じ。）
  - (4) 自己の親会社の子会社
- 2 別表第 2 項に規定する有価証券を預託する清算参加者は、その預託の時に、次の各号に掲げる区分に応じて、当該各号に定める書類を本取引所に提出しなければならない。
- (1) 第一種金融商品取引業を行う金融商品取引業者である清算参加者 金融商品取引業等に関する内閣府令（平成 19 年内閣府令第 52 号。次号において「業府令」という。）第 173 条第 1 号に規定する報告書
  - (2) 登録金融機関である清算参加者 業府令第 188 条第 1 号に規定する報告書
  - (3) 第一種金融商品取引業を行わない金融商品取引業者である清算参加者 前 2 号に規定する報告書のいずれか又はこれらに準ずる書類

（平成 20 年 12 月 1 日追加、平成 29 年 7 月 3 日 変更）

#### （代用有価証券に関する制限）

第 10 条 本取引所は、著しい相場の変動が発生する等、第 2 条の規定により代用有価証券を評価し、又は受け入れることが適当でないと認められる場合その他本取引所が必要と認める場合は、次に掲げる措置その他必要と認める措置をとることができる。

- (1) 別表に規定する時価に乗じる率の引下げ
- (2) 特定の有価証券についての、代用有価証券としての受入れの制限
- (3) 有価証券による清算預託金の代用の制限

（平成 20 年 12 月 1 日 追加）

#### 附則

この変更規則は、平成 3 年 2 月 8 日から施行する。

#### 附則

この変更規則は、平成 6 年 9 月 30 日から施行する。

**附則**

この変更規則は、平成8年4月8日から施行する。

**附則**

この変更規則は、平成9年6月5日から施行する。

**附則**

この変更規則は、本取引所が定める日から施行する。

(注)「本取引所が定める日」は平成15年4月28日

**附則**

この変更規定は、平成16年4月1日から施行する。

**附則**

この変更規定は、平成18年7月3日から施行する。

**附則**

この改正規定は、平成19年9月30日から施行する。

**附則**

- 1 この改正規定は、平成20年6月2日から施行する。
- 2 この改正規定の施行の際現に有価証券を本取引所に持参する方法により預託している清算参加者は、本取引所が定める日までに、当該有価証券の返戻を受けなければならない。

**附則**

この改正規定は、平成 20 年 7 月 31 日から施行する。

**附則**

- 1 この改正規定は、平成 20 年 12 月 1 日から施行する。
- 2 この改正規定の施行の際現に改正後の第 9 条第 1 項各号に規定する有価証券を本取引所に預託している清算参加者は、本取引所が定める日までに、当該有価証券の返戻を受けなければならない。

**附則**

この改正規定は、平成 21 年 9 月 28 日から施行する。

**附則**

この改正規定は、平成 22 年 10 月 1 日から施行する。

**附則**

この変更規則は、平成 23 年 1 月 1 日から施行する。

**附則**

この変更規則は、平成 23 年 2 月 28 日から施行する。

**附則**

この変更規則は、平成 24 年 1 月 30 日から施行する。

**附則**

この変更規則は、平成 24 年 10 月 1 日から施行する。

**附則**

この変更規則は、平成 25 年 2 月 12 日から施行する。

**附則**

この変更規則は、平成 26 年 1 月 10 日から施行する。

**附則**

この変更規則は、平成 26 年 7 月 22 日から施行する。

**附則**

この変更規則は、平成 27 年 1 月 19 日から施行する。

**附則**

- 1 この変更規則は、平成 27 年 10 月 13 日から施行する。
- 2 ただし、やむを得ない事由により、変更後の規定を適用することが適当でないと本取引所が認める場合には、本取引所が定める日から施行する。

**附則**

この変更規則は、平成 28 年 1 月 18 日から施行する。

**附則**

この変更規則は、平成 29 年 1 月 10 日から施行する。

**附則**

この変更規則は、平成 29 年 2 月 27 日から施行する。

**附則**

- 1 この変更規則は、平成 29 年 7 月 3 日から施行する。
- 2 この変更規則施行の際、現に変更前の別表第 2 項から第 4 項及び第 6 項に規定する有価証券を本取引所に預託している取引参加者は、すみやかに当該有価証券の返戻を受けなければならない。

**附則**

この変更規則は、平成 30 年 1 月 9 日から施行する。

**附則**

この変更規則は、2020 年 1 月 14 日から施行する。

**別表 代用有価証券の種類及び時価に乗じる率（第2条関係）**

（平成20年6月2日 追加、平成21年9月28日、平成23年2月28日、平成24年1月30日、平成25年2月12日、平成26年1月10日、平成27年1月19日、平成28年1月18日、平成29年1月10日、平成29年7月3日、平成30年1月9日、2020年1月14日 変更）

有価証券の種類 (注3)	時価に乗じる率 (注2)
1 日本国が発行する国債証券	<p>(1) 国債（変動利付国債、分離元本振替国債及び分離利息振替国債を除く。）及び国庫短期証券（割引短期国債及び政府短期証券）</p> <p>イ 残存期間1年以内のもの 99%</p> <p>ロ 残存期間1年超5年以内のもの 98%</p> <p>ハ 残存期間5年超10年以内のもの 97%</p> <p>ニ 残存期間10年超20年以内のもの 95%</p> <p>ホ 残存期間20年超30年以内のもの 93%</p> <p>ヘ 残存期間30年超のもの 93%</p> <p>(2) 変動利付国債</p> <p>イ 残存期間1年以内のもの 99%</p> <p>ロ 残存期間1年超5年以内のもの 98%</p> <p>ハ 残存期間5年超10年以内のもの 99%</p> <p>ニ 残存期間10年超20年以内のもの 99%</p> <p>(3) 分離元本振替国債及び分離利息振替国債</p> <p>イ 残存期間1年以内のもの 99%</p> <p>ロ 残存期間1年超5年以内のもの 98%</p> <p>ハ 残存期間5年超10年以内のもの 97%</p> <p>ニ 残存期間10年超20年以内のもの 94%</p> <p>ホ 残存期間20年超30年以内のもの 91%</p> <p>ヘ 残存期間30年超のもの 89%</p>
2 株券（新株予約権証券を除く。）(注1)	70%

(注) 1 日本国内の取引所金融商品市場に上場されているものに限る。

2 代用有価証券の時価は、次のとおりとする。

- (1) 第1項の有価証券については、次のいずれかの値
    - イ 日本証券業協会がその売買参考統計値を公表するものは、当該売買参考統計値のうち平均値
    - ロ 日本証券業協会がその売買参考統計値を公表しないものは、日本国内の取引所金融商品市場（複数の取引所金融商品市場に上場されている場合は、本取引所が定める取引所金融商品市場。以下この項において同じ。）における最終価格
    - ハ ロの場合において、最終価格が無いときは最終気配相場
  - (2) 第2項の有価証券については、次のいずれかの値
    - イ 日本国内の取引所金融商品市場における最終価格
    - ロ イの場合において、最終価格が無いときは最終気配相場
- 3 注2に掲げるいずれかの方法により時価を取得できるものに限る。

（平成20年6月2日 追加、平成21年9月28日、平成23年1月1日、平成24年10月1日、平成26年7月22日、平成27年10月13日、平成29年7月3日 変更）