

貸借取引参加者
代表者 殿

日本証券金融株式会社
代表取締役社長 小林 英三

「貸借値段の決定基準」等の一部改正について

拝啓 貴社ますますご清栄のこととお慶び申し上げます。

平素は格別のご高配を賜り厚くお礼申し上げます。

さて、当社は、平成 29 年 1 月 10 日（火）に日証金ネットワークシステム（以下「日証金ネット」といいます。）の全面的なリニューアルを実施することを予定しております。今般、日証金ネットのリニューアルに併せて、「貸借値段の決定基準」等の一部改正を下記のとおり実施いたしますので、ご通知申し上げます。

なお、日証金ネットのリニューアルを延期する場合は、本改正についても実施を延期させていただきます。

敬 具

記

1. 「貸借値段の決定基準」の一部改正 … 別紙 1

<改正内容>

- ・貸借値段について、各市場（東京・札幌・福岡）の貸借取引毎に当該市場の最終値段を採用する現在の方法を改め、各市場の貸借取引で銘柄毎に同一の値段を採用することとします。¹

2. 「貸借取引にかかる株式分割等による株式を受ける権利等の処理要領」の一部改正 … 別紙 2

<改正内容>

- ・権利落日当日の金融商品取引所における当該銘柄の最終値段がない場合、売買高等に基づいて定めた一定の順位により選択した金融商品取引所の基準値段を当日の貸借値段とすることとします。

3. 実施日

平成 29 年 1 月 10 日

以 上

¹ 別紙 1 の値段の決定方法は、(株)日本証券クリアリング機構の DVP 清算値段の決定方法と同様となります。

「貸借値段の決定基準」の一部改正新旧対照表

下線部分が改正箇所

新	旧
<p>1 貸借値段は、貸付日の3日前の日（<u>金融商品取引所の休業日を除く。以下「申込日」という。</u>）の<u>金融商品取引所における普通取引の最終値段（気配表示が行われているときは、当該最終気配値段。以下同じ。）とする。</u> <u>ただし、複数の金融商品取引所に上場している銘柄については、普通取引の最終値段がある金融商品取引所から一定の順位により選択した金融商品取引所における普通取引の最終値段とする。</u></p> <p>2 申込日当日に<u>金融商品取引所のいずれにおいても最終値段がない銘柄については、一定の順位により選択した金融商品取引所の基準値段</u>を当日の貸借値段とする。</p> <p style="text-align: center;">(削る)</p> <p style="text-align: center;">(削る)</p> <p>3 <u>前2項に定める一定の順位については、第一順位は、当該申込日が毎年2月から7月までの間は前年7月から12月までの、当該申込日が毎年8月から翌年1月までの間は1月から6月までの間における各金融商品取引所</u></p>	<p>1 貸借値段は、貸付日の3日前の日（取引所の休業日を除く。以下「申込日」という。）の取引所における普通取引の最終値段（気配表示が行われているときは、当該最終気配値段。以下同じ。）とする。</p> <p>2 申込日当日の取引所における最終値段がない銘柄については、<u>申込日前日の貸借値段</u>を当日の貸借値段とする。<u>ただし、次の各号に定める場合においては、それぞれに定める計算方法により算出された額を当日の貸借値段とする。</u></p> <p>(1) <u>申込日当日が当該銘柄の株式分割等による株式を受ける権利等にかかる権利落日（「貸借取引貸株超過銘柄等に対する取扱い」別表2(1)に定める期日をいう。以下同じ。）にあたるときは、前日の貸借値段から権利処理価額を差し引いた額（取引所が定める当該呼値の単位未満は切捨てる。）</u></p> <p>(2) <u>申込日当日が当該銘柄の株式併合にかかる権利落日にあたるときは、前日の貸借値段を併合比率（株式併合後の発行済株式総数を併合前の発行済株式総数で除して得た数をいう。）で除して得た額</u></p> <p style="text-align: center;">(新 設)</p>

新	旧
<p><u>において成立した当該銘柄の売買高（売買立会により成立した普通取引に係るものに限る。）の最も多い金融商品取引所とし、それ以降は、取引所・業界団体等コード（証券コード評議会の定めるものをいう。）の順序とする。</u></p> <p><u>4</u> 前<u>3</u>項の規定にかかわらず、当社が必要と認める場合には、当社がその都度定める値段を貸借値段とすることができる。この場合、当社は貸借取引参加者に通知する。</p> <p>付則 この改正規定は、平成 29 年 1 月 10 日から実施する。</p>	<p><u>3</u> 前<u>2</u>項の規定にかかわらず、当社が必要と認める場合には、当社がその都度定める値段を貸借値段とすることができる。この場合、当社は貸借取引参加者に通知する。</p>

「貸借取引にかかる株式分割等による株式を受ける権利等の処理要領」の一部改正新旧対照表

下線部分が改正箇所

新	旧
<p>12 前各項の規定にかかわらず、貸借取引融資担保株券等および貸付株券等にかかる株式に株式分割による株式を受ける権利または株式無償割当て（貸借取引を行っている株式と同一の種類株式が付与される場合に限る。）による株式を受ける権利が付与された場合（当該株式分割または株式無償割当てにかかる割当日の翌日が、当該株式分割または株式無償割当ての効力発生日である場合に限る。）で、単位の整数倍の数の新株式が割り当てられたときは、権利付売買最終日の当該銘柄にかかる各貸借取引参加者の取引区分ごとの融資株数および貸株株数ならびに品貸取引の借入株数について、権利落日をもって、当該株数を当該新株式割当率（株式の分割又は割当てにおいて、分割又は割当て後の発行済株式総数を分割又は割当て前の発行済株式総数で除して得た数から1を引いた数。以下同じ。）に1を加えた数を乗じた株数に調整する。</p> <p style="text-align: center;">(削る)</p> <p>付則 この改正規定は、平成29年1月10日から実施する。</p>	<p>12 前各項の規定にかかわらず、貸借取引融資担保株券等および貸付株券等にかかる株式に株式分割による株式を受ける権利または株式無償割当て（貸借取引を行っている株式と同一の種類株式が付与される場合に限る。）による株式を受ける権利が付与された場合（当該株式分割または株式無償割当てにかかる割当日の翌日が、当該株式分割または株式無償割当ての効力発生日である場合に限る。）で、単位の整数倍の数の新株式が割り当てられたときは、<u>次の方法により処理するものとする。</u></p> <p>(1) <u>権利付売買最終日の当該銘柄にかかる各貸借取引参加者の取引区分ごとの融資株数および貸株株数ならびに品貸取引の借入株数については、権利落日をもって、当該株数を当該新株式割当率（株式の分割又は割当てにおいて、分割又は割当て後の発行済株式総数を分割又は割当て前の発行済株式総数で除して得た数から1を引いた数。以下同じ。）に1を加えた数を乗じた株数に調整する。</u></p> <p>(2) <u>権利落日の取引所における最終値段（気配表示が行われているときは、当該最終気配値段。）がない場合には、権利付売買最終日の貸借値段を当該新株式割当率に1を加えた数で除した額（取引所が定める当該銘柄の呼値の単位未満は切捨てる。）に調整し、権利落日における貸借値段とする。</u></p>