

社発第 T-672 号

2019 年 3 月 22 日

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

株式等の決済期間の短縮化に伴う「貸借取引貸出規程」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、ご高承のとおり、2019 年 7 月 16 日付で株券等の決済期間の短縮化が予定されております。

これに伴い当社は、貸借取引にかかる制度整備を図るため、下記のとおり「貸借取引貸出規程」等の一部改正を行うことといたしましたので、ご通知申し上げます。

敬 具

記

1. 改正の内容

以下の各規程における各日程について、1 日前倒しを行います。また、付則において株券等の決済期間の短縮化への移行時における対応等について規定します。

①貸借取引貸出規程・・・別紙 1

- ・制限等の通知を行う日、借入申込日、返済申込日、みなしの借入申込みに係る期限、貸借取引および品貸取引の決済日

②貸借取引貸株超過銘柄等に対する取扱い・・・別紙 2

- ・品貸料の最高料率引上げの際に設定する期日

③貸借値段の決定基準・・・別紙 3

- ・貸借値段の採用日

④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・・・別紙 4

- ・権利処理に係る受払を行う日

2. 実施日

2019 年 7 月 16 日

以 上

「貸借取引貸出規程」の一部改正新旧対照表

下線部分が改正箇所

新	旧
<p>(制限等の通知)</p> <p>第 5 条 当社は、前条に規定する措置を行おうとするときは、実施日（増担保金の徴収日、貸付けの制限もしくは停止の日または貸付けの返済を受ける日をいう。）の <u>3</u> 日前（取引所の休業日を除く。以下同じ。）の日までにその旨を貸借取引参加者に通知する。ただし、緊急やむをえない場合は、この限りでない。</p>	<p>(制限等の通知)</p> <p>第 5 条 当社は、前条に規定する措置を行おうとするときは、実施日（増担保金の徴収日、貸付けの制限もしくは停止の日または貸付けの返済を受ける日をいう。）の <u>4</u> 日前（取引所の休業日を除く。以下同じ。）の日までにその旨を貸借取引参加者に通知する。ただし、緊急やむをえない場合は、この限りでない。</p>
<p>(借入れの申込み)</p> <p>第 7 条 貸借取引参加者は、貸借取引により貸付けを受けようとするときは、所定の融資申込票または借株等（株券等の借入をいう。以下同じ。）申込票に銘柄、株数（優先出資証券、受益証券、投資証券、外国投資信託受益証券、外国投資証券、受益証券発行信託の受益証券および外国受益証券発行信託の受益証券の場合には「口数」（投資法人債券に類する外国投資証券にあっては、当該証券にかかる単位数をいう。）と、預託証券の場合には「証券数」とそれぞれ読み替える。以下特に定めのない限り同じ。）、その他所定の事項を記入して、貸付けを受けようとする日の <u>2</u> 日前の日（以下「借入申込日」という。）の当社が別に定める時限までに、当社に当該借入れを申し込まなければならない。</p>	<p>(借入れの申込み)</p> <p>第 7 条 貸借取引参加者は、貸借取引により貸付けを受けようとするときは、所定の融資申込票または借株等（株券等の借入をいう。以下同じ。）申込票に銘柄、株数（優先出資証券、受益証券、投資証券、外国投資信託受益証券、外国投資証券、受益証券発行信託の受益証券および外国受益証券発行信託の受益証券の場合には「口数」（投資法人債券に類する外国投資証券にあっては、当該証券にかかる単位数をいう。）と、預託証券の場合には「証券数」とそれぞれ読み替える。以下特に定めのない限り同じ。）、その他所定の事項を記入して、貸付けを受けようとする日の <u>3</u> 日前の日（以下「借入申込日」という。）の当社が別に定める時限までに、当社に当該借入れを申し込まなければならない。</p>
<p>(返済の申込み)</p> <p>第 8 条 貸借取引参加者は、貸借取引により貸付けを受けた金銭または株券等を返済しようとするときは、所定の融資返済申込票または借株等返済申込票に銘柄、株数、その他所定の事項を記入して、返済を行う日の <u>2</u> 日前の日（以下「返済申込日」という。）の当社が別に定める時限までに、当社に当該返済を申し込</p>	<p>(返済の申込み)</p> <p>第 8 条 貸借取引参加者は、貸借取引により貸付けを受けた金銭または株券等を返済しようとするときは、所定の融資返済申込票または借株等返済申込票に銘柄、株数、その他所定の事項を記入して、返済を行う日の <u>3</u> 日前の日（以下「返済申込日」という。）の当社が別に定める時限までに、当社に当該返済を申し込</p>

新	旧
まなければならない。	まなければならない。
<p>(返済期日)</p> <p>第 11 条 (現行どおり)</p> <p>2 前項ただし書きの場合において、貸借取引参加者は、顧客の制度信用取引、自己の信用買いもしくは信用売りまたは有価証券等清算取次ぎにかかる金融商品市場取引成立の日の 6 カ月目の応当日(応当日がないときはその月の末日とし、応当日が休業日にあたるときは順次繰り上げる。) から起算して 3 日目(取引所の休業日を除く。) の日をこえて、貸借取引により、当該金融商品市場取引にかかる金銭または株券等を借り入れることができない。</p>	<p>(返済期日)</p> <p>第 11 条 (省略)</p> <p>2 前項ただし書きの場合において、貸借取引参加者は、顧客の制度信用取引、自己の信用買いもしくは信用売りまたは有価証券等清算取次ぎにかかる金融商品市場取引成立の日の 6 カ月目の応当日(応当日がないときはその月の末日とし、応当日が休業日にあたるときは順次繰り上げる。) から起算して 4 日目(取引所の休業日を除く。) の日をこえて、貸借取引により、当該金融商品市場取引にかかる金銭または株券等を借り入れることができない。</p>
<p>(貸付け等の通知等)</p> <p>第 14 条 (現行どおり)</p> <p>2～3 (現行どおり)</p> <p>4 当社は、申込日または貸株等超過が生じた日の翌日までに、第 16 条による金銭または株券等の授受にかかる所要の事項を清算機関に通知するものとし、当該通知を行ったときに、当該申込日または貸株等超過が生じた日から起算して 3 日目の日に決済が行われるすべての取引について、貸借取引および品貸取引にかかる約定が成立するものとする。ただし、貸借取引については、第 4 条に基づき当社が承諾しない旨通知した取引を除くものとし、また、品貸取引については、貸借取引参加者を相手方とする取引に限るものとする。</p> <p>5 (現行どおり)</p>	<p>(貸付け等の通知等)</p> <p>第 14 条 (省略)</p> <p>2～3 (省略)</p> <p>4 当社は、申込日または貸株等超過が生じた日の翌日までに、第 16 条による金銭または株券等の授受にかかる所要の事項を清算機関に通知するものとし、当該通知を行ったときに、当該申込日または貸株等超過が生じた日から起算して 4 日目の日に決済が行われるすべての取引について、貸借取引および品貸取引にかかる約定が成立するものとする。ただし、貸借取引については、第 4 条に基づき当社が承諾しない旨通知した取引を除くものとし、また、品貸取引については、貸借取引参加者を相手方とする取引に限るものとする。</p> <p>5 (省略)</p>
<p>付則</p> <p>1 この改正規定は、2019 年 7 月 16 日(以下「実施日」という。) から実施する。ただし、第 5 条の改正規定は、2019 年 7 月 12 日から実施し、第 11 条第 2 項の改正規定は、実施日以後に到来する同項に規定する金融商品市場取引成立の日の 6 カ月目の応当日から適用する。</p>	

新	旧
<p>2 実施日の前日（取引所の休業日に当たるときは、順次繰り上げる。）における第7条第1項に規定する借入れ申込みおよび第8条第1項に規定する返済申込みについては、実施日に行われたものとみなす。</p> <p>3 実施日の翌々日（取引所の休業日に当たるときは、順次繰り下げる。以下同じ。）を貸借取引の返済期日として第15条第3項に基づき当社が貸借取引参加者から返済を受ける貸付金額および貸付株券等の価額は、実施日における当該銘柄の貸借値段に返済株数を乗じた額とし、実施日の翌々日を品貸取引の返済期日として同項に基づき当社が品貸先に返済する借入株券等の価額は、実施日における当該銘柄の貸借値段に返済株数を乗じた額とする。</p> <p>4 実施日の翌々日に第17条第1項及び第2項の規定に基づき授受する更新差金および品貸更新差金については、実施日と実施日の2日前（取引所の休業日を除く。）の日の貸借値段を比較して差額を生じたときに、その差額に相当する更新差金および品貸更新差金を当該貸借取引参加者または当該品貸先と授受するものとする。</p>	

「貸借取引貸株超過銘柄等に対する取扱い」の一部改正新旧対照表

下線部分が改正箇所

新				旧			
(別表)				(別表)			
投資単位 (貸借値段に売買単位を乗じて得た金額)	5万円以下	5万円超		投資単位 (貸借値段に売買単位を乗じて得た金額)	5万円以下	5万円超	
投資単位に対する品貸料の上限	100円	100円に投資単位5万円から計算して1万円以下を増すごとに20円を加算した額		投資単位に対する品貸料の上限	100円	100円に投資単位5万円から計算して1万円以下を増すごとに20円を加算した額	
1. (現行どおり)				1. (省 略)			
投資単位	1万円以下	1万円超5万円以下	5万円超	投資単位	1万円以下	1万円超5万円以下	5万円超
投資単位に対する品貸料の上限	60円	60円に投資単位1万円から計算して1万円以下を増すごとに10円を加算した額	100円に投資単位5万円から計算して1万円以下を増すごとに20円を加算した額	投資単位に対する品貸料の上限	60円	60円に投資単位1万円から計算して1万円以下を増すごとに10円を加算した額	100円に投資単位5万円から計算して1万円以下を増すごとに20円を加算した額
2. (現行どおり)				2. (省 略)			
3. つぎに定める銘柄の貸借申込み分にかかる最高料率については、(1)～(4)の各区分に定める料率とする。ただし(1)または(2)に該当し、かつ(3)または(4)に該当する場合は、(1)または(2)の該当する料率の2倍とする。				3. つぎに定める銘柄の貸借申込み分にかかる最高料率については、(1)～(4)の各区分に定める料率とする。ただし(1)または(2)に該当し、かつ(3)または(4)に該当する場合は、(1)または(2)の該当する料率の2倍とする。			
(1) 取引所において配当落もしくは権利落とする日が定められた銘柄または株式会社証券保管振替機構 (以下「機構」という。) が振替業において取り扱う株券について、社債、株式等の振替に関する法律に基づく総株主通知が行われる銘柄 (以下、本号において配当落もしくは権利落とする日または総株主通知にかかる株主を確定するための日の <u>前営業日</u> を「期日」という。)				(1) 取引所において配当落もしくは権利落とする日が定められた銘柄または株式会社証券保管振替機構 (以下「機構」という。) が振替業において取り扱う株券について、社債、株式等の振替に関する法律に基づく総株主通知が行われる銘柄 (以下、本号において配当落もしくは権利落とする日または総株主通知にかかる株主を確定するための日の <u>2 営業日前の日</u> を「期日」という。)			
① 期日の6営業日前から2営業日前までの貸借申込み分 上記1. および上記2. により定まる最高料率 (以下「上記1. および2. の最高料率」という。) の2倍				① 期日の6営業日前から2営業日前までの貸借申込み分 上記1. および上記2. により定まる最高料率 (以下「上記1. および2. の最高料率」という。) の2倍			
② 期日の前営業日の貸借申込み分 上記1. および2. の最高料率の4倍				② 期日の前営業日の貸借申込み分 上記1. および2. の最高料率の4倍			
(2) 機構が外国株券等の保管及び振替決済に係る業務において取り扱う外国株券または預託証券について、機構の「外国株券等の保管及び振替決済に関する規則」に基づく外国株券等実質株主の通知が行われる銘柄 (上記(1)に該当する銘柄を除く。)(以下、本号において外国株券等実質株主を確定するための日 (株主総会における議決権について外国株券等実質株主の議決権を代理行使するために機構が指定する日を含む。)) の <u>前営業日</u> を「期日」という。)				(2) 機構が外国株券等の保管及び振替決済に係る業務において取り扱う外国株券または預託証券について、機構の「外国株券等の保管及び振替決済に関する規則」に基づく外国株券等実質株主の通知が行われる銘柄 (上記(1)に該当する銘柄を除く。)(以下、本号において外国株券等実質株主を確定するための日 (株主総会における議決権について外国株券等実質株主の議決権を代理行使するために機構が指定する日を含む。)) の <u>2 営業日前の日</u> を「期日」という。)			
① 期日の6営業日前から2営業日前までの貸借申込み分 上記1. および2. の最高料率の2倍				① 期日の6営業日前から2営業日前までの貸借申込み分 上記1. および2. の最高料率の2倍			
② 期日の前営業日の貸借申込み分 上記1. および2. の最高料率の4倍				② 期日の前営業日の貸借申込み分 上記1. および2. の最高料率の4倍			
(3) (現行どおり)				(3) (省 略)			
(4) (現行どおり)				(4) (省 略)			
4.～5. (現行どおり)				4.～5. (省 略)			
付則 この改正規定は、2019年7月16日から実施する。							

「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<u>2</u>日前の日（金融商品取引所の休業日を除く。以下「申込日」という。）の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。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。</p>	<p>1. 貸借値段は、貸付日の<u>3</u>日前の日（金融商品取引所の休業日を除く。以下「申込日」という。）の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。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。</p>
<p>付則</p> <p>1. この改正規定は、2019年7月16日から実施する。</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>5 権利付売買最終日の貸借値段で各貸借取引参加者が当社から貸付けを受けている融資または貸株は、権利落日に当日の貸借値段で更新を行いその貸借計算においては、更新差金の授受と前項により定められた権利処理価額による代金（権利処理価額に当該融資または貸株の株数を乗じた金額）とを清算し、その差額金については、権利落日から起算して<u>3</u>日目の日（休業日を除く。以下同じ。）に受払いを行う。</p>	<p>5 権利付売買最終日の貸借値段で各貸借取引参加者が当社から貸付けを受けている融資または貸株は、権利落日に当日の貸借値段で更新を行いその貸借計算においては、更新差金の授受と前項により定められた権利処理価額による代金（権利処理価額に当該融資または貸株の株数を乗じた金額）とを清算し、その差額金については、権利落日から起算して<u>4</u>日目の日（休業日を除く。以下同じ。）に受払いを行う。</p>
<p>付則 この改正規定は、2019年7月16日から実施する。</p>	