

社発第 T-526 号  
平成 25 年 11 月 21 日

貸借取引参加者  
代表者 殿

日本証券金融株式会社  
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、株式会社東京証券取引所は、平成 25 年 5 月に、現物立会市場における呼値の単位の段階的な適正化の過程で平成 26 年 7 月 22 日に一部上場銘柄について 1 円未満の呼値の単位を設ける（フェーズⅡ）こと、また、平成 25 年 10 月に、これに伴う業務規程等の一部改正をそれぞれ発表しております。

つきましては、当社では、フェーズⅡへの対応として貸借値段の決定方法を一部変更する取扱いとし、下記のとおり貸借取引関連規程の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. 「貸借値段の決定基準」の一部改正 . . . 別紙 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)
  - ・ 貸借値段は、取引所における最終値段について円未満を切捨てた値とする。
3. 実施日 . . . 平成 26 年 7 月 22 日 (予定)

(注) 「貸借取引貸借担保金代用有価証券の受入に関する細則」に規定する貸借取引貸借担保金代用有価証券のうち、同細則の第 1 項第 1 号に規定する (リ) 株券から (ロ) 外国受益証券発行信託の受益証券に掲げる代用有価証券に係る代用価格を算出する際の時価 (同項第 2 号 (ロ) に規定する当該金融商品取引所における最終価格) は、フェーズⅡより円未満を含めた価格を採用し、代用価格については円未満を切捨てた値といたします。

以 上

## 「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（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。）<u>について円未満を切捨てた値とする。</u></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、申込日前日の貸借値段を当日の貸借値段とする。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。</p> <p>(1) 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に係る権利落日（「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>円未満は切捨てる。</u>）</p> <p>(2) (現行どおり)</p> <p>3. (現行どおり)</p> <p>付 則 この改正規定は、平成 26 年 7 月 22 日から実施する。</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、申込日前日の貸借値段を当日の貸借値段とする。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。</p> <p>(1) 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に係る権利落日（「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。）</p> <p>(2) (省略)</p> <p>3. (省略)</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</p> <p>(現行どおり)</p> <p>(1) (現行どおり)</p> <p>(2) 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。<u>円未満は切捨てる。</u>)に調整し、権利落日における貸借値段とする。</p> <p>付 則 この改正規定は、平成26年7月22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、次の方法により処理するものとする。</p> <p>(1) (省略)</p> <p>(2) 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。</p>