

証券決済未了の場合及びバイインの取扱いに関する規則

(目的)

第1条 この規則は、業務方法書第62条の3及び第63条の規定に基づき、DVP決済に係る証券決済未了の場合及びバイインの取扱いに関し、必要な事項を定める。

(証券決済未了の制限)

第2条 業務方法書第62条の2第1項に規定する当社が必要と認めて定める日は、次の各号に掲げる日とする。

(1) いずれの金融商品取引所(指定市場開設者であるものに限る。)においても上場廃止となった銘柄(同時に他の指定金融商品市場に上場する場合を除く。)について、上場廃止の日の前日から起算して4日目の日(休業日を除外する。以下日数計算について同じ。)。ただし、当該銘柄のうち転換社債型新株予約権付社債券について、当該4日目の日が業務方法書第64条第3項第2号から第4号までに掲げる日に当たる場合には5日目の日とし、次のa又はbに定める場合には6日目の日とする。

a 上場廃止の日の前日から起算して4日目の日が、業務方法書第64条第3項第2号又は第3号に定める日の前日であって、かつ、同項第4号に定める日に当たる場合

b 上場廃止の日の前日から起算して4日目の日が業務方法書第64条第3項第2号又は第3号に定める日に当たり、かつ、その翌日が同項第4号に定める日に当たる場合

(2) 指定金融商品市場に株券が上場されている会社が併合等(株式の併合、株式の分割と同時に単元株式数を増加し又は単元株式数についての定款の定めを設けること等をいう。以下この号において同じ。)を行う場合において当該併合等が行われる銘柄について、当該併合等の効力発生の日の前日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。)

(3) 利付転換社債型新株予約権付社債券について、業務方法書第64条第3項第2号又は第3号に定める日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。以下同じ。)が同項第4号に定める日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。以下同じ。)に当たるときは、当該日の前日

(4) 前各号に掲げる日のほか、当社が必要と認める日

2 前項第2号の規定は優先出資証券、投資信託受益証券、投資証券及び受益証券発行信託の受益証券について、それぞれ準用する。

(遅延損害金の授受)

第3条 証券決済未了に係る渡方現物清算参加者（以下「証券決済未了渡方清算参加者」という。）は、証券決済未了の場合、その日のDVP清算値段に証券決済未了に係る有価証券の数量を乗じた額100円につき4銭の遅延損害金を当社に支払わなければならない。

- 2 証券決済未了渡方清算参加者は、利付転換社債型新株予約権付社債券について、業務方法書第64条第3項第4号に定める日の前日における証券決済未了の場合、前項の規定による遅延損害金に加え、当該定める日におけるDVP清算値段に証券決済未了に係る有価証券の数量を乗じた額100円につき4銭の遅延損害金を当社に支払わなければならない。
- 3 当社は、前2項の規定により受領した遅延損害金を、証券決済未了に係る受方現物清算参加者（以下「証券決済未了受方清算参加者」という。）に交付する。
- 4 前3項の規定による遅延損害金の授受に際して必要な端数金額の取扱いは、当社が定める。

(遅延違約金の支払い)

第4条 証券決済未了渡方清算参加者は、約定決済日から起算して5日目以降の日における証券決済未了の場合は、その日のDVP清算値段に証券決済未了に係る有価証券の数量を乗じた額100円につき2銭の遅延違約金を当社に支払わなければならない。

- 2 証券決済未了渡方清算参加者は、利付転換社債型新株予約権付社債券について、約定決済日から起算して5日目以降の日であって業務方法書第64条第3項第4号に定める日の前日における証券決済未了の場合、前項の規定による遅延違約金に加え、当該定める日におけるDVP清算値段に証券決済未了に係る有価証券の数量を乗じた額100円につき2銭の遅延違約金を当社に支払わなければならない。
- 3 前2項の遅延違約金のほか、転換社債型新株予約権付社債券以外の有価証券について、業務方法書第64条第3項各号に掲げる日（休業日に当たるときは、順次繰り上げる。以下同じ。）において、証券決済未了により決済を翌日（休業日に当たるときは、順次繰り下げる。以下同じ。）に繰り延べた場合には、証券決済未了渡方清算参加者は、同項各号に掲げる日の各銘柄のDVP清算値段と同項各号に掲げる日の2日前の日の各銘柄のDVP清算値段のうちいずれか高い清算値段に証券決済未了に係る有価証券の数量を乗じた額100円につき8銭の期末銘柄等遅延違約金を当社に支払わなければならない。
- 4 第1項及び第2項の遅延違約金のほか、転換社債型新株予約権付社債券について、業務方法書第64条第3項第2号又は第3号に掲げる日の前日において証券決済未了により決済を翌日に繰り延べた場合（利付転換社債型新株予約権付社債券について、同項第

2号又は第3号に掲げる日の前日が同項第4号に掲げる日に当たるときは、同項第2号又は第3号に掲げる日の2日前の日において、証券決済未了により決済を2日後に繰り延べた場合には、証券決済未了渡方清算参加者は、同項第2号又は第3号に掲げる日の前日の各銘柄のDVP清算値段と同項第2号又は第3号に掲げる日の3日前（この項前段のかつこ書の規定により決済を2日後に繰り延べた場合には4日前）の日の各銘柄のDVP清算値段のうちいずれか高い清算値段（以下「期末銘柄等遅延違約金算定値段」という。）に証券決済未了に係る転換社債型新株予約権付社債券の数量を乗じた額100円につき8銭の期末銘柄等遅延違約金を当社に支払わなければならない。ただし、同項第2号又は第3号に掲げる日において決済を行った場合は、当該決済を行った数量に係る期末銘柄等遅延違約金は、期末銘柄等遅延違約金算定値段に当該決済を行った数量を乗じた額100円につき2銭とする。

- 5 前条第4項の規定は、第1項及び第2項の規定による遅延違約金の支払い並びに前2項の規定による期末銘柄等遅延違約金の支払いについて準用する。

（配当金又は権利の引渡通知書）

第5条 業務方法書第64条第3項第1号に定める日（休業日に当たるときは、順次繰り上げる。）において、証券決済未了により決済を繰り延べた場合には、証券決済未了渡方清算参加者と当社が指定する証券決済未了受方清算参加者は、配当金、権利等に係る取扱いについて、協議するものとする。この場合においては、当該証券決済未了渡方清算参加者は、所定の「配当金・権利等引渡通知書」を当該証券決済未了受方清算参加者に交付するものとする。

- 2 前項前段の規定は、業務方法書第64条第3項第2号及び第3号に定める日（休業日に当たるときは、順次繰り上げる。）において、証券決済未了により決済を繰り延べた場合に準用する。

（売買単位未満株式の金銭処理）

第6条 前条第1項の規定により「配当金・権利等引渡通知書」を交付した場合において、証券決済未了渡方清算参加者が引き渡すこととなる権利のうち、売買単位に満たない数の株式（以下「売買単位未満株式」という。）に係る権利については、証券決済未了渡方清算参加者は、当該売買単位未満株式の買取りを発行会社に請求することができることとなった日に買取りを請求した場合の当該発行会社による買取価格に当該売買単位未満株式の数を乗じて得た額の金銭を当該証券決済未了受方清算参加者に交付するものとする。ただし、証券決済未了渡方清算参加者と当該証券決済未了受方清算参加者との間で、売買単位未満株式に係る権利の処理について別段の定めをした場合は、この限りでない。

(転換社債型新株予約権付社債券の経過利子)

第7条 証券決済未了渡方清算参加者は、約定決済日の翌日以降の経過利子を当社及び証券決済未了受方清算参加者に請求することができない。

(利子相当額の引渡し)

第8条 証券決済未了渡方清算参加者は、利付転換社債型新株予約権付社債券について、業務方法書第64条第3項第4号に定める日の前日における証券決済未了の場合は、引渡しに係る決済未了有価証券の利子に相当する額の総額から同第50条第4項の規定によりその日のDVP受払代金から除外された金銭の額のうちその日における単位算出経過利子に相当する額を差し引いた額の金銭を当社に支払わなければならない。

2 当社は、前項の規定により受領した金銭を、証券決済未了受方清算参加者に交付する。

3 前2項の規定により支払い又は交付する金銭の額は、その日のDVP受払代金に含めて授受するものとする。

4 業務方法書第53条の規定に基づき有価証券の引渡しの限度額を算出する場合において、第1項の規定により支払う金銭の額が第2項の規定により交付を受ける金銭の額を上回っているときは、同条第1項第2号に規定するDVP受払代金として当社に支払い(同第51条第2項の規定による充当によるものを除く。)をした額(前項の規定によりDVP受払代金に含めて授受される金銭の額を加えた後の支払額をいう。)から、前項の規定によりDVP受払代金に含めて授受される金銭の額を控除するものとし、第2項の規定により交付を受ける金銭の額が第1項の規定により支払う金銭の額を上回っているときは、同第53条第1項第2号に規定するDVP受払代金として当社に支払い(同第51条第2項の規定による充当によるものを除く。)をした額(前項の規定によりDVP受払代金に含めて授受される金銭の額を控除した後の支払額をいう。)に、前項の規定によりDVP受払代金に含めて授受される金銭の額を加えるものとする。

第9条 削除

(バイインの請求)

第10条 証券決済未了受方清算参加者は、証券決済未了による決済の繰延べが2日間以上続いている場合には、当該証券決済未了に係る有価証券について、当社に対しバイインの請求を行うことができる。ただし、次の各号に掲げる日においては、バイインの請求を行うことができない。

(1) 業務方法書第64条第3項第2号(転換社債型新株予約権付社債券に限る。)又

は第3号に該当する銘柄について、当該各号に掲げる日及びその前日

- (2) いずれの金融商品取引所（指定市場開設者であるものに限る。）においても上場廃止となった銘柄について、上場廃止の日以降の日
- (3) 利付転換社債型新株予約権付社債券について、業務方法書第64条第3項第2号又は第3号に定める日の前日が同項第4号に定める日に当たるときは、同項第2号又は第3号に定める日の2日前の日
- (4) 前各号に掲げる日のほか、当社が必要と認める日

（バイインの請求時間）

第11条 バイインの請求は、午後1時30分から午後2時30分までの間に行うものとする。ただし、当社は、必要があると認めるときは、当該請求時間を臨時に変更することができる。

（バイインの請求の失効）

第12条 第2条第1項第2号に掲げる日又は第10条各号に掲げる日までに行われたバイインの請求は、当該前日においてもなお、バイインによって当該請求に係る決済未了有価証券のすべてについて売買が成立しない場合は、当該成立しない部分についてその効力を失うものとする。

（バイインの請求の取下げ）

第13条 証券決済未了受方清算参加者は、バイインの請求日から起算して5日目の日以降は、当該請求を取り下げることができる。この場合において、当該請求の取下げはバイインの請求日の早いものから順に行うものとし、請求日を同一とする請求についてはそのすべてを取り下げるものとする。

2 前項のバイインの請求の取下げに係る当社への申告は、午前9時から午後1時までの間に行うものとする。ただし、当社は、必要があると認めるときは、当該申告時間を臨時に変更することができる。

3 第1項の規定にかかわらず、当社は、必要があると認めるときは、当該請求の取下げを制限することができる。

（バイインによる売買の買方現物清算参加者の指定及び買付申込み）

第14条 証券決済未了受方清算参加者がバイインの請求を行った場合において、当該請求日から起算して4日目の日のDVP決済に係る決済時限を超えてもなお当該証券決済未了受方清算参加者の決済が繰り延べられている場合には、当社は、当該請求が行われ

た時点以前において証券決済未了渡方清算参加者となっていた現物清算参加者のうちから、バイインの買付けを行うべき現物清算参加者を指定する。この場合においては、当該現物清算参加者は、当該指定の日に当社が指定する数量について自己の計算においてバイインの買付けの申込みを行ったものとみなす。

- 2 前項のバイインによる売買の一部又は全部が成立しなかった場合の未成立数量については、当社は、翌日以降当該数量についてバイインによる売買が成立するまでの間、毎日、バイインの買付けを行うべき現物清算参加者を指定する。この場合においては、当該現物清算参加者は、当該指定の日に当社が指定する数量について自己の計算においてバイインの買付けの申込みを行ったものとみなす。ただし、当該バイインの請求がその効力を失った場合及び当該証券決済未了受方清算参加者が当該請求を取り下げた場合は、この限りでない。
- 3 前2項の規定にかかわらず、当社は、必要があると認めるときは、バイインによる売買を制限することができる。

(バイインによる売買の売付申込み)

第15条 バイインの買付けに対する売付けの申込みは、現物清算参加者が、次の各号に定めるところにより行うものとする。

(1) 売付申込時間

バイインの買付けに対する売付けの申込みは、バイインによる売買を行う日の午後3時30分から午後4時までの間において、当社に対して行うものとする。ただし、当社は、必要があると認めるときは、当該売付申込時間を臨時に変更することができる。

(2) 売付申込方法

バイインの買付けに対する売付けの申込みは、当社が適当と認める方法により当社に通知することにより行うものとする。この場合において、現物清算参加者は、当該売付けの申込みが顧客の委託に基づくものか自己の計算によるものかの別を当社に対し明らかにしなければならない。

(3) 売付申込数量の単位

売付申込数量の単位は、当該銘柄の指定金融商品市場における売買単位に準じて当社が定めた数量とする。

(4) 売付申込値段の単位

売付申込値段の単位は、当該銘柄の指定金融商品市場における呼値の単位に準じて当社が定めた単位とする。

(5) 売付申込値段の制限

売付申込値段は、バイインによる売買を行う日の一定の順位により選択された指定金融商品市場（取引所金融商品市場に限る。）における最終値段（指定市場開設者の定める気配表示が行われているときは、当該最終気配値段を含み、当該バイインを行う日に最終値段（当該最終気配値段を含む。）がないとき又は業務方法書第64条第3項各号（第4号を除く。）に掲げる日の2日前若しくは前日においては当社がその都度定める値段とする。）と当該値段からその10%相当額を加えた値段の範囲内の値段とする。ただし、当社は、必要があると認めるときは、当該売付申込値段の範囲を臨時に変更することができる。

- 2 業務方法書の取扱い第11条第3項の規定は、前項第5号の一定の順位について準用する。この場合において、同条第3項中「当該前日が」とあるのは「バイインによる売買を行う日が」と読み替えるものとする。

（バイインによる売買の対当順位及び約定値段）

第16条 バイインによる売買は、買付けの申込みに対して、売付申込値段の低い売付けの申込みから順次対当させるものとする。この場合において、売付申込数量が買付申込数量を超えることとなる値段の売付けの申込みの対当順位は、次のとおりとする。

- (1) 売付けの申込みを行っている現物清算参加者単位により当該値段による申込数量の多い現物清算参加者から少ない現物清算参加者の順序（申込数量が同一の現物清算参加者については抽選による。）で最小単位をそれ以外の部分の数量に優先させ、対当させる。
 - (2) 最小単位以外の数量については、現物清算参加者単位でその数量に比例させ、対当させる。ただし、最小単位未満の端数が生じた場合は、その端数を切り捨てる。
 - (3) 前号ただし書の規定により切り捨てた分については、切捨数量の多い現物清算参加者から最小単位を順次対当させる。ただし、その数量が同一の現物清算参加者については、抽選により対当させる。
- 2 バイインによる売買の約定値段は、前項の規定により売買が成立する売付申込値段のうち最も高い値段とする。
 - 3 バイインの買付けの申込みの数量に、それに対する売付けの申込みの数量が満たない場合における当該買付けの申込みの対当順位は当社が定める。

付 則

- 1 この規則は、平成15年1月14日から施行する。
- 2 商法等の一部を改正する法律（平成13年法律第128号）附則第7条第1項の規定によりなお従前の例によるとされた転換社債又は新株引受権付社債は、それぞれ、転換

社債型新株予約権付社債又は転換社債型新株予約権付社債以外の新株予約権付社債とみなして、この規則を適用する。

付 則

この改正規定は、平成15年4月1日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成16年2月2日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成16年3月9日から施行する。

付 則

- 1 この改正規定は、当社が定める日から施行する。
- 2 この改正規定施行の日に日本証券業協会において登録取消しとなり、かつ、他の指定有価証券市場に上場されなかった銘柄については、改正後の第2条又は第10条の規定にかかわらず、なお従前の例による。

(注) 第1項の「当社が定める日」は平成16年12月13日。

付 則

この改正規定は、平成17年6月10日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成18年1月30日から施行する。

付 則

- 1 この改正規定は、平成18年5月1日から施行する。
- 2 前項の規定にかかわらず、会社法の施行に伴う関係法律の整備等に関する法律（平成17年法律第87号）第105条の規定によりなお従前の例によるとされた合併による解散により上場廃止となった銘柄については、なお従前の例による。

付 則

この改正規定は、平成19年9月30日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成19年11月1日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成21年1月5日から施行する。

付 則

- 1 この改正規定は、平成21年11月16日から施行する。
- 2 改正後の第2条第1項第1号及び第2号の規定は、この改正規定施行の日以後に当社が債務の引受けを行う清算約定の決済に係る取扱いから適用する。
- 3 改正後の第4条第3項の規定は、平成21年11月19日に決済を行う銘柄に係る取扱いから適用する。
- 4 改正後の第10条の規定にかかわらず、次の各号に掲げる銘柄にかかるバイイン請求については、なお従前の例による。
 - (1) 平成21年11月16日、同月17日又は同月18日が業務方法書第64条第3項各号に掲げる日のいずれかに該当する銘柄
 - (2) この改正規定施行の際、現に改正前の第10条第1項第3号に規定する銘柄に該当する銘柄
- 5 改正後の第15条第1項第5号の規定は、平成21年11月19日以後に業務方法書第64条第3項各号に掲げる日のいずれかに該当する銘柄に係るバイインによる売買の売付申込から適用する。

付 則

この改正規定は、平成22年7月16日から施行する。