

清算・決済規程

第1章 総則

(目的)

第1条 この規程は、業務規程第4条第2項の規定に基づき、当取引所の市場における有価証券の売買に係る清算及び決済に関して必要な事項を定める。

2 この規程の変更は、取締役会の決議をもって行う。ただし、変更の内容が軽微である場合は、この限りでない。

(用語の意義)

第2条 この規程において使用する有価証券の売買に係る用語（株券を除く。）の意義は、この規程に別に定める場合を除き、業務規程並びに立会外市場に関する業務規程及び受託契約準則の特例（以下「立会外市場特例」という。）において定めるところによるものとする。

(金融商品債務引受業を行う者の指定)

第3条 当取引所は、当取引所の市場において成立した有価証券（株式会社証券保管振替機構（以下「保管振替機構」という。）の取扱銘柄でない債券等を除く。）の売買に関し、金融商品債務引受業を行わせる金融商品取引清算機関として、株式会社日本証券クリアリング機構（以下「クリアリング機構」という。）を指定する。

第2章 清算参加者の決済

(清算参加者の決済)

第4条 当取引所の市場において成立した有価証券のうち、保管振替機構の取扱銘柄でない債券等以外の有価証券の売買の決済は、クリアリング機構の業務方法書の定めるところにより清算参加者（現物清算資格（クリアリング機構の業務方法書に規定する現物清算資格をいう。以下同じ。）を有する者をいう。以下同じ。）とクリアリング機構との間で行い、保管振替機構の取扱銘柄でない債券等の売買の決済は、取引参加者間で行う。

第3章 非清算参加者と清算参加者との間の決済

(受渡時限)

第5条 非清算参加者（取引参加者規程第32条に規定する非清算参加者をいう。以下同じ。）は、有価証券等清算取次ぎの委託に基づく有価証券（保管振替機構の取扱銘柄でない債券等を除く。以下第22条までにおいて同じ。）の売買について、クリアリング機構が定める決済時限までの指定清算参加者（当該非清算参加者が取引参加者規程第34条第1項の規定により指定した他社清算参加者（現物清算資格に係る他社清算資格（クリアリング機構の業務方法書に規定する他社清算資格をいう。）を有する者をいう。）をいう。以下同じ。）が指定する日時までに、引き渡すべき有価証券又は支払うべき金銭を指定清算参加者に交付するものとする。

(DVP決済を利用する場合の受渡し)

第6条 有価証券等清算取次ぎの委託に基づく有価証券の売買について、非清算参加者と指定清算参加者との合意により、株式会社ほふりクリアリング（以下「ほふりクリアリング」という。）の業務方法書に規定するDVP決済を利用する場合には、非清算参加者は、ほふりクリアリングが定める決済時限（有価証券の引渡しについては、合意に際して指定清算参加者が指定したクリアリング機構が定める決済時限までの間の日時）までに、ほふりクリアリングに有価証券を引き渡し又は資金を支払うものとする。

2 非清算参加者が前項の規定に基づき有価証券の引渡し又は資金の支払いをした場合は、当該有価証券の引渡し又は資金の支払いは、前条の有価証券の交付又は金銭の交付とみなす。

(決済のために授受する金銭及び有価証券)

第7条 有価証券等清算取次ぎの委託に基づく有価証券の売買の決済のために非清算参加者と指定清算参加者との間で授受する金銭の額及び有価証券の数量は、次の各号に定めるところによる。

(1) 普通取引、発行日決済取引及び立会外市場特例第4条第2号に規定する日に決済を行う立会外取引(それぞれの取引に係る過誤訂正等のための売買を含む。)に係る決済

決済日を同一とする同一非清算参加者の総売付代金と総買付代金の差引額及び銘柄ごとの有価証券の売付数量と買付数量の差引数量

(2) 当日決済取引及び立会外市場特例第4条第1号に規定する日に決済を行う立会外取引(それぞれの取引に係る過誤訂正等のための売買を含む。)の決済

決済日を同一とする同一非清算参加者の総売付代金と総買付代金の差引額及び銘柄ごとの有価証券の売付数量と買付数量の差引数量

(旧株券と新株券の銘柄併合時の取扱い)

第8条 株券(優先出資証券、投資信託受益証券及び投資証券を含む。以下この条において同じ。)について、旧株券と新株券との双方が既に上場されているか又はその一方が既に上場され他の一方が新たに上場されることとなった場合で、その権利義務が同一となり、両者を併合して売買を行うこととなった場合には、当該売買開始の日以降に到来する決済については、これらを同一に取り扱うものとする。

2 前項の規定にかかわらず、発行日決済取引の決済については、旧株券をもってこれに代えることができない。

(有価証券の決済の繰延べ)

第9条 非清算参加者は、有価証券等清算取次ぎの委託に基づく有価証券の売買についてやむを得ない事由によって第5条に規定する受渡時限までに有価証券の引渡しを行うことができない場合において、指定清算参加者の承諾を受けたときは、当該取引所の定めるところにより、当該有価証券の引渡しを翌日(休業日に当たるときは、順次繰り下げる。)に繰り延べることができる。

(発行日決済取引の清算値段)

第10条 発行日決済取引の清算値段は、クリアリング機構が、発行日取引の清算値段として定める値段とする。

(発行日決済取引の約定値段と清算値段との差額の支払い)

第11条 非清算参加者は、有価証券等清算取次ぎの委託に基づく発行日決済取引について、約定値段と売買契約締結の日の清算値段とを比較して差額を生じたときは、その差額に相当する金銭を指定清算参加者との間で授受するものとする。この場合において、金銭を支払う非清算参加者は、当該差額に相当する金銭を、クリアリング機構が定める決済時限までの指定清算参加者が指定する日時までに、当該指定清算参加者に交付するものとする。

(発行日決済取引の清算値段間の差額の支払い)

第12条 非清算参加者は、有価証券等清算取次ぎの委託に基づく発行日決済取引について、当該日の清算値段と前日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。以下同じ。)の清算値段とを比較して差額を生じたときは、その差額に相当する金銭を指定清算参加者との間で授受するものとする。この場合において、金銭を支払う非清算参加者は、当該差額に相当する金銭を、クリアリング機構が定める決済時限までの指定清算参加者が指定する日時までに、当該指定清算参加者に交付するものとする。

(発行日決済取引の決済値段)

第13条 発行日決済取引の決済値段は、当該発行日決済取引の最終日の清算値段とする。

(発行日決済取引の売買証拠金)

第14条 非清算参加者は、有価証券等清算取次ぎの委託に基づく発行日決済取引が成立したときは、当該取引所が定めるところにより算出した額以上の売買証拠金を売買契約締結の日から起算して4日目(休

業日を除外する。以下日数計算において同じ。)の日の正午までの指定清算参加者が指定する日時までに、当該指定清算参加者に預託するものとする。ただし、当該銘柄の売付け又は買付けに対当する買付け又は売付けがある場合においては、その総売付数量と総買付数量との差引数量につき算出した額の売買証拠金の預託があれば足りるものとする。

2 前項の売買証拠金は、当取引所が定める規則に従い、有価証券をもって代用預託することができる。

第4章 未決済取引の取扱い

第1節 清算資格の取得及び指定清算参加者の変更の場合の未決済取引の取扱い

(現物清算資格取得の場合の未決済取引の取扱い)

第15条 非清算参加者である取引参加者が新たに現物清算資格を取得した場合には、当該取引参加者の有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引で未決済のものは、当該現物清算資格を取得したとき以降、当該取引参加者の名における有価証券の売買とする。

(指定清算参加者の変更の場合の未決済取引の引継ぎ)

第16条 取引参加者規程第34条第2項の規定に基づき指定清算参加者を変更した場合には、当該非清算参加者の有価証券等清算取次ぎの委託に基づく有価証券の売買で未決済のものは、当該変更をしたとき以降、変更後の指定清算参加者に対する有価証券等清算取次ぎの委託に基づく有価証券の売買とする。

2 前項の規定は、清算参加者が非清算参加者となる場合において、取引参加者規程第34条第2項の規定に基づき指定清算参加者の指定をしたときについて準用する。この場合において、「当該非清算参加者の有価証券等清算取次ぎの委託に基づく有価証券の売買で未決済のもの」とあるのは「当該非清算参加者となる者の取引で未決済のもの」と、「変更後の指定清算参加者」とあるのは「新たに指定清算参加者として指定された者」と読み替えるものとする。

第2節 有価証券の売買の停止又は有価証券等清算取次ぎの委託の停止等の場合の未決済取引の取扱い

(取引資格の喪失を申請したことにより有価証券の売買の停止等を受けた取引参加者に対する措置)

第17条 当取引所は、取引参加者規程第38条第1項の規定により、有価証券の売買(有価証券等清算取次ぎによるものを除く。以下この節において同じ。)又は有価証券等清算取次ぎの委託を停止したときは、当該取引資格の喪失申請者の当取引所の市場における有価証券の売買又は有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引及びこれらに関する取引で未決済のもの他の取引参加者への引継ぎその他当取引所が必要と認める整理を行わせることができる。

(取引資格を喪失した者の未決済の有価証券の売買の決済)

第18条 取引資格を喪失した者の当取引所の市場における有価証券の売買又は有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引に未決済のものがある場合は、本人又は一般承継人をして、その決済を行わせるものとする。ただし、本人又はその承継人に決済させることが適当でないと認めるときは、当取引所は、他の取引参加者をして、これを行わせることができる。

2 前項の場合において、当取引所が必要と認めた場合には、当取引所の市場における有価証券の売買又は有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引及びこれらに関する取引で未決済のもの他の取引参加者への引継ぎその他当取引所が必要と認める整理を行わせることができる。

3 当取引所は、必要があると認めるときは、前項に定める整理を、他の取引参加者をして行わせることができる。この場合においては、その取引参加者と同項の有価証券の売買又は有価証券等清算取次ぎの委託の停止の処置を受けた取引参加者との間に委任契約が成立していたものとする。

(支払不能による有価証券の売買の停止等を受けた取引参加者に対する措置)

第19条 当取引所は、取引参加者に対して、取引参加者規程第46条第3項又は第4項の規定により当取引所の市場における有価証券の売買若しくは有価証券等清算取次ぎの委託の停止の処置を行った場

合又は同第51条第1項の規定により有価証券の売買の停止の措置（クリアリング機構の業務方法書第29条第5項又は第76条第5項の規定による債務の引受けの停止が行われたことによる措置に限る。）を行った場合には、当該取引参加者の当取引所の市場における有価証券の売買又は有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引及びこれらに関する取引で未決済のもの他の取引参加者への引継ぎその他当取引所が必要と認める整理を行わせることができる。

2 前条第3項の規定は、前項の規定により整理を行わせる場合について準用する。

（指定清算参加者が清算資格の取消し等を受けた場合における非清算参加者に対する措置）

第20条 当取引所は、非清算参加者である取引参加者に対し、取引参加者規程第52条第1項の規定により、有価証券等清算取次ぎの委託の停止の措置（クリアリング機構の業務方法書第29条第5項又は第76条第5項の規定による債務の引受けの停止が行われたことによる措置に限る。）を行った場合には、当該非清算参加者の有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引及びこれに関する取引で未決済のもの他の取引参加者への引継ぎその他当取引所が必要と認める整理を行わせることができる。

2 第18条第3項の規定は、前項の規定により整理を行わせる場合に準用する。

（当取引所の市場における有価証券の売買の停止又は制限を受けた取引参加者に対する措置）

第21条 当取引所が取引参加者規程に基づき取引参加者に対して行った処分、処置又は措置が、当取引所の市場における有価証券の売買若しくは有価証券等清算取次ぎの委託の停止又は制限である場合（第17条、第19条又は前条の規定の適用がある場合を除く。）には、当該取引参加者は、当取引所の承認を受けて、その期間中、当該取引参加者の当取引所の市場における有価証券の売買又は有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引及びこれらに関する取引で未決済のものを、他の取引参加者に引き継ぐことができる。

第5章 雑則

（天災地変等の場合における非常措置）

第22条 当取引所は、有価証券等清算取次ぎの委託に基づく当取引所の市場における有価証券の売買に係る非清算参加者の決済が、天災地変、経済事情の激変、品不足その他やむを得ない理由に基づいて、不可能又は著しく困難であると認められるに至ったときは、取締役会の決議により、その取引について、決済の条件を改めて定めることができる。

2 前項の規定により当取引所が決済の条件を定めたときは、非清算参加者は、これに従わなければならない。

3 第1項の場合において、緊急の必要があるときは、当取引所は、取締役会の決議を経ずに、決済の条件を改めて定めることができる。

（発行日決済取引の売買契約の解消等）

第23条 当取引所は、有価証券等清算取次ぎの委託に基づく発行日決済取引につき、その対象株券の発行条件が変更される場合又はその決済期日までに当該対象株券が発行されない場合若しくは発行されないと認められる場合には、当該発行日決済取引に係る非清算参加者の決済について決済物件若しくは決済期日の変更又は売買契約の解消に関する措置を行うことができる。

2 前項の規定は、優先出資証券及び投資信託受益証券について準用する。

（保管振替機構非取扱銘柄の特例）

第23条の2 保管振替機構の取扱銘柄でない債券等の売買の決済のために取引参加者間で授受する金銭の額及び債券等の数量は、売買契約締結ごとの売買代金の額及び債券等の数量とする。

2 抽選により償還されることが確定している債券等（以下「抽選償還当選債券」という。）が、当該当選番号発表の日以降、決済のために用いられた場合は、当該抽選償還当選債券を受領した受方取引参加者は、当該抽選償還当選債券を交付した渡方取引参加者に当該銘柄の他の債券等との引換えを請求することができる。この場合においては、当該受方取引参加者及び当該渡方取引参加者は、クリアリング機構が定める抽選償還当選債券の引換処理に関する規則に準じて、両者の間で抽選償還当選債券の引換処

理を行うものとする。

- 3 保管振替機構の取扱銘柄でない債券等の売買の決済の決済時限は、決済日の午後2時45分までとする。
- 4 第22条の規定は、第1項の決済について準用する。この場合において、第1項中「有価証券等清算取次ぎの委託に基づく当取引所の市場における有価証券の売買に係る非清算参加者」とあるのは「当取引所の市場における保管振替機構の取扱銘柄でない債券等の売買に係る取引参加者」と、第2項中「非清算参加者」とあるのは「取引参加者」と読み替える。

(有価証券の売買の清算及び決済に関する必要事項の決定)

第24条 当取引所は、この規程に定める事項のほか、当取引所の市場における有価証券の売買の清算及び決済に関して必要がある場合には、所要の取扱いについて規則により定めることができる。

付 則

この規程は、当取引所が定める日から施行する。

(注) 「当取引所が定める日」は平成21年6月1日

付 則

この改正規定は、平成23年5月17日から施行する。