

充用有価証券に関する取扱要綱

この要綱は、業務方法書第61条第3項及び取引証拠金等に関する規則第9条第1項に基づき、清算預託金及び取引証拠金に充用する有価証券等の取扱いについて定めたものである。

1. 充用できる種類及び銘柄

- (1) 国債
- (2) 地方債
- (3) 日本銀行の発行する出資証券
- (4) 特別の法律により法人の発行する債券（以下「特殊債」という。）
- (5) 社債
東京及び名古屋証券取引所のいずれかの開設する市場の上場社債とする。
- (6) 転換社債型新株予約権付社債
東京及び名古屋証券取引所のいずれかの開設する市場の株式第1部上場会社の発行する上場転換社債型新株予約権付社債とする。
- (7) 株式
東京及び名古屋証券取引所のいずれかの開設する市場の第1部上場銘柄及び第2部上場銘柄、福岡証券取引所の開設する市場の地方単独銘柄及び東京証券取引所の開設するJASDAQ市場（スタンダードに限る。以下同じ。）の上場銘柄（外国株式を含む。以下同じ。）とする。
ただし、上記の第2部上場銘柄、地方単独銘柄及びJASDAQ市場銘柄にあっては、4に定める充用指定の要件に適合したものに限り。
- (8) 信託法第185条第1項に規定する受益証券（以下「信託証券」という。）
東京、名古屋及び福岡証券取引所のいずれかの開設する市場の上場信託証券とする。
- (9) 投資信託及び投資法人に関する法律第2条第7項に規定する受益証券（以下「投資信託証券」という。）
東京、名古屋及び福岡証券取引所のいずれかの開設する市場の上場投資信託証券（外国投資信託受益証券等及び外国受益証券発行信託の受益証券等を含む。以下同じ。）とする。
- (10) 貸付信託法第2条第2項に規定する受益証券（以下「貸付信託証券」という。）
信託銀行の募集発行する回号ごとの貸付信託証券で、信託契約取扱期間終了の日から1年以上経過したものに限り。

(1 1) 投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 1 5 項に規定する投資証券（以下「投資証券」という。）

東京、名古屋及び福岡証券取引所のいずれかの開設する市場の上場投資証券とする。

(1 2) 投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 2 0 項に規定する投資法人債券（以下「投資法人債券」という。）

東京、名古屋及び福岡証券取引所のいずれかの開設する市場の上場投資法人債券とする。

(1 3) 投資信託及び投資法人に関する法律第 2 2 0 条第 1 項に規定する外国投資証券（新投資口予約権証券に類する証券を除く。以下「外国投資証券」という。）

東京、名古屋及び福岡証券取引所のいずれかの開設する市場の上場外国投資証券とする。

(1 4) 指定倉荷証券

各商品取引所が定めるところにより、取引の決済のため受渡しの目的物とすることができる上場商品の保管を証する倉荷証券とする。

ただし、充用は取引証拠金に限る。

(注) ① 充用有価証券等は、次のものをもって充用可能とする。

(1)、(2)、(4)、(5)、(6) 及び (1 0) にあつては本券及びその権利の帰属が社債、株式等の振替に関する法律（平成 1 3 年法律第 7 5 号。以下「振替法」という。）の規定による振替口座簿の記載又は記録により定まるものとされるもの。

(3) 及び (1 4) にあつては、本券。

(7) から (9) まで及び (1 1) から (1 3) までの株式等にあつては、その権利の帰属が振替法の規定による振替口座簿の記載又は記録により定まるものとされるもの。また、外国株式、外国投資信託受益証券等、外国受益証券発行信託の受益証券等又は外国投資証券にあつては、その権利の帰属が振替法及び一般振替機関の監督に関する命令（平成 1 4 年内閣府・法務省令第 1 号。）に定める主務大臣の承認を受けた一般振替機関の兼業業務の運営に関する規則に基づき、外国株券等振替口座簿の記載又は記録により定まるものとされるもの。

② 記名式証券については、質権設定手続きを行い、所要書類の添付又は譲渡形式の整ったものに限る。

③ 運用預り等による預り証の充用は認めない。

④ 清算参加者の自社銘柄（清算参加者の持株会社の株式等であつて当

該清算参加者の経営が当該株価に著しく影響を与える銘柄を含む。)については、自己分の取引証拠金、差換預託分の取引証拠金及び清算預託金に充用することができない。

2. 預託単位

- (1) 国債、地方債、特殊債及び社債は、発行元が定めた最小金額又はその整数倍の金額とする。
- (2) 日本銀行出資証券は、100口とする。
- (3) 転換社債型新株予約権付社債、株式、上場信託証券、上場投資信託証券、上場投資証券、上場投資法人債券及び上場外国投資証券は、各証券取引所が定めた売買単位とする。
- (4) 貸付信託証券は、銘柄ごとに、額面金額（元本1口1万円）又はその整数倍の金額とする。
- (5) 指定倉荷証券は、各商品取引所が定めた受渡単位とする。

3. 充用価格

- (1) 国債
 - ① 利付国債
超長期及び長期は額面金額の80%、中期は額面金額の85%とする。
 - ② 国庫短期証券
額面金額の85%とする。
 - ③ 割引国債（国庫短期証券を除く。）
額面金額の75%とする。
- (2) 地方債
額面金額の70%とする。
- (3) 日本銀行出資証券
時価の85%とする。
ただし、充用価格は、500円刻み（端数は切捨て）とする。
- (4) 特殊債
利付債、割引債ともそれぞれ額面金額の50%とする。
- (5) 社債
額面金額の50%とする。
- (6) 転換社債型新株予約権付社債
額面金額の50%とする。
- (7) 株式
東京及び名古屋証券取引所のいずれかの開設する市場の第1部上場銘柄

は、時価（円未満切り捨て。以下同じ。）の70%。同取引所の開設する市場の第2部上場銘柄及び福岡証券取引所の開設する市場の地方単独銘柄は、時価の60%。東京証券取引所の開設するJASDAQ市場銘柄は、時価の50%とする。

ただし、充用価格の100円未満は5円刻み、100円以上は10円刻み（端数は切捨て）とする。

(8) 上場信託証券、上場投資信託証券、上場投資証券、上場投資法人債券及び上場外国投資証券

時価の65%とする。

ただし、充用価格の100円未満は5円刻み、100円以上は10円刻み（端数は切捨て）とする。

(9) 貸付信託証券

額面金額の70%とする。

(10) 指定倉荷証券

帳入値段を用いて算出した時価の70%とする。

ただし、充用価格の1,000円未満は切捨てとする。

(注) 当社が特に必要と認めるときは、上記にかかわらず充用価格を変更することができる。

4. 特定の銘柄に係る充用の指定及び見直し等

(1) 特定の銘柄に係る充用の指定及び見直しは、当社が次の基準により毎年7月に行う。

① 第2部銘柄及び地方単独銘柄にあつては、それぞれ開設する市場における年間値付日数125日以上又は年間出来高1,000単位以上であつて、かつ、資本金8億円以上、年間配当があること。

② JASDAQ市場銘柄にあつては、年間値付日数125日以上、年間出来高1,000単位以上、株主数3,000人以上であつて、かつ、資本金8億円以上、年間配当があること。

(2) その他当社が必要と認めるときは、充用の指定及び見直しを行うことができる。

5. 充用価格の算出基準日及び実施期間

(1) 算出基準日は、毎月10日（休日の場合は、順次繰り上げる。）とし、実施期間は、その月の25日（休日の場合は、順次繰り下げる。）から翌月の24日までとする。

- ただし、価格表の作成に困難が生じる場合は、変更することができる。
- (2) 指定倉荷証券の算出基準日については、当該商品取引所が定めるところによる。
 - (3) その他当社が必要と認めるときは、充用できる種類及び銘柄ごとに算出基準日又は実施期間を定めることができる。

6. 株式等の採用値順位及び上場市場変更時の充用指定市場等

(1) 株式

- ① 時価は、当社が銘柄毎に指定した上場市場（以下本項において「充用指定市場」という。）の最終出来値を採用し、不申の場合は当日の気配値を採用する。

なお、東京証券取引所第1部及び名古屋証券取引所第1部に重複上場している銘柄又は東京証券取引所第2部及び名古屋証券取引所第2部に重複上場している銘柄に関し、充用指定市場が不申の場合は、他方の最終出来値を採用する。

また、東京及び名古屋証券取引所の何れも不申の場合は、当該銘柄の充用指定市場に関わらず、東京証券取引所、名古屋証券取引所の順に当日の気配値を採用する。

（同順位において、新株発行、合併等により時価が二以上生じたときは、最も低い価格を採用する。）

- ② 充用有価証券の上場市場が変更される場合の充用指定市場について次のとおり定める。

ア. 東京証券取引所第1部又は名古屋証券取引所第1部のいずれかに上場されるとき 当該上場市場

イ. 東京証券取引所第1部及び名古屋証券取引所第1部に重複上場されるとき 東京証券取引所第1部

ウ. 東京証券取引所第1部又は名古屋証券取引所第1部のいずれかに上場している銘柄が、東京証券取引所第1部又は名古屋証券取引所第1部以外の上場市場に変更されるとき 充用取消

エ. 東京証券取引所第1部及び名古屋証券取引所第1部以外の上場市場において、充用指定市場以外の上場市場に変更されるとき 充用取消

- (2) 上場信託証券、上場投資信託証券、上場投資証券、上場投資法人債券及び上場外国投資証券

株式の採用値順位に準ずる。

- (3) 指定倉荷証券

時価が二以上生じたときは、最も低い価格を採用する。

- (4) その他当社が必要と認めるときは、株式等の採用値順位を変更することができる。

7. 充用の制限、取消し及び一時停止

- (1) 3の(4)、(5)及び(6)に掲げる場合であって、当該有価証券の時価に商品先物取引法施行規則第39条第1項に規定するそれぞれの割合を乗じて得た価格が所定の充用価格未満となるものは充用できないものとする。
- (2) 3の(7)及び(8)に掲げる場合であって、充用価格が5円未満となった銘柄については当該銘柄の充用を一時停止することができる。なお、充用価格が5円以上となった場合は、当該銘柄の充用の一時停止を解除できるものとする。
- (3) 証券取引所が整理銘柄等に指定した銘柄については、遅滞なく充用を取消し、当該実施期間における再充用は行わないものとする。
- (4) 証券取引所が売買停止を決定した銘柄（株式併合及び株式分割に係る売買停止銘柄を除く。）については、当該銘柄の充用を一時停止することができる。
- (5) その他当社が必要と認めるときは、充用の制限、取消し及び一時停止を行うことができる。

8. 充用価格の臨時変更

- (1) 時価が充用価格を下廻った銘柄については、その日を評価変更日として充用価格を変更する。変更された新充用価格は、当社がその旨を清算参加者に通知した日の翌営業日から実施する。
- (2) 前号にかかわらず充用価格の実施期間開始日の前営業日においては、充用価格を変更しない。
- (3) 株式分割又は株式併合等の場合は、当該株式等の直近の最終出来値を基準に充用価格を変更するものとする。
- (4) 前三号にかかわらず当社が必要と認めるときは、充用価格を定めることができる。

9. 預託数量の制限

- (1) 清算参加者が預託する東京及び名古屋証券取引所の第1部上場銘柄以外の銘柄にあつては、一清算参加者が自己分の取引証拠金、差換預託分の取引証拠金及び清算預託金として預託できる合計数量は、当該銘柄の年間出来高を証券取引所の年間営業日数で除した数量（以下「平均出来高」とい

う。)までの数量とする。

(注)「年間出来高」は、4の特定の銘柄に係る充用の指定及び見直しを当社が行うときの前年1月から12月までの年間累計出来高とする。

(2) (1)のほか円滑かつ的確な充用有価証券の換金の実施等のため特に必要があると認めるとき、当社は充用有価証券の同一銘柄の数量を制限することができるものとする。

(3) その他当社が必要と認めるときは、預託数量を変更することができる。

10. 清算参加者銘柄の充用

清算参加者銘柄の充用にあつては、4の特定の銘柄に係る充用の指定及び見直しの規定にかかわらず当該銘柄を上場している清算参加者から充用の申請を受けた場合には、代表取締役社長の決裁をもって当該清算参加者銘柄の充用指定を行うことができるものとする。ただし、当該銘柄については自己分の取引証拠金、差換預託分の取引証拠金及び清算預託金に充用することができない。

11. 充用有価証券価格表

充用有価証券価格表は、当社において作成する。

12. 充用有価証券価格データ等の配信及び制限

(1) 当社は、充用有価証券価格データについて、清算参加者等が委託者等の取引証拠金等を計算する目的に使用する場合に限り、別に定めるところにより、電子的な方法又はプリントアウトした媒体をファックス等により配信することができる。

(2) 前項において、当社から充用有価証券価格データの配信を受けた清算参加者等は、当該配信を受けた充用有価証券価格データの一部又は全部について、複製又は第三者への配信を行ってはならない。

13. 充用有価証券等の取扱い

清算参加者は、清算預託金及び取引証拠金に充用する有価証券等を当社に預託する場合には、株式会社だいこう証券ビジネスに設けられた当社名義の口座への振替等により当該預託を行うものとする。

14. 本要綱の改廃

本要綱の改廃は、代表取締役社長の決裁をもって行うものとする。

附 則

この要綱は、平成17年5月1日から実施する。

附 則

前文の改正は、平成17年8月16日から施行し、平成17年10月11日から適用する。

附 則

前文、1.、4.、10. 及び11. の改正は、平成18年4月1日から実施する。

附 則

前文の改正は、平成19年1月1日から実施する。

附 則

9. 及び10. の改正は、平成19年7月4日から施行し、平成19年10月25日から適用する。

附 則

1 1.、2.、3.、4.、5.、6.、7.、8.、9.、12. 及び13. の改正は、平成20年4月10日から施行し、平成20年5月1日から実施する。

2 前項の実施日において、現に本券による預託を受けている株式については、平成20年7月31日まで、なお従前の例によるものとする。

附 則

7. の改正は、平成20年9月25日から施行し、平成20年10月1日から実施する。

附 則

前文の改正は、平成21年4月30日から施行し、1.、2.、3.、4.、7. の改正は、平成21年7月25日から実施する。

附 則

4.、9. 及び10. の改正は、平成21年8月25日から実施する。

附 則

前文の改正は、平成21年10月13日から実施する。

附 則

前文の改正は、平成21年12月25日から実施する。

附 則

3. 及び6. の改正は、平成22年2月22日から実施する。

附 則

前文の改正は、平成22年3月23日から実施する。

附 則

1.、2.、3.、4. 及び6. の改正は、平成22年7月1日から施行し、平成22年7月25日から実施する。

ただし、1. (8) の改正については、平成22年9月1日から実施し、実施日における充用価格の算出基準日は平成22年8月30日とする。

附 則

前項の附則の改正は、平成22年8月11日から施行する。

附 則

前文の改正は、平成22年10月12日から実施する。

附 則

7. の改正は、平成23年1月1日から実施する。

附 則

前文の改正は、平成23年2月23日から実施する。

附 則

5. の改正は、平成23年9月30日から実施する。

附 則

12. から14. までの改正は、平成24年10月26日から実施する。

附 則

前文の改正は、平成25年2月12日から実施する。

附 則

1.、3.、4.、6.、8. 及び9. の改正は、平成25年7月16日から実施する。

附 則

2. の改正は、平成26年4月21日から実施する。

附 則

3. の改正は、平成26年7月22日から実施する。

附 則

1. 及び6. の改正は、平成27年6月1日に施行し、平成27年6月25日の充用有価証券価格表から適用する。

附 則

3. の改正は、平成28年1月25日から実施する。