

社発第 77 号
平成 21 年 10 月 23 日

貸借取引参加者
代表者 殿

中部証券金融株式会社
取締役社長 湯本 崇雄

「貸借取引貸株超過銘柄等に対する取扱い」等の一部改定について

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、「株券等の 5 日目決済及び期間売買停止の廃止」について、既に(株)名古屋証券取引所は、本年 11 月 16 日(月)を実施予定日とする旨を公表しておりますが、今般当社は、これに伴い、品貸料率にかかる決定方法等の一部見直すことといたしました。

つきましては、「貸借取引貸株超過銘柄等に対する取扱い」等の一部改定を下記のとおり実施いたしますので、ご通知申し上げます。

敬 具

記

1. 改定を行う規程

- (1) 「貸借取引貸株超過銘柄等に対する取扱い」の一部改定 ……別紙 1
 - ・現在、権利付最終日における貸借申込み分については、その翌営業日における取引所取引の決済が 5 日目決済となることに付随して、貸付日の翌々営業日が返済期日となるため、品貸料の計算期間は 2 日となっております。5 日目決済廃止後は、当該貸借申込み分にかかる品貸料の計算期間が 1 日に短縮されるため、実質的な品貸料率の水準が変化しないように権利付最終日の倍率適用にかかる倍率を 4 倍(現行 2 倍)とします。
- (2) 「貸借値段の決定基準」の一部改定 ……別紙 2
- (3) 「貸借取引に付随する剰余金の配当及び株式分割等による株式を受ける権利等の処理要領」の一部改定 ……別紙 3
 - ・上記(2)(3)の規程について、5 日目決済及び期間売買停止の廃止に対応して所要の改定を行います。

2. 実施日

平成 21 年 11 月 16 日(同日以降の貸借申込み分より適用いたします。)

なお、(株)名古屋証券取引所における「株券等の 5 日目決済及び期間売買停止の廃止」の実施日が変更された場合、上記実施日はその変更後の実施日とします。

以 上

「貸借取引貸株超過銘柄等に対する取扱い」一部改定新旧対照表

平成21年11月16日一部改定実施

(下線部分は改定箇所)

改 定 後	現 行
<p>貸借取引貸出し規程第12条、第13条及び第23条に規定する貸借取引の貸株超過銘柄または貸受益証券超過銘柄に対する取扱いを次のとおり定める。</p>	<p>貸借取引貸出し規程第12条、第13条及び第23条に規定する貸借取引の貸株超過銘柄または貸受益証券超過銘柄に対する取扱いを次のとおり定める。</p>
<p>1. ~ 10. (現行どおり)</p>	<p>1. ~ 10. (省 略)</p>
<p>(別表) (現行どおり)</p>	<p>(別表) (省 略)</p>
<p>1. 貸株不足が2日以上継続するときは、2日目からその期間中1日について10銭を増し、その加算累計額の限度は1円とする。</p>	<p>1. 貸株不足が2日(権利の割当等の関係で貸借取引の申込みを受け付けない日を除く。以下継続日数の計算方法において同じ。)以上継続するときは、2日目からその期間中1日について10銭を増し、その加算累計額の限度は1円とする。</p>
<p>2. 次に定める銘柄の貸借申込み分にかかる品貸料率については、(1)~(3)の各区分に定める料率とする。ただし、(1)に該当し、かつ(2)又は(3)に該当する場合は、(1)の該当する料率の2倍とする。</p>	<p>2. 次に定める銘柄の貸借申込み分にかかる品貸料率については、<u>上記料率を2倍とし、また、(1)に該当し、かつ(2)又は(3)に該当する銘柄については、4倍とする。</u></p>
<p>(1) 取引所において配当落もしくは権利落とする期日<u>が定められた銘柄又は株式会社証券保管振替機構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期日又は総株主通知にかかる株主を確定するための日の2営業日前の日を「期日」という。)</u></p>	<p>(1) 取引所において配当落もしくは権利落とする期日(株式会社証券保管振替機構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を行うため取引所が必要と認める日を含む。)の6営業日前から前営業日までの貸借申込み分</p>
<p><u>期日の6営業日前から2営業日前までの貸借申込み分</u></p>	
<p><u>上記料率の2倍</u></p>	
<p><u>期日の前営業日の貸借申込み分</u></p>	
<p><u>上記料率の4倍</u></p>	
<p>(2) 貸株利用等に関する注意喚起通知を行った銘柄については、その通知日の翌日から取消し通知日までの貸借申込み分</p>	<p>(2) 貸株利用等に関する注意喚起を行った銘柄については、その通知日の翌日から取消し通知日までの貸借申込み分</p>
<p><u>上記料率の2倍</u></p>	
<p>(3) 貸借取引の申込制限措置又は申込停止措置を行った銘柄については、その実施日から解除日の前日までの貸借申込み分</p>	<p>(3) 貸借取引の申込制限措置又は申込停止措置を行った銘柄については、その実施日から解除日の前日までの貸借申込み分</p>
<p><u>上記料率の2倍</u></p>	
<p>ただし、継続日数1日加算額および加算累計限度額は、上記1.に定めるとおりとする。</p>	<p>ただし、継続日数1日加算額および加算累計限度額は、上記1.に定めるとおりとする。</p>
<p>3. ~ 5. (現行どおり)</p>	<p>3. ~ 5. (省 略)</p>

「貸借値段の決定基準」一部改定新旧対照表

平成21年11月16日一部改定実施

(下線部分は改定箇所)

改 定 後	現 行
<p>貸借取引貸出し規程第15条に規定する貸借値段は、この基準により決定する。</p> <p>1 . (現行どおり)</p> <p>2 . 前項によって、貸借値段の決定できない銘柄については、申込日の前日の貸借値段をもってその日の貸借値段とする。ただし、<u>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。</u></p> <p>(1) <u>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等にかかる権利落日(「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銘柄の呼値の単位未満は切捨てる。)</u></p> <p>(2) <u>申込日当日が当該銘柄の株式併合にかかる権利落日にあたる時は、前日の貸借値段を併合比率(株式併合後の発行済株式総数を併合前の発行済株式総数で除して得た数をいう。)で除して得た額</u></p>	<p>貸借取引貸出し規程第15条に規定する貸借値段は、この基準により決定する。</p> <p>1 . (省 略)</p> <p>2 . 前項によって、貸借値段の決定できない銘柄については、申込日の前日の貸借値段をもってその日の貸借値段とする。ただし、<u>その申込日が当該銘柄の権利落売買日に当たるときは、前日の貸借値段から別に定める権利落価格を差し引いた額(取引所が定める当該銘柄の呼値の単位未満は切り捨て。)</u>をもってその日の貸借値段とする。</p> <p>(新 設)</p> <p>(新 設)</p>

「貸借取引に付随する剰余金の配当及び株式分割等による株式を受ける権利等の処理要領」
一部改定新旧対照表

平成21年11月16日一部改定実施
(下線部分は改定箇所)

改 定 後	現 行
<p>貸借取引貸出し規程第20条に規定する貸借取引に付随する剰余金の配当（配当財産が金銭であるものについて処理するものとし、金銭分配請求権を含む。以下同じ。）その他の金銭の交付（以下「配当等」という。）及び株式分割等による株式を受ける権利の処理について、次のとおり定める。</p>	<p>貸借取引貸出し規程第20条に規定する貸借取引に付随する剰余金の配当（配当財産が金銭であるものについて処理するものとし、金銭分配請求権を含む。以下同じ。）その他の金銭の交付（以下「配当等」という。）及び株式分割等による株式を受ける権利の処理について、次のとおり定める。</p>
第 1 (現行どおり)	第 1 (省 略)
第 2	第 2
1. ~ 7. (現行どおり)	1. ~ 7. (省 略)
<p>8. 融資貸借取引参加者及び貸株貸借取引参加者に対しては、前項各号に定める権利処理価額にその銘柄の権利付売買最終日を申込日とする貸借取引におけるその貸借取引参加者の融資担保株券の株数又は貸付株券の株数を乗じた額の金銭（以下「権利処理代金」という。）を授受するものとし、権利付売買最終日の貸借値段と権利落売買日の貸借値段とによって算出した更新差金と権利処理代金を合算し、その差額の金銭をその銘柄の割当日（株式分割等にかかる権利を受ける者を確定するための基準日をいう。以下同じ。）の翌営業日に授受することによって処理する。</p>	<p>8. 融資貸借取引参加者及び貸株貸借取引参加者に対しては、前項各号に定める権利処理価額にその銘柄の権利付売買最終日を申込日とする貸借取引におけるその貸借取引参加者の融資担保株券の株数又は貸付株券の株数を乗じた額の金銭（以下「権利処理代金」という。）を授受するものとし、権利付売買最終日の貸借値段と権利落売買日の貸借値段とによって算出した更新差金と権利処理代金を合算し、その差額の金銭を権利落売買日から起算して4日目の日（休業日を除く。以下同じ。）に授受することによって処理する。</p>
<p>9. 引受等の申込みを行った貸借取引参加者は権利処理価額に割り当てられた株数を乗じて得た額の代金を、売入札において落札した貸借取引参加者は落札代金を、その銘柄の割当日の翌営業日に当社に支払い、当社から当該新株式の振替を受ける。ただし、単位未満株式にかかる権利については、新株式の振替に代え金銭により処理することができる。</p> <p><u>なお、この場合において、当該新株式の振替を行うことができないときは、貸借取引参加者は当社発行の権利預り証を受領するものとする。</u></p>	<p>9. 引受等の申込みを行った貸借取引参加者は権利処理価額に割り当てられた株数を乗じて得た額の代金を、売入札において落札した貸借取引参加者は落札代金を、その銘柄の割当日（<u>権利落売買日から起算して4日目の日</u>）に当社に支払い、当社から当社が発行する「<u>権利預り証</u>」を受領するものとする。ただし、単位未満株式にかかる権利については、<u>株券</u>の振替に代え金銭により処理することができる。</p>
10. ~ 12. (現行どおり)	10. ~ 12. (省 略)

改 定 後	現 行
<p>13. 前各項の規定にかかわらず、貸借取引融資担保株券等及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又は株式無償割当て（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) 権利付売買最終日の当該銘柄にかかる各貸借取引参加者の取引区分ごとの融資株数及び貸株株数については、権利落日をもって、当該株数を当該新株式割当率（<u>株式の分割又は割当てにおいて、分割又は割当て後の発行済株式総数を分割又は割当て前の発行済株式総数で除して得た数から1を引いた数。以下同じ。</u>）に1を加えた数を乗じた株数に調整する。</p> <p>(2) 権利落日の取引所における最終値段（<u>気配表示が行われているときは、当該最終気配値段。</u>）がない場合には、<u>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>に調整し、権利落日における貸借値段とする。</p> <p style="text-align: center;">（ 削 除 ）</p>	<p>13. 前各項の規定にかかわらず、貸借取引融資担保株券等及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又は株式無償割当て（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) 権利付売買最終日の当該銘柄にかかる各貸借取引参加者の取引区分ごとの融資株数及び貸株株数については、<u>権利落日の翌日</u>をもって、当該株数を当該新株式割当率に1を加えた数を乗じた株数に調整する。</p> <p>(2) <u>権利落日の当該銘柄にかかる貸借値段は、権利落日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。）を当該新株式割当率に1を加えた数を乗じた額に調整する。ただし、権利落日の取引所における最終値段がない場合には、権利落日前日の貸借値段を権利落日における貸借値段とする。</u></p> <p>14. <u>権利落売買日における当該銘柄に対する貸借申込みは、金融証券市場における受渡と合致させるため、当該権利落売買日の翌日に当日分と一括して申込みを受け付ける。</u></p>
<p><u>14. ~ 18.</u> （ 現 行 ど お り ）</p>	<p><u>15. ~ 19.</u> （ 省 略 ）</p>