

PTS 信用取引取扱細則

Japan Alternative Market 株式会社

第 1 章 総則

(目的)

第 1 条 この細則は、日本証券業協会の「上場株券等の取引所金融商品市場外での売買等に関する規則」第 6 条の 7 に基づき、Japan Alternative Market 株式会社（以下「当社」という。）が運営する上場株式等の取引所金融商品市場外取引となる私設取引システムにおける有価証券の売買に係る PTS 信用取引及び取引参加者が PTS 市場における有価証券の売買の決済のために行う PTS 貸借取引並びに取引参加者がその顧客から受託する PTS 信用取引の取扱いに関し、必要な事項を定めることを目的とする。

(定義)

第 2 条 この細則において使用する用語は、以下の各号に定めるものとする。

- (1) 「PTS 市場」とは、金融商品取引法第 2 条第 8 項第 10 号に基づき当社が運営する私設取引システムをいう。
- (2) 「PTS 信用取引」とは、信用取引のうち、PTS 市場において取引参加者が顧客に信用を供与するものをいう。
- (3) 「PTS 制度信用取引」とは、PTS 信用取引のうち、品貸料及び弁済の繰延期限について、次に掲げるところに従って行う PTS 信用取引をいう。
 - ① 品貸料
当社が銘柄ごとに定めるものとし、東京証券取引所が定める品貸料の料率と同一の料率とする。
 - ② 弁済の繰延期限
取引参加者による貸付けの日の翌日とし、その 2 日前（当社の休業日を除外する。）の日までに弁済の申出をしない場合は、逐日（当社の休業日を除外する。）これを繰り延べるものとする。ただし、PTS 信用取引による売付け又は買付けが成立した日の 6 か月目の応当日（応当日がない場合はその月の末日とし、応当日が当社の休業日に当たるときは順次繰り上げる。）から起算して 3 日目の日を超えて繰り延べることはできない。

- (4) 「PTS 一般信用取引」とは、PTS 信用取引のうち、品貸料及び弁済の繰延期限について、取引参加者が顧客との間で合意した内容に従って行う PTS 信用取引をいう。
- (5) 「PTS 貸借取引」とは、次に掲げる取引の決済のために取引参加者又は取引参加者から有価証券等清算取次ぎを委託された者が当社の指定する証券金融会社から東京証券取引所の開設する取引所金融商品市場の決済機構を利用して金銭又は有価証券の貸付けを受ける取引をいう。
 - ① PTS 制度信用取引
 - ② 取引参加者が自己の計算において行う有価証券の売買（PTS 市場において行うものであり、かつ、売買成立の日の6か月目の応当日（応当日がないときはその月の末日とし、応当日が当社の休業日に当たるときは順次繰り上げる。）から起算して3日目（当社の休業日を除外する。）の日までに当該有価証券の売買の決済を行うものに限る。）
- (6) 「PTS 制度信用銘柄」とは、PTS 制度信用取引を行うことができる銘柄をいう。
- (7) 「PTS 貸借銘柄」とは、PTS 貸借取引により金銭及び有価証券の貸付けを行うことができる銘柄をいう。
- (8) 「取引参加者」とは、次条の範囲の者であり、PTS 市場において当社と合意した PTS 信用取引又は取引参加者の自己の信用売り又は買い（第5項第2号に定める取引をいう。）を行う取引参加者をいう。
- (9) 「顧客」とは、取引参加者に口座を開設し、PTS 市場において有価証券の売買の委託を行う者をいう。
- (10) 「法」とは、金融商品取引法をいう。
- (11) 「クリアリング機構」とは、株式会社日本証券クリアリング機構をいう。
- (12) 「東京証券取引所」とは、株式会社東京証券取引所をいう。
- (13) 「指定証券金融会社」とは、当社の指定する証券金融会社をいう。

（取引参加者の範囲）

第3条 この細則における取引参加者は次の各号の要件を満たした者をいう。

- (1) 法第28条第1項に基づく第一種金融商品取引業者であること。
- (2) クリアリング機構の業務方法書に規定する現物清算参加者である者、又は現物清算参加者でない場合には、有価証券等清算取次ぎを委託する現物清算参加者を指定している者であること。
- (3) 東京証券取引所の総合取引参加者であること。
- (4) PTS 貸借取引を行う取引参加者（当該取引参加者が有価証券等清算取次ぎを委託する場合は、当該取引参加者から有価証券等清算取次ぎを委託された者）

である場合は指定証券金融会社との間で、同社に対し債務不履行となり、かつ、その債務が完済不能となった場合における残存債務の分担の取扱いに係る契約を締結する者であること。

第2章 PTS 信用取引・PTS 貸借取引に関する事項

(PTS 信用取引等の取引時間)

第4条 PTS 市場における PTS 信用取引（これらの返済注文、及び自己の計算による信用の売付け又は買付け、並びにこれらの返済注文を含む。以下本条において「PTS 信用取引等」という。）の取引時間は、当社の営業日（「私設取引システム説明書」に定める休業日以外の日をいう。）のうち以下の時間とする。

9:00～11:30

12:30～15:30

- 2 当社は、11:30 及び 15:30 時点で PTS 信用取引等に係る残注文を失効させるものとする。

(新株予約権証券等の PTS 信用取引の禁止)

第5条 取引参加者は、新株予約権証券、新投資口予約権証券、東京証券取引所の上場廃止の基準に該当した銘柄その他東京証券取引所又は当社が適当でないと認めた銘柄について、PTS 信用取引を行ってはならない。

(PTS 信用取引における貸付けに係る対価の算出)

第6条 取引参加者は、PTS 信用取引に関し、顧客から徴収すべき有価証券又は金銭の貸付けに係る対価の額の算出においては、社内対当の状況及び PTS 貸借取引等による有価証券又は金銭の調達に要する費用、有価証券又は金銭の貸付けに係る事務手続きに要する費用その他の費用を勘案するとともに、売付顧客と買付顧客の負担に係る取扱いにつき公平を欠くことのないよう配慮しなければならない。

(PTS 信用取引に関する通知書の送付)

第7条 取引参加者は、PTS 信用取引に係る未決済勘定がある顧客に対して、当該 PTS 信用取引に関する通知書を毎月送付するものとする。ただし、顧客が認可金融商品取引業協会に所属する金融商品取引業者である場合又は法第 45 条若しくは金融商品取引業等に関する内閣府令第 111 条第 1 号の規定により、顧客に取引残高報告書の交付を要しない場合については、この限りでない。

- 2 PTS 制度信用取引に関する前項に規定する通知書には、銘柄、売付け又は買付けの別、数量、約定値段、売買成立日、及び最終弁済申出期限を記載しなければならない。ただし、金融商品取引業等に関する内閣府令第 108 条第 7 項の規定によ

り取引残高報告書に同一日における同一銘柄の取引の単価の平均額を記載することができる場合には、当該通知書の約定値段として当該平均額を記載することができる。

- 3 PTS 一般信用取引に関する第1項に規定する通知書には、前項に掲げる事項のほか、顧客との間で合意した品貸料の内容を記載しなければならない。
- 4 取引参加者は、第1項の規定による通知書の送付に代えて、顧客に対し、その用いる電磁的方法（日本証券業協会自主規制規則「書面の電磁的方法による提供等の取扱いに関する規則」に定めるところによるものとする。）の種類及び内容を提示し、当該顧客の書面又は電磁的方法による承諾を得た場合には、当該通知書に記載すべき事項を電磁的方法により提供することができる。この場合において、当該取引参加者は当該通知書を送付したものとみなす。
- 5 前項の規定による承諾を得た取引参加者は、当該顧客から書面又は電磁的方法により電磁的方法による提供を受けない旨の申出があったときは、当該顧客に対し当該通知書に記載すべき事項の提供を電磁的方法によってしてはならない。ただし、当該顧客が再び前項の規定による承諾をした場合は、この限りではない。

（PTS 制度信用銘柄以外の銘柄の PTS 制度信用取引の禁止）

第8条 取引参加者は、PTS 制度信用銘柄以外の銘柄について、PTS 制度信用取引を行ってはならない。

（PTS 制度信用取引の品貸料）

第9条 PTS 貸借銘柄の PTS 制度信用取引に係る品貸料は、当社が銘柄ごとに定めるものとし、東京証券取引所が定める品貸料の料率と同率とする。

（PTS 制度信用取引に係る権利処理）

第10条 PTS 制度信用取引に係る配当請求権、株式分割による株式を受ける権利その他の権利の処理に関し必要な事項は、東京証券取引所の定める「制度信用取引に係る権利の処理に関する規則」を準用し処理するものとする。

- 2 前項の準用に際し、「制度信用取引」とあるのは「PTS 制度信用取引」と、「信用買顧客」又は「信用売顧客」とあるのは「PTS 信用買顧客」又は「PTS 信用売顧客」と、「業務規程第15条の規定に基づき当取引所が定める売買単位の数量」とあるのは「東京証券取引所がその規則に基づき定める売買単位の数量」と、「当取引所」とあるのは「東京証券取引所」と読み替える。

（PTS 貸借取引の制限）

第11条 取引参加者は、PTS 制度信用取引に基づく普通取引に係る決済又は自己の信用売り若しくは信用買いに係る普通取引に係る決済以外のための PTS 貸借取引を行ってはならない。

(PTS 貸借取引の決済等)

第12条 PTS 貸借取引（有価証券等清算取次ぎによるものを含む。）に係る金銭又は有価証券の借入れ及び返済並びに担保としての当該借入金に係る買付有価証券又は当該借入有価証券に係る売付代金の差入れ及び返戻は、クリアリング機構の業務方法書に定めるところによるものとする。

(自己の信用売り又は信用買いの決済期限)

第13条 取引参加者は、自己の信用売り又は信用買いに係る普通取引を行った場合は、売買成立の日の6か月目の応当日（応当日が無いときはその月の末日とし、応当日が休業日に当たるときは順次繰り上げる。）から起算して3日目（休業日を除外する。）の日までに当該信用売り又は信用買いの決済を行わなければならない。

(取引参加者による信用取引残高等の提供)

第14条 PTS 信用取引を行う取引参加者は、当社に対し以下に掲げる情報の提供を行うものとする。

- (1) 信用取引残高（銘柄別残高・現在高）
 - (2) 信用取引売買手口情報
 - (3) その他当社が PTS 信用取引に係る売買の公正の確保を図るために必要と認める情報
- 2 PTS 信用取引を行う取引参加者は、第1項に定める情報のうち、当社が必要と認める情報を東京証券取引所、他の私設取引システム（当該取引参加者が当社 PTS 市場及び他の私設取引システムの双方に参加する場合に限る。）及び指定証券金融会社に対し提供することを同意するものとする。

(PTS 信用取引取扱細則等の公表)

第15条 当社は、次に掲げる情報を当社 WEB サイトに公表するものとする。

- (1) PTS 信用取引取扱細則
- (2) 当社が講じた PTS 信用取引の規制措置の内容
- (3) 当社が取扱う銘柄別の PTS 信用取引週末残高
- (4) PTS 市場における PTS 信用取引現在高及び社内対当数量
- (5) その他当社が必要と認める事項

(PTS 制度信用銘柄、PTS 貸借銘柄の選定及び取消し)

第 16 条 当社は、PTS 制度信用銘柄及び PTS 貸借銘柄は、次の各号に掲げる銘柄のうち、指定証券金融会社が選定した銘柄から選定するものとする。

- (1) PTS 制度信用銘柄 東京証券取引所が規則により選定する制度信用銘柄
- (2) PTS 貸借銘柄 東京証券取引所が規則により選定する貸借銘柄

2 すでに、東京証券取引所が信用取引の規制措置を実施している銘柄、又は指定証券金融会社が貸株利用等に関する注意喚起措置若しくは貸借取引申込に関する制限若しくは停止措置を実施している銘柄を、当社が PTS 制度信用銘柄又は PTS 貸借銘柄に選定する場合は、選定と同時に第 21 条に掲げる PTS 信用取引の規制措置を行うものとする。

(PTS 制度信用銘柄の選定基準及び選定の時期)

第 17 条 PTS 制度信用銘柄の選定は、東京証券取引所がその規則により選定する制度信用銘柄のうち、以下の基準に合致した銘柄の中から選定するものとする。

- (1) 東京証券取引所において制度信用銘柄に選定されている銘柄であるとき。
- (2) その他 PTS 制度信用銘柄として適当でないと認められる銘柄以外の銘柄であるとき。

2 PTS 制度信用銘柄の選定の時期は、指定証券金融会社と合意した日とし、原則として、東京証券取引所において上場後最初の約定値段が決定された日の翌日（休業日の場合は順次繰り下げる。）とする。ただし、東京証券取引所が別に定める日から選定することとした銘柄は、当該日から PTS 制度信用銘柄として取り扱うことができるものとする。

3 前項ただし書の適用により、PTS 制度信用銘柄を選定する場合は、第 1 項第 2 号を適用する。

(PTS 貸借銘柄の選定基準及び選定の時期)

第 18 条 当社が選定した PTS 制度信用銘柄については、次の各号に適合する場合に、これを PTS 貸借銘柄に選定することができる。

- (1) 東京証券取引所において貸借銘柄に選定されている銘柄であるとき。
- (2) 貸株等調達可能量（当該銘柄が株券以外の有価証券である場合については、株券について使われている用語を、当該有価証券の種類に応じて読み替えるものとする。以下同じ。）からみて貸借銘柄として適当でないと認められる銘柄以外の銘柄であるとき。
- (3) その他貸借銘柄として適当でないと認められる銘柄以外の銘柄であるとき。

2 PTS 貸借銘柄の選定日は、指定証券金融会社と合意した日とする。

- 3 第1項の規定に関かわらず、同項第2号、第3号の基準に合致する場合であつて、かつ、予め指定証券金融会社と合意している場合は、PTS 貸借銘柄に選定することができるものとし、東京証券取引所の選定日と同一日又は東京証券取引所の選定日以降の指定証券金融会社と合意した日に PTS 貸借銘柄に選定することができる。

(PTS 制度信用銘柄の選定取消し)

第19条 以下に掲げる場合は選定した PTS 制度信用銘柄の選定の取消しを行う。

- (1) 東京証券取引所において制度信用銘柄の選定の取消しとなった場合。
 - (2) その他 PTS 制度信用銘柄として適当でないと認められる銘柄である場合。
- 2 前項第1号に基づく PTS 制度信用銘柄の取消しは東京証券取引所が制度信用銘柄の選定の取消しをする日に行い、前項第2号に基づく PTS 制度信用銘柄の取消しは当社がその都度指定証券金融会社と協議して定める日に行う。

(PTS 貸借銘柄の選定取消し)

第20条 以下に掲げる場合は選定した PTS 貸借銘柄の選定の取消しを行う。

- (1) 東京証券取引所において貸借銘柄の選定の取消しとなった場合。
 - (2) その他 PTS 貸借銘柄として適当でないと認められる銘柄である場合。
- 2 前項第1号に基づく PTS 貸借銘柄の取消しは東京証券取引所が貸借銘柄の選定の取消しをする日に行い、前項第2号に基づく PTS 貸借銘柄の取消しは当社がその都度指定証券金融会社と協議して定める日に行う。

(PTS 信用取引に係る規制措置)

第21条 当社は、PTS 市場において次に掲げる PTS 信用取引の規制措置を行うことができる。

- (1) PTS 信用取引による売付け若しくは買付けに係る委託保証金の率の引上げ又は当該委託保証金の有価証券をもってする代用の制限
 - (2) PTS 信用取引による売付け若しくは買付けに係る委託保証金を有価証券をもって代用する場合の代用価格の計算において、時価に乗すべき率の引下げ
 - (3) PTS 信用取引による売付け若しくは買付け（取引参加者の信用売り又は信用買いを含む。）の制限又は禁止
 - (4) PTS 信用取引残高の日々公表
- 2 当社は、東京証券取引所又は指定証券金融会社が以下の措置を講じた場合は、当該措置を講じた銘柄について以下に掲げる PTS 信用取引の規制措置を講じなければならない。

- (1) 東京証券取引所が信用取引の制限又は禁止措置を行った銘柄 PTS 信用取引の制限又は禁止措置
 - (2) 東京証券取引所が信用取引残高の日々公表銘柄に指定した銘柄 PTS 信用取引残高の日々公表銘柄への指定
 - (3) 東京証券取引所が信用取引に係る委託保証金の率の引上げ措置（委託保証金の有価証券をもって代用する制限等を含む。）を行った銘柄 PTS 信用取引に係る委託保証金の率の引上げ措置（委託保証金の有価証券をもってする代用の制限等を含む。）
 - (4) 指定証券金融会社が貸株利用等に関する注意喚起を通知した銘柄又は申込制限措置若しくは申込停止措置を実施した銘柄 PTS 信用取引の制限又は禁止措置
- 3 当社は、前項に関わらず、当社が別に定める「PTS 信用取引の新規注文停止に関するガイドライン」に基づき、当該基準等に該当した銘柄に係る PTS 信用取引の新規注文（新規売付注文又は新規買付注文）の受注停止措置を実施するものとする。

（有価証券等清算取次ぎに対する適用）

第 2 2 条 有価証券の売買に係る有価証券等清算取次ぎについては、有価証券等清算取次ぎを委託する取引参加者を当該有価証券の売買を行う者と、PTS 貸借取引に係る有価証券等清算取次ぎについては、有価証券等清算取次ぎを委託する取引参加者を当該 PTS 貸借取引を行う者とみなして、この章（第 12 条を除く。）を適用する。

第 3 章 取引参加者及びその顧客の遵守事項等

（取引参加者によるこの細則の遵守）

第 2 3 条 取引参加者は、以下に掲げる取引を行う場合は、この細則を遵守しなければならない。

- (1) PTS 信用取引
 - (2) 第 2 条第 5 号②に掲げる取引
- 2 取引参加者の顧客が取次者（取引参加者に有価証券の売買を委託した顧客が、金融商品取引業者である場合であって、当該委託が取引参加者に対する有価証券の売買の委託の取次ぎによるものであるときの当該顧客をいう。以下同じ。）となる場合（かつ、次の各号に掲げる取引を行う場合）は、取次者となる顧客に対し、この細則を周知し、その遵守を徹底しなければならない。
- (1) 取次者の顧客による PTS 信用取引の取引参加者への委託の取次ぎ

- (2) 取次者の自己の計算において行う有価証券の売買(PTS市場によるものであり、かつ、売買成立の日の6か月目の応当日(応当日がないときはその月の末日とし、応当日が休業日に当たるときは順次繰り上げる。)から起算して3日目(当社の休業日を除外する。)の日までに当該有価証券の売買の決済を行うものに限る。)
- 3 取引参加者は、その顧客(取次者を除く。)に本章(次条を除く。)に定める事項を周知し、その遵守を徹底しなければならない。
 - 4 取引参加者は、顧客が取次者の場合は取次者に対し当該取次者の顧客に本章に定める事項を周知し、その遵守を徹底することが必要となる旨の説明を行わなければならない。
 - 5 取引参加者(取引参加者が指定証券金融会社の貸借取引参加者の場合に限る。)又は取引参加者から有価証券等の清算取次ぎの委託を受けた者は、他の取引参加者が指定証券金融会社に対し債務不履行となり、かつ、その債務を完済することができない場合における残存債務について、指定証券金融会社の指定する方法により、当該完済不能取引参加者を除く取引参加者と分担して負担しなければならない。

(PTS信用取引の利益相反管理態勢)

- 第24条 当社は、取引参加者又は前条第2項に定める取次者(以下本条において「取引参加者等」という。)に対しPTS信用取引を目的とした資金又は有価証券の提供は行わないものとする。
- 2 当社は、当社のグループ会社等に該当する取引参加者等が実質的な資金又は有価証券の提供者となるPTS信用取引の新規買付注文又は新規売付注文(返済注文を除く。)の受託を行わないものとする。
 - 3 当社のグループ会社等とは、当社が他の法人にとって金融商品取引法第31条の4第3項に定める「親法人等」または金融商品取引法第31条の4第4項に定める「子法人等」のいずれかに該当する当該他の法人、または、当社の「親法人等」または「子法人等」とする。
 - 4 当社は、前項に規定する「当社のグループ会社等」に該当しない場合であっても、当社への出資、議決権、人的関係等により当社業務へ影響を与えうる者による実質的な資金または有価証券の提供者となるPTS信用取引の新規買付注文または新規売付注文(返済注文を除く。)の受託に関しては、「PTS信用取引における利益相反管理態勢の整備に関する事務基準」等の規程に基づいた適切な対応を行うものとする。

(信用取引口座設定約諾書に係る合意書の差入れ)

第25条 取引参加者は、顧客が PTS 信用取引に係る信用取引口座を設定しようとするときは、当該顧客から、東京証券取引所の定める「信用取引口座設定約諾書」(当該顧客が所定事項を記載したものに限る。)に加え、PTS 信用取引に係る合意書を受け入れるものとする。

- 2 取引参加者は、前項の規定による差入れに代えて、取引参加者がその用いる電磁的方法(日本証券業協会自主規制規則「書面の電磁的方法による提供等の取扱いに関する規則」に定めるところによるものとする。)により、前項の書面に記載すべき事項について電子情報処理組織を使用する方法その他の情報通信の技術を利用する方法により受け入れることができるものとする。
- 3 当社の定める合意書で読替える「信用取引口座設定約諾書」に基づく遅延損害金の率は東京証券取引所の定める料率と同率とする。

(PTS 信用取引又は自己の信用売り若しくは買いの際に指示すべき事項)

第26条 取引参加者は、顧客から PTS 市場における有価証券の売買に係る PTS 信用取引若しくはその返済注文の委託を受ける場合、又は取引参加者の自己の計算による信用売り若しくは信用買いを行う場合には、その都度、次の各号に掲げる事項を当社に指示するものとする。

- (1) PTS 信用取引により行おうとするとき(顧客が取次者である場合において、PTS 信用取引に係る売買の委託の取次ぎを引き受けたときを含む。)は、その旨、及び PTS 一般信用取引又は PTS 制度信用取引の別
 - (2) PTS 制度信用取引又は PTS 一般信用取引により貸付けを受けた買付代金又は売付有価証券の弁済のために行おうとするとき(顧客が取次者である場合において、PTS 制度信用取引又は PTS 一般信用取引により貸付けを受けた買付代金又は売付有価証券の弁済に係る売買の委託の取次を引き受けたときを含む。)は、その旨
 - (3) 自己の信用売り又は信用買いにより行おうとするときは、その旨
 - (4) 自己の信用売り又は信用買いの決済のために行おうとするときは、その旨
 - (5) その他当社の指定する事項がある場合は、その旨
- 2 PTS 信用取引に係る信用取引口座を有する顧客が有価証券の売買の委託につき、取引参加者に対し前項第1号の指示を行わなかった場合には、当該売買は PTS 信用取引によることができない。

(PTS 信用取引に係る委託保証金の差入れ)

第27条 取引参加者は、PTS 信用取引による売付け又は買付けが成立したときは、次の各号に掲げる場合の区分に応じ、顧客から当該各号に定める額以上の金銭を委託保

証金として売買成立の日から起算して3日目の正午までに当該取引参加者の指定する日時までに差入れを受けるものとする。

- (1) 差入れの際、当該顧客のPTS信用取引に係る受入保証金がない場合
 - ① 当該PTS信用取引に係る有価証券の約定価額に100分の30（当該信用取引に係る有価証券がレバレッジ指標等（金融商品市場（法第2条第14項に規定する金融商品市場をいう。）における相場その他の指標であって、その一日の変動率が他の指標の一日の変動率に一定の数を乗じて得た率となるように算出されたものをいう。）に関する有価証券である場合にあっては、100分の30に当該一定の数（当該一定の数が零に満たないときは、当該一定の数を零から差し引いた数）を乗じて得た率（その率が100分の30に満たないときは、100分の30）。第34条において同じ。）を乗じて得た額（以下この条において「通常の最低限度額」という。）が30万円以上のときはその額
 - ② 当該PTS信用取引に係る通常の必要最低限度額が30万円に満たないときは30万円
- (2) 差入れの際、当該顧客のPTS信用取引に係る受入保証金がある場合
 - ① 当該PTS信用取引に係る通常の最低限度額と当該顧客のPTS信用取引に係る受入保証金の総額（第34条第1項に規定する計算により算出した受入保証金の総額をいう。以下同じ。）との合計額が30万円以上のときは、当該PTS信用取引に係る通常の最低限度額
 - ② 当該PTS信用取引に係る通常の最低限度額と当該顧客のPTS信用取引に係る受入保証金の総額との合計額が30万円に満たないときは、その差額を当該PTS信用取引に係る通常の最低限度額に加算した額

（委託保証金として差し入れる金銭の種類等）

第28条 前条に規定する委託保証金として差し入れることができる金銭は、円貨又は米ドルとする。

- 2 米ドルにより差し入れられる前条に規定する委託保証金（同条に規定する受入保証金を含む。）の金銭の額については、取引参加者が指定する外国為替相場により円貨に換算した価格に100分の95を乗じた額とする。

（PTS信用取引に係る委託保証金の有価証券による代用）

第29条 PTS信用取引に係る委託保証金は、有価証券をもって代用することができる

- 2 前項の有価証券の種類は次の各号に掲げるものとし、その差入れの際における代用価格はその前日における時価（次項各号に掲げる有価証券については、当該

各号に定める時価をいう。以下この項及び第 34 条第 2 項において同じ。) に当該各号に定める率を乗じて得た額を超えない額とする。

- (1) 国内の金融商品取引所に上場されている株券（内国法人の発行する株券、優先出資証券、外国株券等（東京証券取引所受託契約準則第 28 条に定める外国株券等をいう。）及び受益証券発行信託の受益証券をいう。以下本章において同じ。） 100 分の 80
- (2) 国債証券 100 分の 95
- (3) 地方債証券（その発行に際して元引受契約が金融商品取引業者により締結されたものに限る。） 100 分の 85
- (4) 特別の法律により法人の発行する債券
政府が元本の償還及び利息の支払いについて保証しているもの 100 分の 90
その他のもの 100 分の 85
- (5) 国内の金融商品取引所に上場されている社債券（転換社債型新株予約権付社債券及び交換社債券を除く。以下この条において同じ。）又は国内の金融商品取引所にその株券が上場されている会社が発行する社債券で、かつ、外国法人以外の会社の発行するもの（その発行に際して元引受契約が金融商品取引業者により締結されたものに限る。） 100 分の 85
- (6) 国内の金融商品取引所に上場されている転換社債型新株予約権付社債券又は国内の金融商品取引所にその株券が上場されている会社が発行する新株予約権付社債券で、かつ、外国法人以外の会社が発行するもの（その発行に際して元引受契約が金融商品取引業者により締結されたものに限る。）
100 分の 80
- (7) 国内の金融商品取引所に上場されている交換社債券（その発行に際して元引受契約が金融商品取引業者により締結されたものに限る。） 100 分の 80
- (8) 国内の金融商品取引所に上場されている外国国債証券 100 分の 85
- (9) 国内の金融商品取引所に上場されている外国地方債証券 100 分の 85
- (10) 国際復興開発銀行円貨債券 100 分の 90
- (11) アジア開発銀行円貨債券 100 分の 90
- (12) 前 4 号に掲げる債券の発行者を除く外国法人の発行する円貨建外国債券（国内の金融商品取引所に上場されているものに限る。） 100 分の 85
- (13) 投資信託受益証券及び投資証券（国内の金融商品取引所に上場されているもの及び一般社団法人投資信託協会が前日の時価を発表するものに限る。）
公社債投資信託の受益証券 100 分の 85
その他のもの 100 分の 80

- (14) 米国 1934 年証券取引所法 (Securities Exchange Act of 1934) 第 6 条の規定により、米国証券取引委員会 (U.S. Securities Exchange Act Commission) に登録されている金融商品取引所に上場されている外国株券等 (新投資口予約証券及び投資法人債券に類する証券を除く。以下この条において同じ。) 100 分の 60 (次項第 5 号に規定する時価が差入時の直近のものである場合にあっては 100 分の 70)
- 3 有価証券の時価は、次の各号に掲げる有価証券の区分に従い、当該各号に定めるところによる。
- (1) 前項第 1 号に規定する株券、同項第 6 号に規定する転換社債型新株予約権付社債券、同項第 7 号に規定する交換社債券、並びに同項第 13 号に規定する投資信託受益証券及び投資証券のうち国内の金融商品取引所に上場されているもの 国内の金融商品取引所における最終価格 (国内の金融商品取引所において気配表示が行われているときは、当該最終気配値段)
 - (2) 前項第 13 号に規定する投資信託受益証券及び投資証券のうち一般社団法人投資信託協会が前日の時価を発表するもの 一般社団法人投資信託協会が発表する時価
 - (3) 前 2 号に掲げる有価証券以外の有価証券のうち日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの 日本証券業協会が発表する売買参考統計値のうち平均値 (物価連動国債にあっては、当該平均値に財務省が公表する連動係数を乗じた値)
 - (4) 前各 3 号に掲げる有価証券以外の有価証券のうち国内の金融商品取引所に上場されているもの 国内の金融商品取引所における最終価格 (国内の金融商品取引所において気配表示が行われているときは、当該最終気配値段)
 - (5) 前項第 14 号に規定する外国株券等 同号に規定する金融商品取引所における終値又は気配相場 (取引参加者が指定する外国為替相場により円貨に換算した価格とする。)
- 4 東京証券取引所又は国内の他の金融商品取引所が上場廃止の決定等その他の理由により代用有価証券から除外する旨の決定をした場合は、当社は、東京証券取引所又は国内の他の金融商品取引所が代用有価証券から除外する日から当該有価証券を代用有価証券から除外するものとする。

(PTS 信用取引による有価証券又は金銭の貸付け)

第 30 条 取引参加者は、PTS 信用取引による売付けについては、当該売付けの決済日に当該売付代金及び委託保証金を担保として当該売付有価証券の貸付けを行うものとし、PTS 信用取引による買付けについては、当該買付けの決済日に当該買付け

有価証券及び委託保証金を担保として当該買付約定価額の全額に相当する金銭の貸付けを行うものとする。ただし、第 39 条第 2 項に規定する調整が行われた場合の新株式に係る売付有価証券又は買付代金の貸付けは、株式分割（優先出資分割、受益権の分割及び投資口の分割並びに外国預託証券に係るこれらと同じ性質を有するものを含む。以下同じ。）又は株式無償割当て（外国株預託証券に係るこれと同じ性質を有するものを含む。以下同じ。）の効力発生日にそれぞれ行ったものとみなす。

- 2 PTS 貸借銘柄について、前項の有価証券又は金銭の貸付けを PTS 制度信用取引により行う場合は、取引参加者は、当社の定める品貸料（東京証券取引所が定める品貸料と同率とする。）を、有価証券の貸付けを受けている顧客から徴収し、金銭の貸付けを受けている顧客に交付するものとする。
- 3 PTS 制度信用銘柄（PTS 貸借銘柄は除き、かつ、東京証券取引所において貸借銘柄である場合に限る。）について、金銭の貸付けを PTS 制度信用取引により行う場合は、取引参加者は、東京証券取引所の定める品貸料を、金銭の貸付けを受けている顧客に交付するものとする。

（品貸料を授受する期間）

第 3 1 条 前条第 2 項、第 3 項の規定による品貸料の授受は、貸付けの日から弁済の日の前日まで行うものとする。

（PTS 信用取引による有価証券又は金銭の貸付けの弁済期限）

第 3 2 条 PTS 信用取引による売付有価証券又は買付代金の貸付けの弁済期限は、貸付けの日の翌日とし、その 2 日前（当社の休業日を除外する。）の日までに弁済の申出をしない場合は、逐日（当社の休業日を除外する。）これを繰り延べるものとする。ただし、PTS 制度信用取引においては、当該 PTS 信用取引による売付け又は買付けが成立した日の 6 か月目の応当日（応当日がないときはその月の末日とし、応当日が当社の休業日に当たるときは順次繰り上げる。以下同じ。）から起算して 3 日目の日を超えて繰り延べるできない。

- 2 第 39 条第 2 項に規定する調整が行われた場合の新株式に係る売付有価証券又は買付代金の貸付けの弁済期限は、株式分割又は株式無償割当の対象となった株式（優先出資、受益権及び投資口並びに外国株預託証券に表示される権利を含む。第 38 条及び第 39 条において同じ。）の売付け又は買付けが成立した日の 6 か月目の応当日から起算して 3 日目の日を超えて繰り延べるできない。

（PTS 信用取引に係る委託保証金の引出し等）

第33条 取引参加者は、顧客から PTS 信用取引に係る委託保証金として差入れを受けた金銭又は有価証券については、第1号に掲げる額から第2号に掲げる額を控除した額に相当する金銭又は当該額を第29条第2項各号に掲げる率をもって除して得た額に相当する有価証券を引き出させることができる。

(1) 当該顧客の PTS 信用取引（当該 PTS 信用取引に係る委託保証金の差入れを受けたものに限る。次項第1号①及び第2号①、第3項第1号並びに第37条において同じ。）に係る受入保証金の総額

(2) 前号の PTS 信用取引に係る一切の有価証券（反対売買を行ったもの及び反対売買以外の方法による決済に必要な金銭又は有価証券の交付を受けたものを除く。次項第1号②及び第2号②、第3項第2号、第4項並びに第37条において同じ。）の約定価額に100分の30を乗じて得た額（その額が30万円に満たないとき（零であるときを除く。）は30万円）

2 前項の規定によるもののほか、取引参加者は、顧客から PTS 信用取引に係る委託保証金として差入れを受けた金銭又は有価証券については、次の各号に掲げる場合に限り、これを引き出させることができる。

(1) 未決済勘定の一部の決済をする場合（①に掲げる額から②に掲げる額を控除した額に相当する金銭又は当該額を第29条第2項各号に掲げる率をもって除して得た額に相当する有価証券を引き出させる場合に限る。）

① 当該顧客の PTS 信用取引に係る受入保証金の総額

② 前①の PTS 信用取引に係る一切の有価証券（当該決済をする未決済勘定に係るものを除く。）の約定価額に100分の30を乗じて得た額（その額が30万円に満たないときは、30万円）

(2) 未決済勘定の一部の決済（反対売買による決済を除く。）をする場合において、当該決済をする未決済勘定に係る PTS 信用取引により買い付けた有価証券又は売り付けた有価証券の売付代金に相当する金銭の全部を PTS 信用取引に係る委託保証金として差し入れることを条件とするとき（その差入れ後において①に掲げる額が②に掲げる額以上となる場合に限る。）

① 当該顧客の PTS 信用に係る受入保証金の総額

② 前①の PTS 信用取引に係る一切の有価証券の約定価額に100分の30を乗じて得た額（その額が30万円に満たないときは、30万円）

(3) 未決済勘定の全部の決済をする場合

(4) 当該金銭又は有価証券の全部又は一部について、その差換えをする場合

3 取引参加者は、その顧客のために新たな PTS 信用取引を行ったときは、第1号に掲げる額から第2号及び第3号に掲げる額の合計額を控除した額に相当する金銭又は当該額を第29条第2項各号に掲げる率をもって除して得た額に相当する有価証券であって当該顧客から PTS 信用取引に係る委託保証金として差入れを

受けたものを第 27 条の規定により当該新たな PTS 信用取引に係る委託保証金として差入れを受けるべき金銭の額に充当することができる。

- (1) 当該顧客の PTS 取引に係る受入保証金の総額
 - (2) 前号の PTS 信用取引に係る一切の有価証券の約定価額に 100 分の 30 を乗じて得た額
 - (3) 当該差入れを受けるべき金銭の額と前号に掲げる額との合計額が 30 万円に満たないときは、当該合計額と 30 万円との差額に相当する額
- 4 第 1 項第 2 号、第 2 項第 1 号②及び第 2 号②、前項第 2 号、並びに次条第 3 項の約定価額は、PTS 信用取引に係る一切の有価証券のうち権利落ち後の有価証券があり、権利の価額を当該有価証券の売付代金又は買付代金から控除することにより未決済勘定の決済を行う場合（第 1 項第 2 号、第 2 項第 1 号②及び第 2 号②、並びに前項第 2 号の約定価額（当該権利落ちに伴い顧客が有価証券を引き受ける場合において、権利の価額に相当する金銭の交付を受けていないときを除く。）、並びに同条第 3 項の約定価額は、顧客が取引参加者と当該決済を行うことを約している場合を含む。）には、権利の価額を控除した価額とする。

（PTS 信用取引に係る受入保証金の計算方法）

第 3 4 条 第 27 条第 2 号、前条第 1 項第 1 号、同条第 2 項第 1 号①及び第 2 号①、同条第 3 項第 1 号、並びに第 37 条に規定する受入保証金の総額については、次の各号に掲げる額を差し引いて計算するものとする。ただし、前条第 2 項第 1 号①に規定する受入保証金の総額については、決済をする未決済勘定に係る PTS 信用取引の第 1 号に掲げる額を差し引かないものとする。

- (1) 顧客の PTS 信用取引に係る有価証券の相場の変動に基づく損失からその利益を差し引いて計算した計算上の損失額に相当する額、反対売買による損失額及び委託手数料、借入金に対する利子、借入有価証券に対する品貸料その他のものであって、当該顧客の PTS 信用取引について顧客の負担すべきものの合計額（PTS 信用取引により売り付けた有価証券が権利落ちしたことに伴い顧客が負担することになった額を支払わせる場合において、前条第 1 項第 1 号に規定する受入保証金の総額について計算するときは、当該負担することとなった額を除く。）に相当する額
- (2) 顧客の PTS 信用取引について、当該顧客に対し当該 PTS 信用取引に係る有価証券の約定価額に相当する額の信用供与以外に信用を供与している場合におけるその信用供与額に相当する額
- (3) 顧客の未決済勘定の決済後において、なお当該顧客の当該取引参加者に対する債務が残存している場合（当該債務が借入金その他の債務として当該

取引参加者との間で新たな債権債務関係となったものを含む。)における当該残存額に相当する額

- 2 PTS 信用取引に係る受入保証金の総額の計算において、当該受入保証金の全部又は一部が有価証券をもって代用されている場合におけるその代用価格は、計算する日の前日の当該有価証券の時価に第 29 条第 2 項各号に掲げる率を乗じて得た額によるものとする。
- 3 第 1 項の相場の変動に基づく損益は、当該有価証券の約定価額と計算する日の前日の東京証券取引所の時価（前日の東京証券取引所の最終価格（東京証券取引所において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。）。前日に東京証券取引所の約定価格（東京証券取引所において気配表示された最終気配値段を含む。）がないときはその直近の日の東京証券取引所の最終価格）により評価した価額との差損益とする。
- 4 反対売買による利益額が生じた場合において、当該利益額に相当する金銭を当該反対売買による未決済勘定の決済の時に顧客から PTS 信用取引に係る委託保証金として差入れを受けることとしているときは、第 27 条第 2 号、前条第 1 項第 1 号、同条第 2 項第 1 号①及び第 2 号①、同条第 3 項第 1 号、並びに第 37 条に規定する受入保証金の総額については、当該利益額に相当する額を加えて計算することができる。
- 5 前項の規定により同項の利益額に相当する額を加えて前条第 3 項第 1 号に規定する受入保証金の総額を計算する場合においては、当該利益額に相当する金銭を顧客から PTS 信用取引に係る委託保証金として差入れを受けた金銭とみなして、同項の規定を適用する。

(PTS 信用取引に係る計算上の利益の引出し等の制限)

第 35 条 取引参加者は、その顧客の PTS 信用取引に係る有価証券の相場の変動により計算上の利益を生じた場合において、その利益額に相当する金銭若しくは有価証券を交付し又は委託保証金として差入れさせるべき金銭の額に充当してはならない。

(PTS 信用取引に係る委託保証金の追加差入れ)

第 36 条 取引参加者は、その顧客の PTS 信用取引に係る有価証券の相場の変動により計算上の損失を生じている場合には、その損失額に相当する額を委託保証金として追加差入れさせることができる。

(PTS 信用取引に係る委託保証金の維持)

第37条 取引参加者は、PTS 信用取引に係る受入保証金の総額が、その顧客の PTS 信用取引に係る一切の有価証券の約定価額に 100 分の 20 を乗じて得た額を下回ることとなったときは、当該額を維持するために必要な額を委託保証金として、当該顧客からその損失計算が生じた日から起算して 3 日目の日の正午までの取引参加者が指定する日時までに追加差入れさせなければならない。

2 取引参加者は、前項に規定する損失計算が生じた日から起算して、3 日目の日の正午までの取引参加者が指定する日時までに、当該損失計算の対象となった未決済勘定について、顧客が弁済の申出を行った場合（反対売買以外の方法による場合には、決済に必要な金銭又は有価証券の交付を受けた場合に限る。）には、当該弁済の申出を行った有価証券の約定価額に 100 分の 20 を乗じて得た額を、同項の規定により追加差入れさせなければならない委託保証金の額から控除することができる。

3 取引参加者は、第 1 項に規定する損失計算が生じた日から起算して 3 日目の日の正午までの取引参加者が指定する日時までに、顧客から当該損失計算の対象となった未決済勘定に係る反対売買による損失額及び当該未決済勘定につき当該顧客の負担すべきものに相当する額の差入れを受けた場合には、当該反対売買の決済までの間、これらの額を同項の規定により追加差入れさせなければならない委託保証金の額から控除することができる。

（株式分割等による株式を受ける権利等が付与された場合の有価証券の弁済）

第38条 株式分割等による株式を受ける権利（株式分割による株式を受ける権利、株式無償割当による株式を受ける権利及び会社分割による株式を受ける権利をいう。）、新株予約権（新投資口予約権、募集株式の割当を受ける権利、並びに優先出資、新受益権及び外国株預託証券に表示される権利の割当を受ける権利を含む。）又は新株予約権の割当を受ける権利（以下「株式分割等による株式を受ける権利等」という。）以下本章において同じ。）が付与された有価証券についての PTS 信用取引による有価証券の貸付けの弁済期日が、当該株式分割等による株式を受ける権利等の割当日の翌日となるものの弁済は、権利落ちの株券（投資信託受益証券及び投資証券を含む。）をもってこれを行うものとする。

（株式分割による株式を受ける権利等が付与された場合の調整）

第39条 取引参加者が顧客に対し、株式分割等による株式を受ける権利等が付与された有価証券について、PTS 制度信用取引による金銭の貸付けを継続する場合においては、買付約定価額から東京証券取引所が定める株式分割等による株式を受ける権利等の価額（以下「権利処理価額」という。以下本章において同じ。）を差し引いた金額によるものとし、PTS 制度信用取引による有価証券の貸付けを継続する

場合においては、担保として提供を受けた売付代金の額から東京証券取引所が定める権利処理価額を差し引くものとする。

- 2 前項の規定にかかわらず、PTS 制度信用取引を行っている銘柄について株式分割による株式を受ける権利又は株式無償割当による株式を受ける権利（PTS 制度信用取引を行っている銘柄の株式と同一の種類株式が付与される場合に限る。）が付与された場合（当該株式分割又は株式無償割当に係る権利を受ける者を確定するための基準日の翌日が当該株式分割又は株式無償割当の効力発生日である場合に限る。）で、東京証券取引所がその規則で定める売買単位の数量の整数倍の数の新株式（自己株式が交付される場合の当該自己株式を含む。）が割り当てられたときは、売付有価証券及び買付有価証券の数量は当該数量を当該新株割当率に 1 を加えた数を乗じた数量に調整し、売付価格及び買付価格は当該価格に当該新株割当率に 1 を加えた数で除した価格に調整するものとする。

（他市場制度信用取引の未決済勘定）

第 40 条 顧客の他市場 PTS 制度信用取引（他の金融商品取引業者の運営する私設取引システム（以下「他の私設取引システム」という。）における有価証券の売買に係る PTS 信用取引のうち、品貸料及び弁済の繰延期限について日本証券業協会及び他の私設取引システムの規則に定めるところに従って行う信用取引をいう。以下同じ。）に係る未決済勘定を、当社が定めるところにより PTS 制度信用取引に係る未決済勘定として取り扱うことについて、取引参加者と顧客が合意した場合は、当該他市場 PTS 制度信用取引に係る未決済勘定及びこれに係る委託保証金は、PTS 制度信用取引に係る未決済勘定及びこれに係る委託保証金とみなす。この場合において、当該 PTS 制度信用取引による売付け又は買付けが成立した日は、当該他市場 PTS 制度信用取引による売付け又は買付けが成立した日とする。

（顧客の決済不履行の場合の措置）

- 第 41 条 顧客が、所定の時限までに、売付有価証券又は買付代金を取引参加者に交付しないとき、PTS 信用取引に関し預託すべき委託保証金若しくは支払うべき金銭を取引参加者に預託せず若しくは支払わないとき、又はその貸付けを受けた買付代金若しくは売付有価証券の弁済を行わないときには、取引参加者は、任意に、当該売買又は PTS 信用取引を決済するために、当該顧客の計算において、売付契約又は買付契約の締結（その委託を含む。）を行うことができる。
- 2 取引参加者が前項により損害を被った場合においては、顧客のために占有し、又は振替法に基づく口座に記録する金銭及び有価証券をもって、その損害の賠償に充当し、なお不足があるときは、その不足額の支払いを顧客に対し請求することができる。

【附則】

令和6年11月1日 施行