

# PTS 信用取引取扱規則

## 第1章 総則

### (目的)

#### 第1条

この規則は、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の規定に基づき、チャイェックス・ジャパン株式会社（以下、当社）のPTS内取引における有価証券の売買に係る信用取引及びPTS取引参加証券会社（当社の私設取引システム運営業務規程に規定する取引参加者。以下、「PTS取引参加者」という。）が当社のPTS内取引における有価証券の売買の決済のために当社が指定する証券金融会社（日本証券金融株式会社とし、以下「指定証券金融会社」という。）から当社の利用する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（以下「貸借取引」という。）に関して、必要な事項を定める。

2 この規則の変更は、当社の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。

### (定義)

#### 第2条

この規則において、PTS信用取引とは、信用取引のうち、当社が行う認可業務による取引所外売買において、PTS取引参加者が顧客に信用を供与するものをいう。

2 この規則において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ものをいう。

イ 品貸料 銘柄ごとに株式会社東京証券取引所が定める料率と同一とする。

ロ 弁済の繰越期限 PTS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し出をしない場合は、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できない。

3 この規則においてPTS一般信用取引とは、品貸料及び弁済の繰延期限について、PTS取引参加者が顧客との間で合意した内容に従って行うものをいう。

4 PTS貸借取引 次に掲げる取引の決済のためにPTS取引参加者又はPTS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、指定証券金融会社から株式会社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。

イ PTS制度信用取引

ロ PTS取引参加者が自己の計算において行う有価証券の売買（当該当社の認可業務による取引所外売買によるものであり、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(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。)

#### **(PTS 取引参加者による PTS 信用取引取扱規則の遵守)**

##### **第3条**

PTS 取引参加者は、PTS 信用取引又は第2条第4項口に掲げる取引を行うに当たっては、当該取引に係る認可業務を行う当社が定める本 PTS 信用取引取扱規則を遵守しなければならない。

2 PTS 取引参加者は、取次者(PTS 取引参加者に有価証券の売買の委託をした顧客が、金融商品取引業者である場合であって、当該委託が PTS 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。)が次の各号に掲げる取引を行うに当たっては、当社が定める本 PTS 信用取引取扱規則を当該取次者に周知し、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 PTS 取引参加者への委託の取次ぎ
- (2) 自己の計算において行う有価証券の売買(当社の認可業務による取引所外売買によるものであり、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(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。)

## **第2章 信用取引**

### **(PTS 取引参加者の範囲)**

#### **第4条**

PTS 信用取引の PTS 取引参加者は、次の各号に掲げる全ての要件を満たし、かつ、第7条に定める契約を締結している者とする。

- (1) 株式会社東京証券取引所の取引参加者のうち、有価証券の売買を行うための取引資格を有すること。
- (2) 株式会社日本証券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有し、又は当該現物清算資格を有する者に対し有価証券等清算取次ぎに係る委託を行っていること。

### **(PTS 信用取引を取り扱う時間)**

#### **第5条**

当社の PTS 信用取引(信用取引により貸付けを受けた売買代金又は売付有価証券の弁済のための売買を含む。)を取り扱う時間は、午前9時から11時30分まで及び午後0時30分から3時までとする。

### **(情報の報告等)**

#### **第6条**

PTS 取引参加者は、当社に対し、次に掲げる情報の報告等を行うものとする。

イ 信用取引残高（銘柄別残高・現在高）

ロ 信用取引売買手口情報

ハ 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必要と認める情報

#### **（相互保証に係る契約）**

##### **第 7 条**

PTS 貸借取引を行う PTS 取引参加者は、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ものとする。（当該 PTS 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 PTS 取引参加者から有価証券等清算取次ぎを委託された者について、PTS 取引参加者が同契約を締結させるものとする。）

#### **（利益相反防止体制に係る事項）**

##### **第 8 条**

当社と資本関係のある PTS 取引参加者は、PTS 信用取引に関し、資金及び上場株券等の提供者となることができない。本条において、資本関係とは、当社が、①20%以上の議決権を直接又は間接に保有（当社の親会社及びその子会社（当社を除く。）による保有も含む。）する関係、又は②当社の 20%以上の議決権を直接又は間接に保有（親会社及びその子会社（当該会社を除く。）による保有も含む。）する関係（①に該当するものを除く）をいうものとする。

#### **（PTS 取引参加者による証券金融会社に対する報告）**

##### **第 9 条**

当社は、指定証券金融会社から PTS 貸借取引の公正かつ円滑な運営に資することを目的として第 6 条に掲げる情報その他指定証券金融会社との間で合意した情報の提供の要請があった場合は、当該要請に応じるものとする。

#### **（資金又は上場株券等の提供の禁止）**

##### **第 10 条**

当社は、自らの顧客又は PTS 取引参加者に対し、PTS 信用取引の実質的な資金又は上場株券等の提供を行わないものとする。

#### **（PTS 信用取引取扱規則の公表）**

##### **第 11 条**

当社は、次の各号に掲げる事項について、当社ウェブサイトで公表するものとする。

イ PTS 信用取引取扱規則

ロ 当社が講じた PTS 信用取引の規制措置の内容

ハ 当社が取り扱う銘柄別の PTS 信用取引週末残高

ニ 当社の認可業務における PTS 信用取引現在高及び社内対当数量

#### **（売買の報告）**

##### **第 12 条**

当社は、日本証券業協会の定める規則に従い、PTS 信用取引により成立させた売買について

同協会に報告する。

#### **（役員及び従業員に対する信用取引の禁止）**

##### **第 13 条**

PTS 取引参加者は、自己の役員又は従業員のために信用取引を行わないものとする。

#### **（信用取引における貸付けに係る対価の算出）**

##### **第 14 条**

PTS 取引参加者は、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くてはならない。

#### **（信用取引に関する通知書の送付）**

##### **第 15 条**

PTS 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金融商品取引法第 45 条若しくは金融商品取引業等に関する内閣府令（平成 19 年内閣府令第 52 号）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 制度信用取引に係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 一般信用取引に係る第 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 PTS 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（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であって金融商品取引業等に関する内閣府令第 56 条（第 1 項第 1 号ニ、第 2 項第 3 号ロ及び第 4 号を除き、同項第 3 号中「に掲げられた取引を最後に行った」とあるのは「を記録した」と読み替える。）に定める方法と同様の方法をいう。以下同じ。）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 PTS 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 PTS 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、この限りでない。

### **第3章 制度信用取引**

#### **(制度信用銘柄以外の銘柄の制度信用取引の禁止)**

##### **第16条**

PTS 取引参加者は、私設取引システム運営業務規程第11条に掲げる有価証券のうち PTS 制度信用取引を行うことができる銘柄（以下「PTS 制度信用銘柄」という。）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。

2 PTS 制度信用銘柄の選定は、株式会社東京証券取引所が規則により選定する制度信用銘柄のうち、指定証券金融会社が選定した銘柄から、当社が定める規則により行う。

#### **(制度信用取引の品貸料)**

##### **第17条**

貸借取引により金銭及び有価証券の貸付けを受けることができる銘柄（以下「PTS 貸借銘柄」という。）の PTS 制度信用取引に係る品貸料は、銘柄ごとに株式会社東京証券取引所が定める料率と同一とする。

#### **(制度信用取引に係る権利処理)**

##### **第18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については、当社が規則により定める。

### **第4章 貸借取引**

#### **(貸借銘柄)**

##### **第19条**

PTS 貸借銘柄は、PTS 制度信用銘柄のうちから当社が選定する。

2 PTS 貸借銘柄の選定は、株式会社東京証券取引所が規則により選定する貸借銘柄のうち、指定証券金融会社が選定した銘柄から、当社が定める規則により行う。

#### **(貸借取引の制限)**

##### **第20条**

PTS 取引参加者は、第2条4項イ及びロに係る決済以外のために PTS 貸借取引を行ってはならない。

#### **(貸借取引の決済等)**

##### **第21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、株式会社日本証券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。

### **第5章 自己の信用取引・他市場制度信用取引・必要事項の決定**

#### **(自己の信用売り又は信用買いの決済期限)**

##### **第22条**

PTS 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（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。

#### **（有価証券等清算取次ぎに対する適用）**

##### **第23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PTS 取引参加者を当該有価証券の売買を行う者と、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PTS 取引参加者を当該貸借取引を行う者とみなしてこの規則（第21条を除く。）を適用する。

#### **（他市場制度信用取引の未決済勘定）**

##### **第24条**

PTS 制度信用銘柄である銘柄が、金融商品取引所のいずれかにおいて上場廃止となる場合であつて、かつ、当該上場廃止となる国内の金融商品取引所が開設する取引所金融商品市場における顧客の当該銘柄の売買に係る他市場制度信用取引（国内の金融商品取引所が開設する取引所金融商品市場又はPTSにおける有価証券の売買に係る信用取引のうち、品貸料及び弁済の繰延期限について当該金融商品取引所又はPTS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、その旨及び取扱いを開始する日をPTS 取引参加者と当該顧客が合意したときは、当該他市場制度信用取引に係る未決済勘定は、当該日以後PTS 制度信用取引に係る未決済勘定とみなす。この場合において、当該日は、当該上場廃止の日の前日（休業日に当たるときは、順次繰り上げる。）以後の日であることを要するものとする。

#### **（信用取引及び貸借取引に関する必要事項の決定）**

##### **第25条**

当社は、この規則に定める事項のほか、PTS 信用取引及びPTS 貸借取引に関して必要がある場合には、法令及び日本証券業協会の諸規則に定める範囲内において、所要の取扱いについて規則により定めることができる。

### **第6章 有価証券の売買の受託の条件等**

#### **（信用取引口座設定約諾書の差入れ）**

##### **第26条**

PTS 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、当該顧客から株式会社東京証券取引所が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、これに署名又は記名押印したものに限る。）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 PTS 取引参加者は、前項に規定するPTS 信用取引に係る合意書の差入れに代えて、日本証券業協会が定める「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り、当該確認書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ることができる。

#### **（委託の際の指示事項）**

## 第27条

PTS取引参加者は、その顧客が有価証券の売買の委託をする場合には、その都度、その顧客に次の各号に掲げる事項をPTS取引参加者に対して指示させるものとする。

- (1) 空売りを行おうとするときは、有価証券の取引等の規制に関する内閣府令（平成19年内閣府令第59号。以下「取引規制府令」という。）第11条第1項に規定する取引を除き、その旨
- (2) 信用取引(金融商品取引所信用取引及びPTS信用取引)により行おうとするときは、その旨
- (3) 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は、その旨
- (4) 顧客が取次者である場合において、信用取引に係る売買の委託の取次ぎを引き受けたときは、その旨
- (5) 顧客が取次者である場合において、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ぎを引き受けたときは、その旨
- (6) 当該委託が高速取引行為（法第2条第41項に規定する高速取引行為をいう。以下同じ）に係るものであるときは、その旨

2 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、前項第2号の指示を行わなかった場合には、当該売買は信用取引によることができない。

3 顧客は、信用取引による売付け又は買付けを委託する場合には、制度信用取引によるものか一般信用取引によるものかの別をPTS取引参加者に指示するものとする。

4 顧客は、第1項第1号の指示を行う空売りを委託する場合には、取引規制府令第15条第1項各号に規定する取引であるか否かの別を、PTS取引参加者に対し明らかにするものとする。

5 顧客は、高速取引行為に係る有価証券の売買を委託する場合には、その都度、当社が別に定める高速取引行為に係る取引戦略の別を、取引参加者に対し指示するものとする。

## 第7章 有価証券の売買の受託についての信用の供与に関する事項 (信用取引に係る委託保証金の差入れ)

### 第28条

PTS制度信用取引による売付け又は買付けが成立したときは、顧客は、次の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日目の日正午までのPTS取引参加者が指定する日時までに差し入れるものとする。

- (1) 差入れの際、当該顧客の信用取引に係る受入保証金がない場合

- a 当該信用取引に係る有価証券の約定価額に100分の30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
  - b 当該信用取引に係る通常の最低限度額が30万円に満たないときは、30万円
- (2) 差入れの際、当該顧客の信用取引に係る受入保証金がある場合
- a 当該信用取引に係る通常の最低限度額と当該顧客の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、当該信用取引に係る通常の最低限度額
  - b 当該信用取引に係る通常の最低限度額と当該顧客の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、その差額を当該信用取引に係る通常の最低限度額に加算した額

#### **（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 制度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。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、外国株券等及び受益証券発行信託の受益証券をいう。以下同じ。）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

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

(物価連動国債にあつては、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)

#### **(信用取引による有価証券又は金銭の貸付け)**

##### **第30条**

PTS 取引参加者は、PTS 制度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け代金及び委託保証金を担保として当該売付け有価証券の貸付けを行うものとし、PTS 制度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け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け有価証券又は買付け代金の貸付けは、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株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ら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、PTS 取引参加者は、第2条第2項イに定める品貸料を、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。

#### **(品貸料を授受する期間)**

##### **第31条**

前条第2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とする。

#### **(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32条**

PTS 制度信用取引による売付け有価証券又は買付け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し出をしない場合は、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。)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け有価証券又は買付け代金の貸付けの弁済期限は、株式分割又は株式無償割当て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(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には順次繰り上げる。)から起算して3日目の日を超えて繰り延べるできない。

## （信用取引に係る委託保証金の引出し等）

### 第33条

PTS 取引参加者は、顧客から PTS 制度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) 当該顧客の信用取引（当該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a及び第2号a、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b及び第2号b、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、PTS 取引参加者は、顧客から PTS 制度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（aに掲げる額からb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。）
  - a 当該顧客の信用取引に係る受入保証金の総額
  - b 前aの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信用取引に係る委託保証金として差し入れさせることを条件とするとき（その差入れ後においてaに掲げる額がbに掲げる額以上となる場合に限る。）。
  - a 当該顧客の信用取引に係る受入保証金の総額
  - b 前aの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 PTS 取引参加者は、その顧客のために新たな PTS 制度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 制度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28条の規定により当該新たな PTS 制度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) 当該顧客の信用取引に係る受入保証金の総額

(2) 前号の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b及び第2号b、前項第2号並びに次条第3項の約定価額は、PTS 制度信用取引に係る一切の有価証券のうち権利落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b及び第2号b並びに前項第2号の約定価額（当該権利落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 PTS 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。

#### **（信用取引に係る受入保証金の計算方法）**

##### **第34条**

第28条第2号、前条第1項第1号、同条第2項第1号a及び第2号a、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a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 制度信用取引の第1号に掲げる額を差し引かないものとする。なお、受入保証金の計算にあたっては、PTS 取引参加者と顧客との間の他の市場（金融商品取引所が開設する取引所金融商品市場及び PTS を指す。）における信用取引を合算する。

(1) 顧客の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借料その他のものであって、当該顧客の信用取引について顧客の負担すべきものの合計額（信用取引により売り付けた有価証券が権利落したことに伴い顧客が負担することと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) 顧客の信用取引について、当該顧客に対し当該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 PTS 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 PTS 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 制度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時価(前日の最終価格(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 制度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 28 条第 2 号、前条第 1 項第 1 号、同条第 2 項第 1 号 a 及び第 2 号 a、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。

#### **(信用取引に係る計算上の利益の引出し等の制限)**

##### **第 35 条**

PTS 取引参加者は、その顧客の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又は有価証券を交付し又は委託保証金として差し入れさせるべき金銭の額に充当してはならない。なお、上記の「信用取引」とは、PTS 取引参加者と顧客との間の他の市場(金融商品取引所が開設する取引所金融商品市場及び PTS を指す。)における信用取引も合算する。

#### **(信用取引に係る委託保証金の追加差入れ)**

##### **第 36 条**

PTS 取引参加者は、その顧客の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。なお、上記の「信用取引」とは、PTS 取引参加者と顧客との間の他の市場(金融商品取引所が開設する取引所金融商品市場及び PTS を指す。)における信用取引も合算する。

#### **(信用取引に係る委託保証金の維持)**

##### **第 37 条**

PTS 取引参加者は、PTS 制度信用取引に係る受入保証金の総額が、その顧客の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 日目の日までの PTS 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 PTS 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日目の日までのPTS 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、顧客が弁済の申し出を行った場合（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、当該弁済の申し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 PTS 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日目の日までのPTS 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、株式無償割当て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、募集株式の割当て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てを受ける権利を含む。）又は新株予約権の割当てを受ける権利（以下「株式分割等による株式を受ける権利等」という。）が付与された有価証券についてのPTS 制度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。

#### **（株式分割等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**

PTS 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は、買付約定価額から当社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。）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は、担保として提供を受けた売付代金の額から当社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て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の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て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ての効力発生日である場合に限る。）で、当社が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式割当率に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式割当率に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**

顧客の他市場制度信用取引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、PTS 取引参加者と顧客が合意した場合は、当該他市場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。

### **第8章 顧客の決済不履行の場合の措置**

#### **(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 PTS 取引参加者に交付しないとき、発行日決済取引に関し預託すべき委託保証金又は損失計算が生じた場合において損失に相当する額の金銭を PTS 取引参加者に預託しないとき及び PTS 制度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 PTS 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場合には、PTS 取引参加者は、任意に、当該売買又は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 PTS 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、その不足額の支払を顧客に対し請求することができる。

### **第9章 呼値**

#### **(呼値)**

#### **第42条**

PTS 取引参加者は、PTS において売買を行おうとするときは、私設取引システム運営業務規程第15条に基づいて呼値を行わなければならない。

### **第10章 規制措置**

#### **(有価証券の売買又はその受託に関する規制措置)**

#### **第43条**

私設取引システム運営業務規程の規定に基づき、当社が PTS 信用取引に係る有価証券の売買又はその受託に関し PTS 取引参加者に求める（PTS 取引参加者がその顧客に求めることも含む）規制措置は、次の各号に掲げるものとする。

- (1) 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) 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) 信用取引による売付け又は買付けに係る委託保証金の有価証券をもってする代用の制限を行う場合において、当該委託保証金のうち有価証券をもって代用することができない部分の全部又は一部に相当する額の金銭の PTS 取引参加者による当社への預託

- (4) 信用取引による売付け若しくは買付け（PTS 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
- (5) 顧客の委託に基づく売付有価証券又は買付代金の決済日前における預託の受入れ
- (6) PTS 取引参加者の自己の計算による売付け又は買付け（取引一任契約に基づく売付け又は買付けを含む。）の制限又は禁止
- (7) 信用取引残高の日々公表

2 当社は、次に掲げる銘柄については当該各号に掲げる規制措置を講じるものとする。

- (1) 株式会社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) 株式会社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) 株式会社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（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。）措置を行っている銘柄  
PTS 信用取引に係る委託保証金の率の引上げ（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。）措置
- (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

**（特設注意市場銘柄等に指定された銘柄等に係る信用取引残高の公表）**

**第 4 4 条**

当社は、PTS 制度信用取引を行うことができる銘柄が、次の各号のいずれかに該当した場合には、その信用取引残高を日々公表するものとする。

- (1) 当該銘柄に関し、株式会社東京証券取引所の業務規程に基づく投資者への注意喚起が行われた場合であって、当社が必要と認めたとき。
- (2) 株式会社東京証券取引所の定める有価証券上場規程に規定する特設注意市場銘柄に指定されたとき。

**第 1 1 章 東京証券取引所の規程等の準用等・PTS 取引参加者による履行**

**（東京証券取引所の規程等の準用・PTS 取引参加者による履行）**

**第 4 5 条**

PTS 信用取引に関し、本 PTS 信用取引取扱規則並びに当社の業務方法書及び当社の定める私設取引システム運営業務規程その他の規則に定めのない事項については、東京証券取引所の諸規則及び諸規則内規を準用する。



2 本規則第 28 条から 41 条については、PTS 取引参加者は、東京証券取引所の規程・規則類に基づき、東京証券取引所を通じた信用取引の場合に行うものと同等の行為を当社との間の PTS 信用取引で行うことができる（かかる PTS 取引参加者の行為により、本条の義務は履行されたものとみなす。）。

#### 附則

1 当社が、PTS 信用取引の取扱いを開始する日において、株式会社東京証券取引所が整理銘柄に指定している銘柄は、PTS 制度信用銘柄及び PTS 貸借銘柄からは除外するものとし、除外した銘柄は当社ウェブサイトにて公表する。

2 本規則は、2019 年 8 月 23 日より施行する。

以上