

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 1 条の 3 第 2 項の規定に基づき、本所の市場（本所の開設する取引所金融商品市場をいう。以下同じ。）における有価証券の売買等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、取締役会の決議により行う。ただし、変更の内容が軽微な場合は、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、J - N E T 市場に関する業務規程、信用取引・貸借取引規程及び受託契約準則の特例（以下「J - N E T 市場特例」という。）、国債証券に関する業務規程の特例並びに外国債券に関する業務規程の特例において定めるところによるものとする。

2 この規程において使用する指数先物取引（金融商品取引法（昭和 23 年法律第 25 号。以下「法」という。）第 2 条第 21 項第 2 号に掲げる取引のうち指数に係るものをいう。以下同じ。）に係る用語の意義は、この規程に別に定める場合を除き、指数先物取引に関する業務規程及び受託契約準則の特例（以下「指数先

物特例」という。)並びに「J-NET市場特例」において定めるところによるものとする。

- 3 この規程において使用する個別証券オプション取引（法第2条第21項第3号に掲げる取引のうち有価証券の売買に係るものをいう。以下同じ。）に係る用語（有価証券の売買について使用する用語を除く。）の意義は，この規程に別に定める場合を除き，個別証券オプション取引に関する業務規程，信用取引・貸借取引規程及び受託契約準則の特例（以下「個別証券オプション特例」という。）並びに「J-NET市場特例」において定めるところによるものとする。
- 4 この規程において使用する指数オプション取引（法第2条第21項第3号に掲げる取引のうち同項第2号に掲げる取引に準ずる取引として業務規程に定める取引（指数に係る取引に限る。）に係るものをいう。以下同じ。）に係る用語の意義は，この規程に別に定める場合を除き，指数オプション取引に関する業務規程及び受託契約準則の特例（以下「指数オプション特例」という。）並びに「J-NET市場特例」において定めるところによるものとする。
- 5 この規程において使用する取引所外国為替証拠金取引（法第2条第21項第2号に掲げる取引のうち通貨の価格に係るものをいう。以下「取引所FX取引」という。）に係る用語の意義は，この規程に別に定める場合を除き，取引所外国為替証拠金取引に関する業務規程及び受託契約準則の特例（以下「取引所FX取引特例」という。）において定めるところによるものとする。
- 6 この規程において使用する取引参加者に係る用語の意義は，

この規程に別に定める場合を除き，取引参加者規程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等を行う者の指定等）

第3条 本所は，本所の市場において成立した有価証券の売買（個別証券オプション取引における権利行使により成立するオプション対象証券の売買を含む。以下同じ。）に関し，金融商品債務引受業等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。

2 本所は，本所の市場において成立した指数先物取引，個別証券オプション取引及び指数オプション取引（以下「先物・オプション取引」という。）並びに取引所F×取引に関し，金融商品債務引受業を自ら行う。

第2章 清算参加者の決済

（清算参加者の決済）

第4条 本所の市場において成立した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。）とクリアリング機構との間で行う。

2 本所の市場において成立した先物・オプション取引の決済は，本所の業務方法書の定めるところにより先物・オプション清算

参加者（先物・オプション清算資格（本所の業務方法書第4条第1項第1号に規定する先物・オプション清算資格をいう。以下同じ。）を有する者をいう。以下同じ。）と本所との間で行う。

- 3 本所の市場において成立した取引所F×取引の決済は、本所の業務方法書の定めるところによりF×清算参加者（F×清算資格（本所の業務方法書第4条第1項第2号に規定するF×清算資格をいう。以下同じ。）を有する者をいう。以下同じ。）と本所との間で行う。

第3章 非清算参加者と清算参加者との間の決済

第1節 有価証券の売買に係る決済

第1款 株券等の売買に係る決済

（受渡時限）

第5条 現物非清算参加者（取引参加者規程第24条第1項に規定する現物非清算参加者をいう。以下同じ。）である取引参加者（先物取引等取引参加者及び外国為替証拠金取引参加者を除く。以下この款において同じ。）は、有価証券等清算取次ぎの委託に基づく有価証券（国債証券を除く。以下この款において同じ。）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現物清算参加者（当該現物非清算参加者である取引参加者が取引参加者規程第27条第1項の規定により指定した現物他社清算参加者（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。以下同じ。)をいう。以下この節において同じ。)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現物清算参加者に交付するものとする。

(D V P 決済を利用する場合の受渡し)

第 5 条の 2 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、現物非清算参加者である取引参加者と指定現物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 D V P 決済を利用する場合には、現物非清算参加者である取引参加者は、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、合意に際して指定現物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 現物非清算参加者である取引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 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の決済のために現物非清算参加者である取引参加者と指定現物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、発行日取引及び立会外分売に係る売買（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現物非清算参加者である取引参加
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) 当日取引（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現物非清算参加者である取引参加
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

第7条 削 除

（引渡有価証券）

第8条 指定現物清算参加者に出資証券の有価証券等清算取次ぎ
の委託をした現物非清算参加者である取引参加者が，その決済
のために引き渡す有価証券は，売買単位の券種の出資証券又は
他の券種の出資証券で各出資証券の表示する出資の口数の合
計が売買単位となるように組み合わせたものでなければなら
ない。

2 前項の規定にかかわらず，出資証券の売買の決済において，
指定現物清算参加者が同意した場合には，現物非清算参加者で
ある取引参加者は，他の券種の出資証券を引き渡すことができ
る。

（旧株券と新株券の銘柄併合時の取扱い）

第9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。

第10条及び第11条 削除

（有価証券の決済の繰延べ）

第12条 現物非清算参加者である取引参加者は，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，指定現物清算参加者の承諾を受けたときは，本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（業務規程第3条第1項に規定する休業日をいい，同条第2項に規定する臨時休業日を含む。以下同じ。）に当たるときは，順次繰り下げる。以下同じ。）に繰り延べることができる。

（発行日取引の清算値段）

第13条 発行日取引の清算値段は，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。

（発行日取引の約定値段と清算値段との差額の支払い）

第14条 現物非清算参加者である取引参加者は、有価証券等清算取次ぎの委託に基づく発行日取引について、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現物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、金銭を支払う現物非清算参加者である取引参加者は、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現物清算参加者が指定する日時までに、当該指定現物清算参加者に交付するものとする。

（発行日取引の清算値段間の差額の支払い）

第15条 現物非清算参加者である取引参加者は、有価証券等清算取次ぎの委託に基づく発行日取引について、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現物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、金銭を支払う現物非清算参加者である取引参加者は、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現物清算参加者が指定する日時までに、当該指定現物清算参加者に交付するものとする。

（発行日取引の決済値段）

第16条 発行日取引の決済値段は、当該発行日取引の最終日の清算値段とする。

（発行日取引の売買証拠金）

第17条 現物非清算参加者である取引参加者は、有価証券等清算取次ぎの委託に基づく発行日取引が成立したときは、本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。以下日数計算について同じ。）の日の正午までの指定現物清算参加者が指定する日時までに、当該指定現物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、本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2款 国債証券の売買に係る決済

（受渡時限）

第18条 現物非清算参加者である現物取引参加者は、有価証券等清算取次ぎの委託に基づく国債証券の売買（過誤訂正等のための売買を含む。以下同じ。）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現物清算参加者が指定する日時までに、売付国債証券又は買付代金を指定現物清算参加者に交付するものとする。

（国債証券の決済の繰延べ）

第19条 現物非清算参加者である現物取引参加者は、有価証券等清算取次ぎの委託に基づく国債証券の売買について前条に規

定する受渡時限までに国債証券の引渡しを行うことができない場合において，指定現物清算参加者の承諾を受けたときは，本所の定めるところにより，当該国債証券の引渡しをその翌日以降の日に繰り延べることができる。

第 2 節 指数先物取引に係る決済

（転売又は買戻し）

第20条 先物・オプション非清算参加者（取引参加者規程第24条第2項に規定する先物・オプション非清算参加者をいう。以下同じ。）は，指数先物取引の各限月取引について，有価証券等清算取次ぎの委託に基づく買建玉（以下「清算取次買建玉」という。）に係る転売又は有価証券等清算取次ぎの委託に基づく売建玉（以下「清算取次売建玉」という。）に係る買戻しが成立した場合には，各限月取引ごとに転売又は買戻しの別及び数量を，顧客の委託に基づくものと自己の計算によるものとに区分して本所が定める時限までに本所に申告するものとする。

2 先物・オプション非清算参加者が国外取引参加者（取引参加者規程第2条第3項に規定する先物取引等取引資格を有する取引所取引許可業者をいう。以下同じ。）である場合には，前項の規定による申告は，当該先物・オプション非清算参加者が同項に規定する時限までの指定先物・オプション清算参加者（当該先物・オプション非清算参加者が取引参加者規程第27条第1項の規定により指定した先物・オプション他社清算参加者（本所の業務方法書第4条第2項に規定する先物・オプション他社清算参加者をいう。以下同じ。）をいう。以下同じ。）が指

定する時限までに指定先物・オプション清算参加者に申告し、指定先物・オプション清算参加者が業務方法書第47条第1項の規定に基づき本所に申告することにより行うものとする。

- 3 国外取引参加者以外の先物・オプション非清算参加者は、第1項の規定による申告を行ったときは、遅滞なくその旨を指定先物・オプション清算参加者に通知しなければならない。

(清算数値)

第21条 指数先物取引の清算数値は、本所の業務方法書第48条に規定する清算数値とする。

(約定数値と清算数値との差に相当する金銭の授受)

第22条 先物・オプション非清算参加者は、有価証券等清算取次ぎの委託に基づく指数先物取引（過誤訂正等のための取引を含む。以下同じ。）について、約定数値と当該取引契約締結を行った取引日の清算数値とを比較して差を生じたときは、その差に相当する金銭を、指定先物・オプション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、金銭を支払う先物・オプション非清算参加者は、当該差に相当する金銭を、取引契約締結を行った取引日の終了する日の翌日の午後1時までの指定先物・オプション清算参加者が指定する日時までに、当該指定先物・オプション清算参加者に交付しなければならない。

(清算数値間の差に相当する金銭の授受)

第23条 先物・オプション非清算参加者は、有価証券等清算取次ぎの委託に基づく指数先物取引について、当該取引日の清算数

値と前取引日の清算数値とを比較して差を生じたときは，その差に相当する金銭を，指定先物・オプション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，金銭を支払う先物・オプション非清算参加者は，当該差に相当する金銭を，当該取引日が終了する日の翌日の午後１時までの指定先物・オプション清算参加者が指定する日時までに，当該指定先物・オプション清算参加者に交付しなければならない。

（最終決済に伴う金銭の授受）

第24条 先物・オプション非清算参加者は，最終決済において，最終清算数値と取引最終日の清算数値とを比較して差を生じたときは，その差に相当する金銭を最終決済期日において，指定先物・オプション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，金銭を支払う先物・オプション非清算参加者は，当該金銭の授受を行う日の午後１時までの指定先物・オプション清算参加者が指定する日時までに，当該指定先物・オプション清算参加者に交付しなければならない。

第３節 個別証券オプション取引に係る決済

（転売又は買戻し）

第25条 先物・オプション非清算参加者は，個別証券オプション取引の各銘柄について，清算取次買建玉に係る転売又は清算取次売建玉に係る買戻しが成立した場合には，各銘柄ごとに転売又は買戻しの別及び数量を，顧客の委託に基づくものと自己の計算によるものとに区分して本所が定める時限までに本所に

申告するものとする。

- 2 先物・オプション非清算参加者が国外取引参加者である場合には、前項の規定による申告は、当該先物・オプション非清算参加者が同項に規定する時限までの指定先物・オプション清算参加者が指定する時限までに指定先物・オプション清算参加者に申告し、指定先物・オプション清算参加者が業務方法書第53条第1項の規定に基づき本所に申告することにより行うものとする。
- 3 国外取引参加者以外の先物・オプション非清算参加者は、第1項の規定による申告を行ったときは、遅滞なくその旨を指定先物・オプション清算参加者に通知しなければならない。

（取引代金の授受）

第26条 先物・オプション非清算参加者は、有価証券等清算取次ぎの委託に基づく個別証券オプション取引（過誤訂正等のための取引を含む。以下同じ。）が成立したときは、その取引代金（1単位当たりについて、円位未満の端数を生じた場合は、切り捨てる。以下この節において同じ。）を、指定先物・オプション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、金銭を支払う先物・オプション非清算参加者は、取引契約締結の日の翌日の午後1時までの指定先物・オプション清算参加者が指定する日時までに、当該指定先物・オプション清算参加者に金銭を交付しなければならない。

（権利行使の申告）

第27条 個別証券オプション取引の清算取次買建玉についての権

利行使は，先物・オプション非清算参加者が，各銘柄ごとに権利行使に係る数量を，顧客の委託に基づくものと自己の計算によるものとに区分して本所が定める時限までに本所に申告することにより行うものとする。

2 先物・オプション非清算参加者が国外取引参加者である場合には，前項の権利行使の申告は，当該先物・オプション非清算参加者が同項に規定する時限までの指定先物・オプション清算参加者が指定する時限までに指定先物・オプション清算参加者に申告し，指定先物・オプション清算参加者が業務方法書第55条第1項の規定に基づき本所に申告することにより行うものとする。

3 権利行使日において次の各号に定める場合に該当する銘柄については，当該日の第1項に規定する時限までに同項の権利行使の申告が行われないうちであっても，当該権利行使の申告が行われたものとみなす。ただし，当該銘柄について，先物・オプション非清算参加者が当該時限までに権利行使を行わない旨の申告を行った場合には，この限りでない。

(1) 個別証券プットオプションについては，権利行使価格が権利行使日のオプション清算値段を上回っている場合

(2) 個別証券コールオプションについては，権利行使価格が権利行使日のオプション清算値段を下回っている場合

4 先物・オプション非清算参加者は，第1項の権利行使の申告を行ったときは，遅滞なくその旨を次の各号（当該先物・オプション非清算参加者が国外取引参加者である場合にあっては，第2号）に掲げる者に通知しなければならない。

(1) 指定先物・オプション清算参加者

(2) 指定現物清算参加者（当該先物・オプション非清算参加者が取引参加者規程第27条第1項の規定により指定した現物他社清算参加者をいう。第29条の2から第30条までを除き以下同じ。）（当該先物・オプション非清算参加者が現物非清算参加者である場合に限る。）

（権利行使の割当てに関する通知）

第28条 本所は，本所の業務方法書第56条第1項に定めるところにより権利行使の割当てを行った場合（清算取次売建玉に対する割当ての場合に限る。）は，当該清算取次売建玉に係る先物・オプション非清算参加者に当該割当てに係る数量を，顧客の委託に基づくものと自己の計算によるものとに区分して通知するものとする。

2 先物・オプション非清算参加者が国外取引参加者である場合には，前項の規定による権利行使の割当ての通知は，本所が指定先物・オプション清算参加者に通知し，指定先物・オプション清算参加者が業務方法書第56条第4項の規定に基づき当該先物・オプション非清算参加者に通知することにより行うものとする。

3 先物・オプション非清算参加者は，第1項の規定による権利行使の割当ての通知を受けた場合は，遅滞なくその旨を次の各号（当該先物・オプション非清算参加者が国外取引参加者である場合にあっては，第2号）に掲げる者に通知しなければならない。

(1) 指定先物・オプション清算参加者

(2) 指定現物清算参加者（当該先物・オプション非清算参加者

が現物非清算参加者である場合に限る。)

(清算取次売建玉又は清算取次買建玉の権利行使によるオプション対象証券の売買の取扱い)

第29条 個別証券オプション取引における権利行使により成立するオプション対象証券の売買が清算取次売建玉又は清算取次買建玉に係るものである場合には，当該権利行使により成立するオプション対象証券の売買は，有価証券等清算取次ぎの委託に基づき成立したものとみなして，この規程を適用する。

(権利行使に係る決済時限)

第29条の2 現物非清算参加者である先物・オプション清算参加者（先物・オプション清算資格を有する者をいう。以下同じ。）は，権利行使により成立するオプション対象証券の売買（清算取次売建玉又は清算取次買建玉に係るものを除く。以下第30条までにおいて同じ。）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現物清算参加者（当該先物・オプション清算参加者が取引参加者規程第27条第1項の規定により指定した現物他社清算参加者をいう。以下第30条までにおいて同じ。）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現物清算参加者に交付するものとする。

(D V P 決済を利用する場合の受渡し)

第29条の3 権利行使により成立するオプション対象証券の売買について，現物非清算参加者である先物・オプション清算参加者と指定現物清算参加者との合意により，ほふりクリアリング

の業務方法書に規定するDVP決済を利用する場合には、現物非清算参加者である先物・オプション清算参加者は、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、合意に際して指定現物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 現物非清算参加者である先物・オプション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30条 権利行使により成立するオプション対象証券の売買の決済のために現物非清算参加者である先物・オプション清算参加者が指定現物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、次の各号に定める区分に従い、当該各号に定めるところによる。

- (1) 個別証券オプション1単位のオプション対象証券の数量がオプション対象証券の売買単位の数量である場合

第6条第1号の規定を準用する。

- (2) 個別証券オプション1単位のオプション対象証券の数量がオプション対象証券の売買単位の数量を上回る場合

権利行使により成立するオプション対象証券の売買において、現物非清算参加者である先物・オプション清算参加者が、当該オプション対象証券を買い付けたときはaに規定する買付代金を、当該オプション対象証券を売り付けたときはbに

規定する金銭及び c に規定する有価証券を，それぞれ交付するものとする。

a 権利行使により成立するオプション対象証券の売買に係る買付代金（個別証券オプション 1 単位のオプション対象証券の数量に権利行使価格を乗じた額（円位未満の端数を生じた場合は，切り捨てる。）に，当該権利行使に係る個別証券オプションの数量を乗じて算出した額。次号において同じ。）

b 売買単位未満数量（個別証券オプション 1 単位のオプション対象証券の数量から当該オプション対象証券の売買単位の整数倍の数量を差し引いた数量で当該売買単位に満たない数量をいう。以下この条において同じ。）にオプション清算値段を乗じた額（円位未満の端数を生じた場合は，切り捨てる。次号において同じ。）に，当該権利行使に係る個別証券オプションの数量を乗じて算出した額に相当する金銭

c 個別証券オプション 1 単位のオプション対象証券の数量から売買単位未満数量を差し引いた数量に当該権利行使に係る個別証券オプションの数量を乗じて算出した数量の有価証券

(3) 個別証券オプション 1 単位のオプション対象証券の数量が当該オプション対象証券の売買単位を下回る場合

権利行使により成立するオプション対象証券の売買において，現物非清算参加者である先物・オプション清算参加者が，当該オプション対象証券を買い付けたときは a に規定する買付代金を，当該オプション対象証券を売り付けたときは b に

規定する金銭を，それぞれ交付するものとする。

a 権利行使により成立するオプション対象証券の売買に係る買付代金

b 個別証券オプション１単位のオプション対象証券の数量にオプション清算値段を乗じて得た額に，当該権利行使に係る個別証券オプションの数量を乗じて算出した額に相当する金銭

2 前項第２号b及び第３号bの規定により授受する金銭の額は，権利行使により成立するオプション対象証券の売買において，現物非清算参加者である先物・オプション清算参加者が，当該オプション対象証券を売り付けたときは，第６条第１号に規定する総買付代金に，当該オプション対象証券を買い付けたときは，同号に規定する総売付代金に含めるものとする。

（清算取次売建玉又は清算取次買建玉に係る権利行使により成立するオプション対象証券の売買の決済）

第30条の２ 前３条の規定は，清算取次売建玉又は清算取次買建玉に係る権利行使により成立するオプション対象証券の売買の決済について準用する。この場合において，「現物非清算参加者である先物・オプション清算参加者」とあるのは「現物非清算参加者である先物・オプション非清算参加者」と，「指定現物清算参加者（当該先物・オプション清算参加者が取引参加者規程第27条第１項の規定により指定した現物他社清算参加者をいう。以下第30条までにおいて同じ。）」とあるのは「指定現物清算参加者（当該先物・オプション非清算参加者が取引参加者規程第27条第１項の規定により指定した現物他社清算参

加者をいう。)」と読み替えるものとする。

(決済物件の制限等)

第31条 第9条第1項及び第12条の規定は，第30条(前条において準用する場合を含む。)に規定する有価証券の授受に準用するものとする。

第4節 指数オプション取引に係る決済

(転売又は買戻し)

第32条 先物・オプション非清算参加者は，指数オプション取引の各銘柄について，清算取次買建玉に係る転売又は清算取次売建玉に係る買戻しが成立した場合には，銘柄ごとに転売又は買戻しの別及び数量を，顧客の委託に基づくものと自己の計算によるものとに区分して本所が定める時限までに本所に申告するものとする。

2 先物・オプション非清算参加者が国外取引参加者である場合には，前項の規定による申告は，当該先物・オプション非清算参加者が同項に規定する時限までの指定先物・オプション清算参加者が指定する時限までに指定先物・オプション清算参加者に申告し，指定先物・オプション清算参加者が業務方法書第58条第1項の規定に基づき本所に申告することにより行うものとする。

3 国外取引参加者以外の先物・オプション非清算参加者は，第1項の規定による申告を行ったときは，遅滞なくその旨を指定先物・オプション清算参加者に通知しなければならない。

(取引代金の授受)

第33条 先物・オプション非清算参加者は，有価証券等清算取次ぎの委託に基づく指数オプション取引（過誤訂正等のための取引を含む。以下同じ。）が成立したときは，その取引代金を，指定先物・オプション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，金銭を支払う先物・オプション非清算参加者は，取引契約締結を行った取引日の終了する日の翌日の午後1時までの指定先物・オプション清算参加者が指定する日時までに，当該指定先物・オプション清算参加者に金銭を交付しなければならない。

(権利行使の申告)

第34条 指数オプション取引の清算取次買建玉についての権利行使は，先物・オプション非清算参加者が，銘柄ごとに権利行使に係る数量を，顧客の委託に基づくものと自己の計算によるものとに区分して本所が定める時限までに本所に申告することにより行うものとする。

2 先物・オプション非清算参加者が国外取引参加者である場合には，前項の権利行使の申告は，当該先物・オプション非清算参加者が同項に規定する時限までの指定先物・オプション清算参加者が指定する時限までに指定先物・オプション清算参加者に申告し，指定先物・オプション清算参加者が業務方法書第60条第1項の規定に基づき本所に申告することにより行うものとする。

3 先物・オプション非清算参加者は，権利行使日において次の

各号に定める場合に該当する銘柄については，第1項の権利行使の申告を行うことができないものとする。

(1) 指数プットオプションについては，権利行使価格が権利行使日のオプション清算数値の数値以下である場合

(2) 指数コールオプションについては，権利行使価格が権利行使日のオプション清算数値の数値以上である場合

4 権利行使日において次の各号に定める場合に該当する銘柄については，当該日の第1項に規定する時限までに同項の権利行使の申告が行われないうちであっても，当該権利行使の申告が行われたものとみなす。ただし，当該銘柄について，先物・オプション非清算参加者が当該時限までに権利行使を行わない旨の申告を行った場合には，この限りでない。

(1) 指数プットオプションについては，権利行使価格が権利行使日のオプション清算数値の数値を上回っている場合

(2) 指数コールオプションについては，権利行使価格が権利行使日のオプション清算数値の数値を下回っている場合

5 国外取引参加者以外の先物・オプション非清算参加者は，第1項の権利行使の申告を行ったときは，遅滞なくその旨を指定先物・オプション清算参加者に通知しなければならない。

(権利行使の割当てに関する通知)

第35条 本所は，本所の業務方法書第61条第1項に定めるところにより権利行使の割当てを行った場合（清算取次売建玉に対する割当ての場合に限る。）は，当該清算取次売建玉に係る先物・オプション非清算参加者に当該割当てに係る数量を，顧客の委託に基づくものと自己の計算によるものとに区分して通知す

る。

- 2 先物・オプション非清算参加者が国外取引参加者である場合には，前項の規定による権利行使の割当ての通知は，本所が指定先物・オプション清算参加者に通知し，指定先物・オプション清算参加者が業務方法書第61条第4項の規定に基づき当該先物・オプション非清算参加者に通知することにより行うものとする。
- 3 国外取引参加者以外の先物・オプション非清算参加者が第1項の規定による権利行使の割当ての通知を受けた場合は，遅滞なくその旨を指定先物・オプション清算参加者に通知しなければならない。

（清算取次売建玉又は清算取次買建玉の権利行使による取引の取扱い）

第35条の2 指数オプション取引における権利行使により成立する取引が清算取次売建玉又は清算取次買建玉に係るものである場合には，当該権利行使により成立する取引は，有価証券等清算取次ぎの委託に基づき成立したものとみなして，この規程を適用する。

（権利行使に係る決済のための金銭の授受）

第36条 先物・オプション非清算参加者は，指数オプション取引において清算取次売建玉又は清算取次買建玉に係る権利行使が行われたときは，権利行使価格と権利行使日のオプション清算数値との差に相当する金銭を権利行使日の翌日において，指定先物・オプション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，金銭を支払う先物・オプション非清算参加者は，当該金銭を，その授受を行う日の午後１時までの指定先物・オプション清算参加者が指定する日時までに，当該指定先物・オプション清算参加者に交付しなければならない。

第５節 取引所 F X 取引に係る決済

（建玉の申告）

第36条の２ F X 非清算参加者（取引参加者規程第24条第３項に規定する F X 非清算参加者をいう。以下同じ。）は，対象金融指標ごとに，取引所 F X 取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく買建玉（以下「F X 清算取次買建玉」という。）又は有価証券等清算取次ぎの委託に基づく売建玉（以下「F X 清算取次売建玉」という。）の数量を，顧客の委託に基づくものと自己の計算によるものとに区分して，本所が定める時限までに本所に申告するものとする。ただし，転売又は買戻しをした場合には，当該転売又は買戻しの数量を，決済に係るものとして，減じて得た数量を申告するものとする。

２ F X 非清算参加者は，前項の申告を行う数量の計算を，各取引日（取引所 F X 取引特例第２条第15号に規定する取引日をいう。以下この節において同じ。）の立会終了後直ちに行い，記録するものとする。

３ F X 非清算参加者は，第１項に定める申告を行ったときは，遅滞なくその旨を指定 F X 清算参加者（当該 F X 非清算参加者が取引参加者規程第27条第１項の規定により指定した F X 他社清算参加者（本所の業務方法書第４条第２項に規定する F X

他社清算参加者をいう。以下同じ。)をいう。以下同じ。)に通知しなければならない。

(清算数値及びスワップポイント基準値)

第36条の3 取引所 F X 取引の清算数値は，本所の業務方法書第63条の3第2項に規定する清算数値とし，スワップポイント基準値は同条第3項に規定するスワップポイント基準値とする。

(引直差金の授受)

第36条の4 F X 非清算参加者は，有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引所 F X 取引（過誤訂正等のための取引を含む。以下同じ。）について，立会終了時における建玉のロールオーバー（取引所 F X 取引特例第2条第17号に規定するロールオーバーをいう。以下同じ。）が行われた場合であって，取引所 F X 取引における約定数値と当該取引所 F X 取引に係る取引契約締結を行った取引日の清算数値とを比較して差を生じたときは，その差に相当する金銭を，指定 F X 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 F X 非清算参加者は，当該差に相当する金銭を，当該取引日に係る決済日（本所の業務方法書第63条の4に規定する決済日をいう。以下この節において同じ。）までの指定 F X 清算参加者が指定する日時までに，当該指定 F X 清算参加者に交付しなければならない。

(更新差金の授受)

第36条の5 F X 非清算参加者は，有価証券等清算取次ぎの委託

に基づく取引所 F X 取引について，立会終了時における建玉のロールオーバーが行われた場合（前条の場合を除く。）であって，取引所 F X 取引における当該ロールオーバーが行われた取引日の清算数値とその前取引日の清算数値とを比較して差を生じたときは，その差に相当する金銭を，指定 F X 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 F X 非清算参加者は，当該差に相当する金銭を，当該取引日に係る決済日までの指定 F X 清算参加者が指定する日時までに，当該指定 F X 清算参加者に交付しなければならない。

（スワップポイントの授受）

第36条の6 F X 非清算参加者は，有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引所 F X 取引について，立会終了時における建玉のロールオーバーが行われたときに，各金融指標のスワップポイント基準値を当該ロールオーバーに係る買建玉から売建玉を差し引いた数量に乗じて得た金額に相当する金銭（以下「スワップポイント」という。）を，当該ロールオーバーが行われた取引日に係る決済日において，指定 F X 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 F X 非清算参加者は，当該金銭を，当該取引日に係る決済日までの指定 F X 清算参加者が指定する日時までに，当該指定 F X 清算参加者に交付しなければならない。

（決済差金の授受）

第36条の7 F X 非清算参加者は，有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引所 F X 取引について，転売又は買戻しを行ったと

きに、次の各号に掲げる当該転売又は買戻しに対当する建玉の区分ごとに、当該各号に定める金銭を、当該転売又は買戻しを行った取引日に係る決済日において、指定 F X 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 F X 非清算参加者は、当該金銭を、当該取引日に係る決済日までの指定 F X 清算参加者が指定する日時までに、当該指定 F X 清算参加者に交付しなければならない。

(1) 当該建玉が当該転売又は買戻しを行った取引日の約定である場合

当該建玉に係る約定数値と当該転売又は買戻しに係る約定数値の差に相当する金銭

(2) 当該建玉が当該転売又は買戻しを行った取引日の前取引日以前の約定である場合

前取引日の清算数値と当該転売又は買戻しに係る約定数値の差に相当する金銭

第 4 章 取引証拠金等

(取引証拠金等)

第37条 先物・オプション取引に係る取引証拠金等に関する事項は、先物・オプション取引に係る証拠金及び未決済約定の引継ぎ等に関する規則によるものとする。

2 取引所 F X 取引に係る取引証拠金等に関する事項は、取引所外国為替証拠金取引に係る証拠金及び未決済約定の引継ぎ等に関する規則によるものとする。

第 5 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

(清算資格取得の場合の未決済取引の取扱い)

第38条 非清算参加者（取引参加者規程第24条第4項に規定する非清算参加者をいう。以下同じ。）である取引参加者が新たに清算資格（現物清算資格，先物・オプション清算資格又はFX清算資格をいう。以下同じ。）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（当該清算資格に係るものに限る。）は，当該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等とする。

(指定清算参加者の変更の場合の未決済取引の引継ぎ)

第39条 非清算参加者が取引参加者規程第27条第3項の規定に基づき指定清算参加者（同条第1項に規定する指定清算参加者をいう。以下同じ。）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等で未決済のものは，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等とする。

第2節 有価証券の売買等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等の停止等を受けた取引参加者に対する措置)

第40条 本所は、取引参加者規程第35条第1項の規定により、有価証券の売買等(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をして、当該取引資格の喪失申請者の本所の市場における有価証券の売買等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の他の取引参加者への引継ぎその他本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等の決済)

第41条 取引資格を喪失した者の当該取引資格の種類に係る本所の市場における有価証券の売買等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、本所は、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、本所が必要と認めた場合には、当該取引資格の種類に係る本所の市場における有価証券の売買等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の他の取引参加者への引継ぎその他

本所が必要と認める整理を行わせることができる。

- 3 本所は、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等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みなす。

(支払不能による有価証券の売買等の停止等を受けた取引参加者に対する措置)

第42条 本所は、取引参加者に対して、取引参加者規程第43条第3項の規定により、本所の市場における有価証券の売買等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47条第1項の規定により、本所若しくはクリアリング機構の業務方法書に基づき清算資格の取消し若しくは債務の引受けの停止（支払不能等若しくは金融商品取引業の廃止等に係る公告を行ったこと又は改善指示（本所の業務方法書第28条第4項の規定に基づくポジション保有状況の改善指示をいう。以下同じ。）に違反したことによる債務の引受けの停止に限る。）の措置を受けたことによる有価証券の売買等の停止の措置を行った場合には、当該取引参加者をして、当該取引参加者の本所の市場における有価証券の売買等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の他の取引参加者への引継ぎその他本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43条 本所は，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48条第1項の規定により，当該非清算参加者の指定清算参加者が本所又はクリアリング機構の業務方法書に基づき清算資格の取消し又は債務の引受けの停止（支払不能等若しくは金融商品取引業の廃止等に係る公告を行ったこと又は改善指示に違反したことによる債務の引受けの停止に限る。）の措置を受けたことによる有価証券等清算取次ぎの委託の停止の措置を行った場合には，当該非清算参加者である取引参加者をして，当該非清算参加者である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及びこれに関する取引で未決済のものの他の取引参加者への引継ぎその他本所が必要と認める整理を行わせることができる。

2 第41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。

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

第44条 本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，本所の市場における有価証券の売買等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40条，第42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，本所の承認を受けて，その期間中，当該取引参加者の本所の市場における有価証券の売買等

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。

（ 売買対象有価証券の売買を行う資格等を喪失した IPO 取引参加者の未決済の有価証券の売買の決済 ）

第44条の2 取引参加者規程第52条の2の規定により売買対象有価証券の売買を行う資格等を喪失した IPO 取引参加者の本所の市場における売買対象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，本所は，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，本所が必要と認めたときには，当該 IPO 取引参加者の本所の市場における売買対象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の他の取引参加者への引継ぎその他本所が必要と認める整理を行わせることができる。

3 本所は，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売買対象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 IPO 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。

第2節の2 ポジション保有状況の改善指示があった場合にお

ける未決済約定の引継ぎ等

(先物・オプション清算参加者又は F X 清算参加者である取引参加者が改善指示を受けた場合の未決済約定の引継ぎ)

第44条の3 先物・オプション清算参加者又は F X 清算参加者である取引参加者が改善指示を受けた場合には，本所の承認及び他の取引参加者の承諾を受けて，当該他の取引参加者に，先物・オプション取引又は取引所 F X 取引の未決済約定を引き継ぐことができる。

2 前項の場合において，引継ぎを行おうとする未決済約定がその顧客の委託に基づくものであるときは，当該先物・オプション清算参加者又は F X 清算参加者である取引参加者は，当該未決済約定の引継ぎについて当該顧客の同意を得るものとする。

(改善指示を受けた指定先物・オプション清算参加者又は指定 F X 清算参加者が非清算参加者の有価証券等清算取次ぎの委託に基づく未決済約定について転売又は買戻し等を行った場合の責任の所在)

第44条の4 指定先物・オプション清算参加者又は指定 F X 清算参加者が本所の業務方法書第75条の2第2項の規定に基づき同項の転売又は買戻し等を行った結果，当該非清算参加者が損害を被った場合においても，当該非清算参加者は，本所及び当該指定先物・オプション清算参加者又は当該指定 F X 清算参加者に対してその損害の賠償を請求することができない。ただし，本所，当該指定先物・オプション清算参加者又は当該指定 F X 清算参加者に故意又は重大なる過失がある場合にあっては，当

該故意又は重大なる過失がある者に対する請求はこの限りでない。

第3節 会社分割又は事業譲渡の場合の未決済約定の引継ぎ

(会社分割又は事業譲渡の場合の未決済約定の引継ぎ)

第45条 取引参加者は、他の取引参加者に分割により事業を承継させ又は事業を譲渡する場合であって、当該事業の承継又は譲渡と同時に、取引資格を喪失しないときは、本所の承認を受けて、当該他の取引参加者に、当該事業の承継又は譲渡に係る清算対象取引（本所の業務方法書第2条に規定する清算対象取引をいう。）の未決済約定を引き継ぐことができる。

2 前項の場合において、引継ぎを行おうとする未決済約定がその顧客の委託に基づくものであるときは、当該取引参加者は、当該未決済約定の引継ぎについて当該顧客の同意を得るものとする。

第6章 雑則

(天災地変等の場合における非常措置)

第46条 本所は、有価証券等清算取次ぎの委託に基づく本所の市場における有価証券の売買等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 前項の規定により本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，本所は，取締役会の決議によらず，決済の条件を改めて定めることができる。

（発行日取引の売買契約の解消等）

第47条 本所は，有価証券等清算取次ぎの委託に基づく発行日取引につき，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，当該発行日取引に係る現物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。

第48条 削 除

（有価証券の売買等の清算及び決済に関する必要事項の決定）

第49条 本所は，この規程に定める事項のほか，本所の市場における有価証券の売買等に係る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。

（ギブアップに対する適用）

第50条 指数先物特例第33条第3項，個別証券オプション特例第39条第3項又は指数オプション特例第38条第3項の規定により新たに発生した先物・オプション取引については，清算執行取引参加者が当該先物・オプション取引を行った者とみなして，第3章（第1節を除く。）の規定を適用する。

付 則

- 1 この規程は，平成15年1月14日から施行する。
- 2 この規程の施行の日（以下「施行日」という。）にクリアリング機構の清算資格を取得する取引参加者は，当該取引参加者の本所の市場における有価証券の売買で施行日において未決済のものについて，クリアリング機構の定めるところによりその決済を行う。
- 3 この規程施行の際現に発行されている有価証券引渡票に係る貸借の決済については，なお従前の例による。

付 則

この規程は，平成15年2月1日から施行する。

付 則

この規程は，平成15年4月1日から施行する。

付 則

この規程は，平成15年4月2日から施行する。

付 則

この規程は，平成16年2月2日から施行する。

付 則

この規程は，平成16年5月6日から施行する。

付 則

この規程は，本所が定める日から施行する。

付 則

この規程は，平成17年1月4日から施行する。

付 則

この規程は，平成17年4月1日から施行する。

付 則

この規程は，平成18年1月10日から施行する。

付 則

- 1 この規程は，平成18年4月1日から施行する。
- 2 前項の規定にかかわらず，本所が指定する銘柄に関するこの規程の適用については，本所が銘柄ごとに定める日までは，なお従前の例による。

付 則

- 1 この規程は，平成18年5月1日から施行する。
- 2 会社法の施行に伴う関係法律の整備等に関する法律第98条第2項の規定によりなお従前の例によるとされた新株引受権に係る新株引受権証書については，なお従前の例による。
- 3 会社法の施行に伴う関係法律の整備等に関する法律（平成17年法律第87号）第105条の規定によりなお従前の例によるとされた合併に係る決済物件については，改正後の第10条の規定にかかわらず，なお従前の例による。

付 則

この規程は，平成18年10月1日から施行する。

付 則

この規程は，平成19年5月21日から施行する。

付 則

この規程は，平成19年9月18日から施行する。

付 則

この規程は，本所が定める日から施行する。

(注)「本所が定める日」は，平成19年9月30日

付 則

この規程は，平成19年9月30日から施行する。

付 則

- 1 この規程は，平成20年1月4日から施行する。
- 2 この改正規定施行の際，現に本所に上場されている投資信託受益証券については，平成20年1月4日を決済日とする売買から改正後の規定を適用する。

付 則

この規程は，平成20年1月4日から施行する。ただし，第2条第3項の改正規定は，同年1月15日から施行する。

付 則

この規程は，平成20年4月21日から施行する。

付 則

- 1 この規程は，平成21年1月5日から施行する。
- 2 この規程施行の際，現に本所に上場されている新株予約権証券の売買に係る清算及び決済については，なお従前の例による。

付 則

この規程は，平成21年6月12日から施行する。

付 則

この規程は，平成21年6月16日から施行する。

付 則

この規程は，平成22年4月1日から施行する。

付 則

この規程は，平成22年10月12日から施行する。

付 則

この規程は，平成24年2月27日から施行する。

付 則

この規程は，平成25年1月1日から施行する。