

# 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

## 第 1 章 総 則

### ( 目 的 )

第 1 条 この特例は、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。）における指数オプション取引（金融商品取引法（昭和23年法律第25号）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。）及び指数オプション取引（有価証券等清算取次ぎを除く。）の受託等について、業務規程及び受託契約準則の特例を規定する。

2 この特例に定めのないものについては、業務規程及び受託契約準則の定めるところによる。

3 この特例の変更は、取締役会の決議により行う。ただし、変更の内容が軽微である場合は、この限りでない。

4 前項に規定する取締役会の決議において、第4条から第6条までの規定については、自主規制委員会の同意を得るものとする。

### ( 指数オプション取引に関する定義 )

第 2 条 この特例において指数オプション取引とは、指数オプションを相手方が当事者の一方に付与し、当事者の一方がこれに対して対価を支払うことを約する取引をいう。

2 この特例において指数オプションとは、権利取得者（当該オプションを付与された者をいう。以下同じ。）の意思表示により当事者間において、当該意思表示を行う場合の指数としてあらかじめ設定した数値（以下「権利行使価格」という。）と現に当該意思表示を行った時期における現実の当該指数の数値（以下「現実数値」という。）との差に基

づいて算出される金銭を授受することとなる取引を成立させることができる権利をいう。

3 この特例において権利行使とは、指数オプションの行使をいう。

(用語の意義)

第3条 この特例において使用する用語の意義については、有価証券の売買契約締結の方法に係る用語の意義に従うものとし、次の各号に定めるところによるほか、各条項中に定めるところによるものとする。

(1) 売付けとは、指数オプションを付与する立場の当事者となる取引をいい、買付けとは、指数オプションを取得する立場の当事者となる取引をいう。

(2) 値段とは、指数オプションの売付け又は買付けにおける対価となる額をいう。

(3) 値幅とは、値段の幅をいう。

(4) 呼値とは、指数オプション取引の当事者となるために指数オプション取引においてなす値段の限度の意思表示をいう。

(5) 売呼値とは、売付けに係る呼値をいい、買呼値とは、買付けに係る呼値をいう。

(6) 取引日とは、一の日（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。）を除く。）の第7条において夜間立会開始時として定める時から、その翌日（休業日に当たるときは、順次繰り下げる。第7条第1項第2号及び第14条第5項第2号を除き、以下同じ。）の本所が定める時間までをいう。

## 第2章 業務規程の特例

### 第1節 取引の対象及び限月取引等

(取引の対象)

第4条 指数オプション取引の対象は、次項に規定する取引対象指数に係る次の各号に掲げる指数オプションとする。

(1) 現実指数が権利行使価格を下回った場合にその差に当該取引対象指数に係る取引換算額(第3項に規定する取引換算額をいう。次号において同じ。)を乗じて得た額の金銭を権利取得者が相手方から受領することとなる取引を成立させることができる指数オプション(以下「指数プットオプション」という。)

(2) 現実指数が権利行使価格を上回った場合にその差に当該取引対象指数に係る取引換算額を乗じて得た額の金銭を権利取得者が相手方から受領することとなる取引を成立させることができる指数オプション(以下「指数コールオプション」という。)

2 指数オプション取引における取引対象指数は、次の各号に掲げる指数とする。

(1) 日経株価指数300(株式会社東京証券取引所(以下「東京証券取引所」という。))における市場第一部銘柄のうち300銘柄を対象とする時価総額方式の株価指数であって、株式会社日本経済新聞社(以下「日本経済新聞社」という。)が算出するもの(以下「日経300」という。)をいう。以下同じ。)

(2) 日経平均株価(東京証券取引所における市場第一部銘柄のうち225銘柄を対象とする修正株価平均方式の株価指数であって、日本経済新聞社が算出するもの(以下「日経平均」という。)をいう。以下同じ。)

(3) ハイテク指数(東京証券取引所における市場第一部銘柄のうち証券コード協議会により電気機器及び精密機器に分類されたものの中から本所が選定する銘柄を対象とする時価総額方式の株価指数であって、本所が算出するものをいう。以下同じ。)

(4) フィナンシャル指数(東京証券取引所における市場第一部銘柄の

うち証券コード協議会により銀行業に分類されたものの中から本所  
が選定する銘柄を対象とする時価総額方式の株価指数であって、本  
所が算出するものをいう。以下同じ。)

(5) コンシューマー指数(東京証券取引所における市場第一部銘柄の  
うち証券コード協議会により小売業及びサービス業に分類されたも  
のの中から本所が選定する銘柄を対象とする時価総額方式の株価指  
数であって、本所が算出するものをいう。以下同じ。)

3 取引換算額は、日経300オプション(日経300に係る指数オプション  
をいう。以下同じ。)に係るものにあっては1万円、日経平均オプション  
(日経平均に係る指数オプションをいう。以下同じ。)及び業種別指  
数オプション(ハイテク指数に係る指数オプション、フィナンシャル  
指数に係る指数オプション及びコンシューマー指数に係る指数オプシ  
ョンをいう。以下同じ。)に係るものにあっては1,000円とする。

4 指数オプション取引において、銘柄(第2項及び第37条第2項ただ  
し書において使用する場合を除く。)とは、取引対象指数、権利行使を  
行うことができる日(以下「権利行使日」という。)及び権利行使価格  
を同一とする指数プットオプション及び指数コールオプションをいう  
ものとする。

(限月取引及びその数)

第5条 指数オプション取引は、取引対象オプション(指数オプション  
取引の対象の指数オプションをいう。以下同じ。)ごとに、毎月の第二  
金曜日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。次条において同じ。)  
の前日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。以下同じ。)に終了  
する取引日を取引最終日とする取引(以下「限月取引」という。)に区  
分する。

2 前項に規定する限月取引の数及びその期間は、次の各号に掲げる取  
引対象オプションの区分に従い、当該各号に定めるところによる。

(1) 日経300オプション

3月、6月、9月及び12月の限月取引（以下「特定限月取引」という。）の6限月取引と特定限月取引以外の2限月取引の8限月取引制とし、各限月取引の期間は、特定限月取引のうち6月及び12月の限月取引を2年、3月及び9月の限月取引を1年、特定限月取引以外の各限月取引を3か月とする。

(2) 日経平均オプション

特定限月取引の12限月取引及び当該特定限月取引以外の直近の3限月取引の15限月取引制とし、各限月取引の期間は、各特定限月取引のうち、6月及び12月の限月取引を5年、3月及び9月の限月取引を1年とし、特定限月取引以外の各限月取引を4か月又は5か月とする。

(3) 業種別指数オプション

直近の2限月取引と当該月以外の特定限月取引のうち直近2限月取引の4限月取引制とし、各限月取引の期間は、各特定限月取引を8か月、特定限月取引以外の各限月取引を2か月とする。

3 新たな限月取引の取引開始日は、前項各号に規定する各限月取引のうち、最初取引最終日が到来する限月取引の取引最終日の終了する日の翌日とし、その日の本所が定める時間から新たな限月取引を開始する。

4 前3項の規定にかかわらず、本所は、取引対象オプションを上場する場合その他本所が必要と認める場合には、限月取引の数及びその期間並びに取引最終日及び取引開始日を変更することができる。

（権利行使価格及びその数）

第6条 指数オプション取引は、取引対象オプションごとに、各限月取引に設定する権利行使価格に区分して行うものとする。

2 前項に規定する権利行使価格は、次の各号に掲げる取引対象オプション

ョンの区分に従い，当該限月取引の取引開始日の本所が定める時間に当該各号に定めるところにより設定する。ただし，本所が必要と認める場合には，設定する権利行使価格及びその数を変更することができる。

(1) 日経300オプション

指数オプション取引における日経300の数値につき，特定限月取引にあっては25ポイント刻みで設定する25ポイントの整数倍の数値，特定限月取引以外の限月取引にあっては5ポイント刻みで設定する5ポイントの整数倍の数値とし，本所が定めるところにより7種類設定する。

(2) 日経平均オプション

指数オプション取引における日経平均の数値につき，500円刻みで設定する500円の整数倍の数値とし，本所が定めるところにより17種類設定する。

(3) 業種別指数オプション

指数オプション取引における各業種別指数の数値につき，特定限月取引にあっては1,000円刻みで設定する1,000円の整数倍の数値，特定限月取引以外の限月取引にあっては500円刻みで設定する500円の整数倍の数値とし，本所が定めるところにより5種類設定する。

3 前項のほか，次の各号に掲げる取引対象オプションの区分に従い，全部又は一部の限月取引について，当該各号に定める数値の新たな権利行使価格を本所が定めるところにより設定することができる。

(1) 日経300オプション

a 特定限月取引

(a) 当該限月取引の残存期間が4か月となる月の第二金曜日が到来していない特定限月取引

25ポイント刻みで設定する25ポイントの整数倍の数値

(b) 前(a)に掲げる特定限月取引以外の特定限月取引

5 ポイント刻みで設定する 5 ポイントの整数倍の数値

b 特定限月取引以外の限月取引

5 ポイント刻みで設定する 5 ポイントの整数倍の数値

(2) 日経平均オプション

a 当該限月取引の残存期間が 3 か月となる月の第二金曜日が到来していない限月取引

500円刻みで設定する 500円の整数倍の数値

b 前 a に掲げる限月取引以外の限月取引

250円刻みで設定する 250円の整数倍の数値

(3) 業種別指数オプション

a 特定限月取引

(a) 当該限月取引の残存期間が 3 か月となる月の第二金曜日が到来していない特定限月取引

1,000円刻みで設定する 1,000円の整数倍の数値

(b) 前(a)に掲げる特定限月取引以外の特定限月取引

500円刻みで設定する 500円の整数倍の数値

b 特定限月取引以外の限月取引

500円刻みで設定する 500円の整数倍の数値

( ストラテジー取引 )

第 6 条の 2 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参加者をいう。以下同じ。）は，立会（クロージング・オークションを除く。）において，複数の指数オプション取引の売付け又は買付け（同一の顧客又は自己の計算による売付け又は買付けに限る。）を同時に成立させる取引（以下「ストラテジー取引」という。）を行うことができる。

2 ストラテジー売取引及びストラテジー買取引により成立する指数オプション取引の売付け又は買付けの組合せは，本所が定めるストラテ

ジー取引の種類ごとに本所が定める。

- 3 取引参加者は、ストラテジー取引を行おうとするときは、本所が定めるストラテジー取引の値段の算出方法により得た数値（以下「ストラテジー値段」という。）を用いて呼値を行うものとする。
- 4 ストラテジー取引において、ストラテジー売呼値とは、ストラテジー売取引に係る呼値をいい、ストラテジー買呼値とは、ストラテジー買取引に係る呼値をいう。

## 第2節 競争売買市場における指数オプション取引の方法等

（立会の区分及び取引時間等）

第7条 競争売買市場（本所の市場（ＪＡＳＤＡＱにおける有価証券上場規程第2条に規定するＪＡＳＤＡＱを除く。）のうち売買立会による有価証券の売買又は立会による市場デリバティブ取引を行う市場をいう。）における指数オプション取引（以下この節及び第56条の3において単に「指数オプション取引」という。）の立会は、日中立会及び夜間立会に分ち、各立会の取引時間は、次の各号に掲げる立会の区分に従い、当該各号に定めるところによる。

### （1）日中立会

#### a オープニング・オークション

午前9時とする。

#### b レギュラー・セッション

午前9時から午後3時10分までとする。

#### c クロージング・オークション

午後3時15分とする。

### （2）夜間立会

#### a オープニング・オークション

午後4時30分とする。

#### b レギュラー・セッション



午後 4 時30分から翌日の午前 2 時55分までとする。

c クロージング・オークション

翌日の午前 3 時とする。

- 2 本所は，必要があると認めるときは，前項の取引時間を臨時に変更することができる。この場合においては，あらかじめその旨を取引参加者に通知する。
- 3 休業日においては，指数オプション取引の立会（Ｊ－ＮＥＴデリバティブ取引（Ｊ－ＮＥＴ市場に関する有価証券上場規程，業務規程，信用取引・貸借取引規程及び受託契約準則等の特例（以下「Ｊ－ＮＥＴ市場特例」という。）第 2 条第 6 号に規定するＪ－ＮＥＴデリバティブ取引をいう。）を含む。）を行わない。ただし，一の取引日の立会終了時が休業日に属する場合の第 1 項第 2 号に定める取引時間（Ｊ－ＮＥＴ市場特例第32条第 1 項第 1 号に規定するＪ－ＮＥＴデリバティブ取引の取引時間を含む。）については，この限りでない。

（指数オプション取引の臨時停止，臨時挙行）

第 8 条 本所は，必要があると認めるときは，指数オプション取引の立会の全部若しくは一部を臨時に停止し又は臨時に挙行することができる。

（臨時停止，臨時挙行の通知）

第 9 条 本所は，指数オプション取引の臨時停止又は臨時挙行を定めたときは，あらかじめその旨を取引参加者に通知する。

（売買システムによる取引）

第10条 指数オプション取引は，売買システムにより取引を行う。

（値段の表示）

第11条 指数オプション取引における値段の表示は、次の各号に掲げる取引対象オプションの区分に従い、当該各号に定めるところによる。

(1) 日経300オプション

1万円を1ポイントとして行う。

(2) 日経平均オプション及び業種別指数オプション

1,000円を1円として行う。

(競争取引における呼値の順位)

第12条 指数オプション取引は、競争取引によるものとする。

2 指数オプション取引の競争取引における呼値の順位は、次の各号に定めるところによる。

(1) 低い値段の売呼値は、高い値段の売呼値に優先し、高い値段の買呼値は、低い値段の買呼値に優先する。

(2) 同一値段の呼値については、呼値が行われた時間の先後により、先に行われた呼値は、後に行われた呼値に優先する。

(3) 成行呼値は、それ以外の呼値に値段的に優先する。

3 ストラテジー取引に係る前項の規定の適用については、前項中「値段」とあるのは「ストラテジー値段」と、「売呼値」とあるのは「ストラテジー売呼値」と、「買呼値」とあるのは「ストラテジー買呼値」とする。

(個別競争取引)

第13条 前条第1項の競争取引は、個別競争取引とする。

2 レギュラー・セッションにおける指数オプション取引の個別競争取引においては、第4項に規定する場合を除き、売呼値の競合、買呼値の競合及び売呼値と買呼値との争合により、最も低い値段の売呼値と最も高い値段の買呼値とが合致するとき、その値段を約定値段とし、前条第2項に定める呼値の順位に従って、対当する呼値の間に取引を

成立させることにより行う。

3 オープニング・オークション及びクロージング・オークションにおける指数オプション取引の個別競争取引は，売呼値の競合，買呼値の競合及び売呼値と買呼値との争合により，次の各号に掲げる値段を約定値段とし，前条第2項に定める呼値の順位に従って，対当する呼値の間に取引を成立させることにより行う。

(1) 売呼値又は買呼値のいずれか一方に呼値がある値段のうち，売呼値と買呼値が対当する値段

(2) 前号の値段が複数ある場合には，取引が成立したときに約定数量が最大となる値段

(3) 前号の値段が複数ある場合には，当該値段以下の値段による売呼値の全部の数量及び当該値段以上の値段による買呼値の全部の数量の差（以下「不均衡数量」という。）が最小となる値段

(4) 前号の値段が複数あるとき。

a すべての値段で不均衡数量が売超となるときは，最も低い値段

b すべての値段で不均衡数量が買超となるときは，最も高い値段

c 前 a 及び b のいずれにも該当しないとき。

(a) 当該値段（不均衡数量が最小となる値段に買超となる値段及び売超となる値段がある場合は，不均衡数量が売超となる値段のうち最も低い値段と不均衡数量が買超となる値段のうち最も高い値段に限る。以下この c において同じ。）のうち最も高い値段が直前の約定値段（当該取引日に約定値段がない場合は，呼値の制限値幅の基準値段。以下この c において同じ。）以下の場合は，当該最も高い値段

(b) 当該値段のうち最も低い値段と最も高い値段の間に直前の約定値段がある場合は，当該直前の約定値段

(c) 当該値段のうち最も低い値段が直前の約定値段以上の場合は，当該最も低い値段

- 4 本所が定めるところにより取引が中断された場合の中断後再開時の約定値段を定める場合及び本所が呼値の状況から必要があると認める場合は、前項の規定による指数オプション取引の個別競争取引を行うものとする。
- 5 第3項の規定にかかわらず、クロージング・オークションにおける約定値段を定める取引の値段が、立会における直前の約定値段（ストラテジー取引による約定値段を除く。）を基準として、本所が定める値幅を超えるときは、取引を不成立とする。
- 6 ストラテジー取引に係る第2項から第4項までの規定の適用については、「約定値段」とあるのは「約定ストラテジー値段」と、「値段」とあるのは「ストラテジー値段」と、「売呼値」とあるのは「ストラテジー売呼値」と、「買呼値」とあるのは「ストラテジー買呼値」と、「呼値の制限値幅の基準値段」とあるのは「本所がその都度定める値段」とする。
- 7 ストラテジー取引が成立したときは、その組合せに従い成立する指数オプション取引の売付け又は買付けに係る約定値段は、ストラテジー取引の約定値段に基づき本所が定める。

#### （取引の取消し）

- 第13条の2 本所は、過誤のある注文により取引が成立した場合において、その決済が極めて困難であり、本所の市場が混乱するおそれがあると認めるときは、本所が定める取引を取り消すことができる。
- 2 本所は、天災地変その他のやむを得ない理由により本所のシステム上の取引記録が消失した場合において、消失したすべての取引記録を復元することが困難であると認めるときは、本所がその都度定める取引を取り消すことができる。
  - 3 前2項の規定により本所が取引を取り消した場合には、当該取引は初めから成立しなかったものとみなす。

- 4 取引参加者は、第1項の規定により本所が取引を取り消したことに  
より損害を受けることがあっても、過誤のある注文を発注した取引参  
加者に対して、その損害の賠償を請求できないものとする。ただし、  
過誤のある注文の発注に際して、取引参加者に故意又は重過失が認め  
られる場合は、この限りでない。
- 5 取引参加者は、第1項又は第2項の規定により本所が取引を取り消  
したことににより損害を受けることがあっても、本所に対して、その損  
害の賠償を請求できないものとする。ただし、本所に故意又は重過失  
が認められる場合は、この限りでない。

(呼 値)

第14条 取引参加者は、指数オプション取引を行おうとするときは、呼  
値を行わなければならない。この場合において、取引参加者は、当該  
呼値が顧客の委託に基づくものか自己の計算によるものかの別を、本  
所に対し明らかにしなければならない。

2 指数オプション取引の呼値は、取引参加者の取引参加者端末装置か  
ら入力する方法による呼値によるものとする。

3 指数オプション取引の呼値の単位は、次の各号に掲げる取引対象オ  
プションの区分に従い、当該各号に定めるところによる。

(1) 日経300オプション

0.1ポイントとする。

(2) 日経平均オプション

呼値が50円以下の場合は1円、50円を超え1,000円以下の場合は5  
円、1,000円を超える場合は10円とする。ただし、ストラテジー取引  
については1円とする。

(3) 業種別指数オプション

5円とする。

4 指数オプション取引の呼値は、本所が定める値幅の限度を超える値

段により行うことができない。ただし，ストラテジー取引の呼値を行う場合の値幅の限度は定めない。

- 5 取引参加者は，次の各号に掲げる立会の区分に従い，当該各号に定める間，呼値を行うことができる。ただし，ストラテジー取引の呼値は，オープニング・オークション及びレギュラー・セッションにおいてのみ行うことができる。

(1) 日中立会

- a オープニング・オークション  
午前 8 時から 9 時までの間
- b レギュラー・セッション  
午前 9 時から午後 3 時10分までの間
- c クロージング・オークション  
午後 3 時10分から 3 時15分までの間

(2) 夜間立会

- a オープニング・オークション  
午後 4 時15分から 4 時30分までの間
- b レギュラー・セッション  
午後 4 時30分から翌日の午前 2 時55分までの間
- c クロージング・オークション  
翌日の午前 2 時55分から 3 時までの間

- 6 前項の規定にかかわらず，第 7 条第 2 項の規定により取引時間が変更された場合及び本所が定めるところにより取引が中断された場合における呼値を行うことができる時間は，本所がその都度定める。

- 7 本所は，第 5 項の呼値が行われたときは，その順序に従って，直ちにその内容を売買システムに記録するものとする。

- 8 指数オプション取引の呼値は，本所が定める有効期間条件又は執行数量条件を付して行わなければならない。

- 9 取引参加者は，本所が定めるところにより本所が定める条件を呼値

に付することができる。ただし、売買システムの稼働に支障が生じた場合その他本所が必要と認めた場合は、この限りでない。

10 本所は、指数オプション取引における呼値について取引が成立したときは、直ちにその内容を売買システムにより、売付けを行った取引参加者及び買付けを行った取引参加者に通知するものとする。

11 この特例に定めるもののほか、指数オプション取引の呼値に関し必要な事項については、本所が定める。

#### ( リクエスト・フォー・クォート )

第14条の2 取引参加者は、取引を成立させようとするときは、取引参加者端末装置を用いて、呼値の提示を求めること(以下「リクエスト・フォー・クォート」という。)ができる。

2 本所は、リクエスト・フォー・クォートの状況に異常があると認める場合又はそのおそれがあると認める場合、その他取引管理上リクエスト・フォー・クォートを継続して行わせることが困難であると認める場合は、リクエスト・フォー・クォートの提示を停止することができる。

3 前2項に定めるもののほか、リクエスト・フォー・クォートに関し必要な事項については、本所が別に定めるところによるものとする。

#### ( インプライド機能 )

第14条の3 本所は、本所が定める種類のストラテジー取引について、ストラテジー取引及びその対象となる指数オプション取引の呼値の状況に応じ、当該ストラテジー取引の呼値を当該ストラテジー取引の対象となる指数オプション取引における呼値として取り扱うことができる。ただし、売買システムの稼働に支障が生じた場合その他本所が必要と認めた場合は、この限りでない。

#### ( 取引単位 )

第15条 指数オプション取引は、取引対象オプションごとに、1単位を最小単位として行う。

(約定値段の公表)

第16条 本所は、指数オプション取引が成立したときは、その約定値段を公表する。

(取引の確認)

第17条 取引参加者は、指数オプション取引について、取引参加者端末装置により取引の内容の通知を受けたときは、直ちにその内容を確認するものとする。

(取引の一時中断)

第17条の2 本所は、指数先物取引について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。)第14条の2第1項の規定により取引を一時中断した場合には、当該指数先物取引について取引を中断している間、当該指数先物取引の対象の指数と取引対象指数が同一の指数オプション取引について、取引を一時中断する。

2 本所は、前項に該当したことより取引を一時中断する場合には、取引対象指数を同一とする指数オプション取引について、本所が定めるところにより呼値の制限値幅を拡大する。

3 本所は、指数オプション取引の各銘柄について、立会における直前の約定値段(ストラテジー取引による約定値段を除く。)から本所が定める値幅を超えて取引が成立することとなる呼値を受け付けた場合には、当該値幅内における取引をすべて成立させた時から本所が適当と認める時間を経過するまでの間、当該銘柄の取引を一時中断する。

4 本所は、第1項又は前項の規定により取引を一時中断した場合には、



当該指数オプション取引について取引を一時中断している間，当該指数オプション取引における売付け又は買付けが成立することとなるストラテジー取引について取引を一時中断する。

#### （取引の停止）

第18条 本所は，次の各号に掲げる場合には，本所が定めるところにより，全部又は一部の指数オプション取引を停止することができる。

(1) 指数オプション取引の状況に異常があると認める場合又はそのおそれがあると認める場合その他取引管理上取引を継続して行わせることが適当でないと認める場合

(2) 売買システムの稼働に支障が生じた場合等において売買システムによる取引を継続して行わせることが困難であると認める場合

第19条から第29条まで 削 除

### 第3節 過誤訂正等のための取引

#### （過誤訂正等のための取引）

第30条 取引参加者は，指数オプション取引について，顧客の注文を真にやむを得ない事由による過誤等により，委託の本旨に従って本所の市場において執行することができなかつたときは，本所が定めるところにより，あらかじめ本所の承認を受け，当該承認に係る売付け又は買付けを，本所が適正と認める値段により，自己がその相手方となつて立会によらずに執行することができる。

2 前項の売付け又は買付けに係る決済は，当該顧客の売付け又は買付けを，委託の本旨に従って執行することができた場合における決済日に行うものとする。

3 ストラテジー取引に係る前2項の規定の適用については，前2項中「売付け」とあるのは「ストラテジー売取引」と，「買付け」とあるの

は「ストラテジー買取引」と、第1項中「値段」とあるのは「ストラテジー値段」とする。

## 第31条及び第32条 削 除

### 第4節 権利行使等

（権利行使日）

第33条 指数オプション取引における権利行使日は、各銘柄の取引最終日の終了する日の翌日とする。

2 前項の規定にかかわらず、本所が必要と認める場合には、全部又は一部の銘柄について権利行使日を変更することができる。

3 指数オプション取引における権利行使が行われたときは、権利行使日の翌日に権利行使日におけるオプション清算数値（第37条に規定するオプション清算数値をいう。）による決済を行うものとする。

（権利行使の停止）

第34条 本所は、指数オプション取引が停止された場合又は本所が取引の管理上権利行使を行わせることが適当でないと認める場合には、全部又は一部の銘柄について権利行使を停止することができる。

## 第35条 削 除

（指数オプションの消滅）

第36条 権利行使日において、権利行使の申告が行われなかった取引対象オプションは、本所が定める時限に消滅するものとする。

（オプション清算数値）

第37条 本所は、取引対象オプションごとに、各取引日の日中立会の終

了後に，その取引日のオプション清算数値を定める。

- 2 前項のオプション清算数値は，取引対象オプションごとに，その日の最終の取引対象指数とする。ただし，取引対象オプションの各限月取引の権利行使日における当該限月取引に係るオプション清算数値は，取引最終日の終了する日の翌日における取引対象指数各構成銘柄の東京証券取引所における売買立会の始めの約定値段（取引最終日の終了する日の翌日に約定値段がない銘柄については，本所が定める値段）に基づき算出した特別な指数（以下「特別清算数値」という。）とする。
- 3 前項の規定にかかわらず，東京証券取引所における株券の売買立会が停止された場合（東京証券取引所の定める業務規程第29条第3号又は第4号の規定により株券の売買が停止された場合を含む。）で本所が必要と認めるときにおけるオプション清算数値は，本所がその都度定める日まで，本所がその都度定める。
- 4 本所は，前2項の規定にかかわらず，権利行使に係る決済の日の前日までに特別清算数値に誤りがあると認められた場合には，再算出された特別清算数値をオプション清算数値とすることができる。
- 5 取引参加者は，指数の算出若しくは配信の不能，遅延若しくは誤り又は前項の規定によるオプション清算数値の変更により損害を被った場合においても，本所及び指数の算出者（当該算出者から指数の算出に関して業務の委託を受けたものを含む。）に対してその損害の賠償の請求をすることができない。

## 第5節 ギブアップ

（ギブアップ）

第38条 取引参加者は，指数オプション取引（第30条に規定する過誤訂正等のための取引を含む。以下この節において同じ。）について，本節に定めるところにより，ギブアップ（次項の規定により成立したときに，第3項に規定する効力が発生する行為をいう。以下同じ。）を行う

ことができる。

- 2 ギブアップは、注文執行取引参加者（次条に規定するギブアップ申告を行う取引参加者をいう。以下同じ。）がギブアップ申告を行った場合において、本所が清算執行取引参加者（第40条第1項第1号に規定するテイクアップ申告を行う取引参加者をいう。以下同じ。）からテイクアップ申告を受けたときに成立する。
- 3 ギブアップが成立した場合には、当該ギブアップ申告に係る指数オプション取引の売付け又は買付けが将来に向かって消滅し、同時に、当該消滅した指数オプション取引の売付け又は買付けと同一内容の指数オプション取引の売付け又は買付けが、当該清算執行取引参加者の名において、本所と当該清算執行取引参加者との間に新たに発生するものとする。ただし、当該清算執行取引参加者が非清算参加者（業務方法書第9条に規定する非清算参加者のうち同第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有していない者をいう。以下同じ。）である場合には、その指定清算参加者（当該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（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。）をいう。以下同じ。）の名において当該清算執行取引参加者の計算により、当該消滅した指数オプション取引の売付け又は買付けと同一内容の指数オプション取引の売付け又は買付けが、本所と当該指定清算参加者との間に新たに発生するものとする。

#### （ギブアップ申告）

第39条 取引参加者は、指数オプション取引についてギブアップを行おうとするときは、本所が定める時限までに、清算執行取引参加者を指定して、対象となる指数オプション取引の内容及び指定清算執行取引参加者（この項の規定により注文執行取引参加者が指定した清算執行取引参加者をいう。以下同じ。）において当該ギブアップに係る指数オ

プシヨン取引がいずれの顧客によるものか確認するために必要な事項を、本所が指定するシステムにより、本所に申告するものとする。ただし、取引参加者は、ギブアップにより発生した指数オプション取引については、当該申告を行うことができないものとする。

- 2 本所は、前項の申告（以下「ギブアップ申告」という。）を受けた場合には、直ちにその内容を、本所が指定するシステムにより、指定清算執行取引参加者に通知する。

（テイクアップ申告等）

第40条 前条第2項の規定により通知を受けた指定清算執行取引参加者は、本所が定める時限までに、次の各号に掲げるいずれかの申告を、本所が指定するシステムにより、本所に対して行うものとする。

(1) 通知に係る指数オプション取引について、その決済を引き受ける場合にはその旨の申告（以下「テイクアップ申告」という。）

(2) 通知に係る指数オプション取引について、その決済を引き受けない場合にはその旨の申告

- 2 前項に規定する時限までに同項各号の申告が行われない場合には、本所は、当該清算執行取引参加者により同項第2号の申告を受けたものとみなす。

- 3 本所は、第1項の規定に基づく申告を受けた場合（前項の規定により第1項第2号の申告を受けたものとみなされる場合を含む。）には、直ちにその内容を本所が指定するシステムにより、当該ギブアップ申告を行った注文執行取引参加者に通知する。

（資料の保存）

第41条 注文執行取引参加者及び清算執行取引参加者は、成立したギブアップの内容を記載した資料（電磁的記録を含む。）を本所が指定するシステムから取得し、取得後10年間保存するものとする。

(ギブアップに係るシステムの稼働に支障が生じた場合等における非常措置)

第42条 本所は、ギブアップを行うためのシステムの稼働に支障が生じた場合等において本所が必要であると認めるときは、ギブアップ申告又はテイクアップ申告を第39条又は第40条に規定する方法以外の方法により行うことができる。

2 前項に規定する第39条又は第40条に規定する方法以外の方法は、本所がその都度定める。

第43条及び第44条 削除

## 第6節 雑 則

(取引に関する通知書の送付)

第45条 取引参加者は、指数オプション取引(第30条に規定する過誤訂正等のための取引を含む。)に係る未決済勘定がある顧客に対して、次の各号に掲げる事項を記載した通知書を毎月送付するものとする。

- (1) 取引対象指数及び指数プットオプション又は指数コールオプションの別
- (2) 限月取引
- (3) 権利行使価格
- (4) 売付け又は買付けの別
- (5) 取引契約数量
- (6) 約定値段
- (7) 取引成立日
- (8) 当該限月取引の取引最終日の終了する日
- (9) 当該限月取引の権利行使日

2 前項に規定する通知書の送付について、顧客が日本証券業協会に所

属する金融商品取引業者である場合は、これを要しない。

- 3 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（平成19年内閣府令第52号）第56条（第1項第1号二、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。以下この項及び次項において同じ。）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、当該取引参加者は当該通知書を送付したものとみなす。
- 4 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、この限りでない。
- 5 第1項第7号に掲げる取引成立日は、取引が成立した取引日の終了する日とすることができる。この場合において、取引参加者は、その旨を顧客に説明しなければならない。

（権利行使の割当て及び顧客への割当通知）

第46条 取引参加者は、清算・決済規程第35条第1項若しくは第2項又は業務方法書第61条第2項若しくは第4項の規定に基づき顧客の委託に基づく建玉（各銘柄の権利行使に係る決済が未了である約定（以下「未決済約定」という。）に係る数量をいう。以下同じ。）についての権利行使の割当ての通知を受けた場合には、あらかじめ定めた方法により、顧客に対して直ちに権利行使の割当てを行うものとする。

- 2 前項の場合において，取引参加者は，当該顧客に当該割当てに係る銘柄及び数量を速やかに通知するものとする。

#### 第47条から第49条まで 削除

（本所の市場における指数オプション取引の方法等）

第50条 取引参加者は，本所の市場における指数オプション取引を，本所が適当と認める取引参加者端末装置等により行わなければならない。

- 2 指数先物特例第40条第2項及び第3項に規定する先物取引等責任者は，併せて，本所の市場における指数オプション取引の業務の統轄及びこれに関連する事項の処理に当たるものとする。ただし，本所が先物取引等責任者の行うべき事務のうち一部のものについて別に責任者を設けるべき事務として定める場合には，取引参加者は，先物取引等責任者に代わって当該事務に当たる責任者を選任し，あらかじめ本所に届け出るものとする。

#### 第51条 削除

（売買システムの稼働に支障が生じた場合等における非常措置）

第51条の2 売買システムの稼働に支障が生じた場合において，本所が必要であると認めるときは，指数オプション取引について，臨時に売買システムによる取引以外の取引を行うことができる。

- 2 売買システムの稼働に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により呼値を行うことが困難である取引参加者（以下「障害取引参加者」という。）は，あらかじめ他の取引参加者の承諾及び本所の承認を受けて，当該他の取引参加者（以下「代行取引参加者」という。）を通じて呼値等を行うことができる。この場合において，当該呼値等により指数オプション取引が成立したときは，当該障害取引参加者及び当該代



行取引参加者は、本所が定めるところにより、その内容を本所に申告しなければならない。

- 3 前2項の規定による指数オプション取引に関し必要な事項は、本所がその都度定める。

## 第52条及び第53条 削 除

### 第3章 受託契約準則の特例

#### 第1節 指数オプション取引の受託

(先物・オプション取引口座の設定等)

第54条 顧客が指数オプション取引の委託をしようとするときは、取引参加者に先物・オプション取引口座を設定しなければならない。

- 2 先物・オプション取引口座の設定については、顧客がその旨を取引参加者に申し込み、その承諾を受けるものとする。

- 3 顧客は、前項の申込みにつき、取引参加者の承諾を受けた場合には、本所が定める様式による先物・オプション取引口座設定約諾書に所定の事項を記載し、これに署名又は記名押印して、取引参加者に差し入れるものとする。

- 4 顧客が委託しようとする指数オプション取引がギブアップに係るものであるときに係る前3項の規定の適用については、「取引参加者」とあるのは「注文執行取引参加者及び清算執行取引参加者」とする。ただし、顧客が次条第3項の規定に基づきギブアップに係る指数オプション取引の委託をしようとするときは、注文執行取引参加者の顧客は当該注文執行取引参加者に、清算執行取引参加者の顧客は当該清算執行取引参加者にそれぞれ先物・オプション取引口座を設定するものとする。

- 5 顧客は、第3項の規定(前項において「取引参加者」とあるのを「注

文執行取引参加者及び清算執行取引参加者」とする場合を含む。)による約諾書の差入れに代えて、取引参加者から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57条の3に定める方法と同様の方法をいう。以下この項及び次項において同じ。)の種類及び内容を提示され、取引参加者に書面又は電磁的方法による承諾をした場合には、電磁的方法により、当該約諾書の内容を承諾した旨を取引参加者に通知することができる。この場合において、当該顧客は、当該約諾書を取引参加者に差し入れたものとみなす。

- 6 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通知を行わない旨の申出があったときは、電磁的方法によって当該顧客から前項の規定による通知を受け入れてはならない。ただし、当該顧客が再び当該承諾をした場合は、この限りでない。

#### (ギブアップに係る契約の締結)

第54条の2 顧客がギブアップに係る指数オプション取引の委託をしようとするときは、当該顧客は、注文執行取引参加者及び清算執行取引参加者との三者間で、ギブアップに係る指数オプション取引の受託に関する契約を締結するものとする。

- 2 前項の契約には、次の各号に掲げる事項を定めなければならない。
- (1) 委託手数料の額並びにその徴収者及び徴収方法
  - (2) 第40条第1項第2号の申告を受けた場合(同条第2項の規定により同条第1項第2号の申告を受けたものとみなされる場合を含む。)における取扱い
- 3 第1項の規定にかかわらず、注文執行取引参加者の顧客又は清算執行取引参加者の顧客が取引取次者(注文執行取引参加者に指数オプション取引を委託した顧客が、金融商品取引業者又は外国証券業者であ

る場合であって、当該委託が注文執行取引参加者に対する指数オプション取引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。以下この項において同じ。)又は決済取次者(清算執行取引参加者に指数オプション取引の決済を委託した顧客が金融商品取引業者又は外国証券業者である場合であって、当該委託が清算執行取引参加者に対する指数オプション取引の決済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。以下この項において同じ。)であって、当該顧客の注文執行取引参加者又は清算執行取引参加者に対するギブアップに係る指数オプション取引の委託が他の者からの委託の取次ぎによるものである場合において、当該顧客が次の各号に定める者との間で前各項に規定する契約に準じた契約を締結しているときは、注文執行取引参加者及び清算執行取引参加者は、ギブアップに係る指数オプション取引の委託を受けることができる。

- (1) 注文執行取引参加者の顧客が取引取次者である場合は、当該他の者及び清算執行取引参加者(清算執行取引参加者の顧客が決済取次者である場合には、当該顧客)
- (2) 清算執行取引参加者の顧客が決済取次者である場合は、当該他の者及び注文執行取引参加者(注文執行取引参加者の顧客が取引取次者である場合には、当該顧客)

(米国に居住する顧客の取引の受託)

第54条の3 取引参加者は、アメリカ合衆国に居住する顧客から次の各号に掲げる指数オプションを対象とする指数オプション取引の受託をしようとするときは、あらかじめ、当該顧客に対し、当該指数オプション取引の特徴とリスクに関する事項を記載した本所所定の書面を交付しなければならない。

- (1) 日経300オプション
- (2) 日経平均オプション

- 2 前項の場合において，取引参加者は，当該顧客から，あらかじめ，本所が必要と認める事項を記載した本所所定の確認書の提出を受けなければならない。

（顧客の通告事項）

第55条 顧客が指数オプション取引を委託する場合には，あらかじめ次の各号に掲げる事項を取引参加者に通告するものとする。

- (1) 氏名又は名称
- (2) 住所又は事務所の所在地
- (3) 特に通信を受ける場所を定めたときは，その場所
- (4) 代理人を定めたときは，その氏名又は名称及び住所又は事務所の所在地並びに代理の権限

（委託の際の指示事項）

第56条 顧客が取引対象オプションの売付け又は買付けを委託する場合には，その都度，次の各号に掲げる事項を取引参加者に指示するものとする。ただし，顧客があらかじめ指定した方法に従い指数オプション取引の決済を行うことについて，取引参加者が同意している場合には，第4号に掲げる事項の指示があったものとみなす。

- (1) 取引対象指数
- (2) 指数プットオプション又は指数コールオプションの別
- (3) 限月取引
- (4) 権利行使価格
- (5) 新規の売付け若しくは新規の買付け又は転売（買建玉（当該銘柄の建玉のうち買付けの約定に係る数量をいう。）についての反対の取引をいう。以下同じ。）若しくは買戻し（売建玉（当該銘柄の建玉のうち売付けの約定に係る数量をいう。）についての反対の取引をいう。以下同じ。）の区別

- (6) ストラテジー取引により行おうとするときは，その旨
- (7) 数量
- (8) 値段の限度（ストラテジー取引にあつてはストラテジー値段の限度）
- (9) 有効期間条件又は執行数量条件
- (10) 呼値に条件を付すときは，その条件
- (11) 取引時間
- (12) 委託注文の有効期間

2 前項各号列記以外の部分の規定にかかわらず，顧客と取引参加者との間に合意がある場合には，顧客は，当該売付け又は買付けが成立した取引日の終了する日の午後４時30分までの取引参加者の指定する時限までに，前項第４号に掲げる事項の指示を行うことができる。

3 前項の場合において，顧客が取引参加者に前項の定める時限までに前項の指示を行わないときは，新規の売付け又は新規の買付けの指示があったものとみなす。

（ギブアップに係る指数オプション取引の委託の際の指示事項等）

第56条の２ 顧客がギブアップに係る指数オプション取引を委託する場合には，その都度，注文執行取引参加者に対し，前条第１項各号（第４号を除く。）に掲げる事項のほか，次の各号に掲げる事項を指示するものとする。

- (1) ギブアップに係る指数オプション取引である旨
- (2) 指定清算執行取引参加者名
- (3) 指定清算執行取引参加者において当該ギブアップに係る指数オプション取引がいずれの顧客によるものか確認するために必要な事項

2 前項の規定にかかわらず，顧客と注文執行取引参加者及び指定清算執行取引参加者との間に合意がある場合には，当該取引が成立した取引日の終了する日の午後４時までの注文執行取引参加者の指定する時

限までに，前項の指示を行うことができるものとする。

- 3 第38条第2項の規定によりギブアップが成立した場合には，前条第1項ただし書及び第2項の規定にかかわらず，顧客は，清算執行取引参加者に対し，当該取引が成立した取引日の終了する日の午後4時30分までの清算執行取引参加者の指定する時限までに，第38条第3項の規定により新たに発生した指数オプション取引に係る前条第1項第4号に掲げる事項を指示するものとする。
- 4 顧客が委託しようとする指数オプション取引がギブアップに係るものである場合においては，前条第1項ただし書（「ただし，」を除く。以下同じ。），同条第2項及び同条第3項の規定を準用する。この場合において，第1項ただし書，第2項及び第3項中「取引参加者」とあるのは「清算執行取引参加者」と読み替え，第1項ただし書中「第4号」とあるのは「前条第1項第4号」と，第2項中「前項」とあるのは「前条第1項」と，第3項中「前項」とあるのは「前条第2項」と，それぞれ読み替えるものとする。
- 5 ギブアップに係る指数オプション取引の売付け又は買付けが第38条第3項の規定により消滅した場合には，当該指数オプション取引についての顧客と注文執行取引参加者との間の委託が終了し，同時に，同項の規定により新たに発生した指数オプション取引の売付け又は買付けについての顧客と清算執行取引参加者との間の決済に係る委託が新たに成立するものとする。

（取引再開時における委託注文の効力）

第56条の3 委託注文は，第56条第1項第11号に規定する顧客が指示した当該委託注文の有効期間内においては，本所が指数オプション取引の停止を行った場合においても，その効力を有する。ただし，顧客が当該場合に委託注文を失効させる旨の指示を行っているときは，この限りでない。

## 第 2 節 証拠金等

( 証拠金 )

第57条 証拠金に関する事項は、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（以下「証拠金規則」という。）によるものとする。

第58条から第64条まで 削 除

## 第 3 節 顧客の権利行使

( 権利行使の指示 )

第65条 顧客は、指数オプション取引における権利行使を委託する場合には、各銘柄（次の各号に定める場合に該当する銘柄を除く。）ごとに権利行使に係る数量を、権利行使日の午後 4 時までに取引参加者に指示するものとする。

(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

2 次の各号に定める場合に該当する銘柄については、前項に規定する時限までに同項の指示が行われないうきであっても、当該指示が行われたものとみなす。ただし、当該銘柄について顧客が当該時限までに権利行使を行わない旨の指示を行った場合には、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

#### 第4節 顧客の決済等

( 決済のために授受する金銭 )

第66条 顧客と取引参加者との間で指数オプション取引の決済のために授受する金銭は、当該顧客の委託に基づく売付け又は買付けが成立した場合の取引代金及び当該顧客の委託に基づく権利行使に係る決済の場合における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とする。

( 顧客の決済時限 )

第67条 顧客が前条に掲げる決済を行う場合には、買付けに係る取引代金又は権利行使の割当てを受けたことに伴う金銭を、取引が成立した取引日の終了する日又は権利行使日の翌日（当該顧客が非居住者（外国為替及び外国貿易法（昭和24年法律第228号）第6条第1項第6号に規定する非居住者をいう。）である場合は、当該取引が成立した取引日の終了する日又は権利行使日から起算して3日目（休業日を除外する。）の日）までの取引参加者が指定する日時までに、取引参加者に差し入れるものとする。

( 証拠金の決済のために授受する取引代金等への充当 )

第67条の2 取引参加者は、顧客が前条の規定により当該取引参加者に差し入れるべき取引代金又は金銭については、当該顧客が当該差入れをすべき日において証拠金として差し入れ若しくは預託している金銭又は当該顧客に係る証拠金規則に定める計算上の利益額に相当する額の金銭をもって充てることができる。

( 顧客の決済不履行の場合の処置 )

第68条 顧客が、所定の時限までに、指数オプション取引に関し取引参加者に差し入れるべき証拠金を差し入れない若しくは預託すべき証拠



金を預託しない場合又は支払うべき金銭若しくは買付けに係る取引代金を支払わない場合は，当該取引参加者は，任意に，当該指数オプション取引を決済するために，当該顧客の計算において，転売若しくは買戻し又は権利行使（これらの委託を含む。）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，又は社債，株式等の振替に関する法律（平成13年法律第75号）に基づく口座に記録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5節 未決済約定の引継ぎ等

（顧客の委託に基づく未決済約定の取扱い等）

第68条の2 顧客の委託に基づく未決済約定の引継ぎ等に関する事項は，証拠金規則によるものとする。

#### 第6節 雑 則

（外貨による金銭の授受）

第69条 顧客と取引参加者との間における指数オプション取引に係る金銭の授受は，取引参加者が同意した場合には，顧客が指定する外貨により行うことができるものとする。

（ポジション保有状況の改善指示を受けた取引参加者が行う措置等）

第69条の2 先物・オプション清算参加者（清算・決済規程第4条第2項に規定する先物・オプション清算参加者をいう。以下同じ。）である取引参加者が業務方法書第28条第4項に基づくポジション保有状況の改善指示（以下この条において「改善指示」という。）を受けた場合には，当該改善指示の事由と密接な関係を有している指数オプション取引の委託を行った顧客に対して，当該顧客の委託に基づく未決済約定

の決済又は他の取引参加者への引継ぎを要請することができる。ただし、当該要請は、当該顧客の委託に基づく指数オプション取引に係る取引証拠金について同第28条第3項第1号に規定する措置が実施されたにもかかわらず、当該顧客が正当な理由なくこれに従わないことによって当該先物・オプション清算参加者が改善指示を受けたときに限り行うことができるものとする。

- 2 前項の場合、当該先物・オプション清算参加者である取引参加者は、合理的に必要と認められる範囲内において、当該顧客の委託に基づく指数オプション取引を決済するために、当該顧客の計算において、転売又は買戻し等（転売若しくは買戻し（これらの委託を含む。）又は最終決済をいう。以下この条において同じ。）を行うことができる。ただし、かかる転売又は買戻し等は、当該先物・オプション清算参加者である取引参加者が、他の方法により当該改善指示に適合するべく合理的な努力を行ってもなお当該改善指示に適合できないときで、かつ、当該顧客に対して、あらかじめ、合理的な猶予期間を定めて同項の要請を行ったにもかかわらず、当該顧客がこれらを正当な理由なく行わなかったときに限り行うことができるものとする。

- 3 前2項の規定は、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の清算・決済規程第20条第2項に規定する指定先物・オプション清算参加者が改善指示を受けた場合であって、当該指定先物・オプション清算参加者が当該先物・オプション非清算参加者の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に係る未決済約定の決済又は他の先物・オプション清算参加者への引継ぎの指示を当該先物・オプション非清算参加者に対して行ったときについて準用する。

（取引の取消しの効果等）

第69条の3 本所が取引の取消しを行った場合には、当該取り消された

取引に係る顧客と取引参加者との間の権利及び義務は、初めから発生しなかったものとみなす。

2 顧客は、本所が取引を取り消したことにより損害を受けることがあっても、過誤のある注文を発注した取引参加者に対して、その損害の賠償を請求できないものとする。ただし、過誤のある注文の発注に際して、取引参加者に故意又は重過失が認められる場合は、この限りでない。

3 顧客は、本所が取引を取り消したことにより損害を受けることがあっても、本所に対して、その損害の賠償を請求できないものとする。ただし、本所に故意又は重過失が認められる場合は、この限りでない。

( 受託契約準則の読替え )

第70条 指数オプション取引に係る受託契約準則第2条の適用については、同条中「取引参加者(取引参加者規程第2条第2項に規定する現物取引参加者、同条第4項に規定するIPO取引参加者又は同条第6項に規定するジャスダック取引参加者をいう。以下同じ。)」とあるのは「取引参加者(取引参加者規程第2条第2項に規定する現物取引参加者又は同条第3項に規定する先物取引等取引参加者をいう。)」とする。

## 第4章 雑 則

( 有価証券等清算取次ぎに対する適用 )

第71条 指数オプション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指数オプション取引を行う者とみなして第2章(第4節及び第5節を除く。)の規定を適用する。

付 則

- 1 この特例は，平成元年 6 月 1 日から施行する。
  - 2 第 5 条第 2 項本文後段及び同条第 3 項本文の規定にかかわらず，次の各号に掲げる日を取引最終日とする限月取引の取引開始日は，平成元年 6 月12日とする。
    - (1) 平成元年 7 月13日
    - (2) 平成元年 8 月10日
    - (3) 平成元年 9 月 7 日
    - (4) 平成元年10月12日
  - 3 午後立会の立会時は，第 7 条第 1 項本文の規定にかかわらず，本所の定める日まで，午後 1 時から 3 時15分までとする。
  - 4 特定限月取引以外の限月取引の取引最終日における午後立会の立会時は，第 7 条第 1 項ただし書の規定にかかわらず，本所の定める日まで，午後 1 時から 3 時までとする。
- (注) 第 3 項及び第 4 項の「本所が定める日」は平成 3 年 4 月29日

付 則

この特例は，平成元年12月18日から施行する。

付 則

この特例は，平成 2 年10月 1 日から施行する。

付 則

この特例は，平成 3 年 1 月 4 日から施行する。

付 則

この特例は，平成 3 年 4 月30日から施行する。

付 則

この特例は，平成 3 年 7 月15日から施行する。

付 則

この特例は，平成 4 年 2 月10日から施行する。

付 則

この特例は、平成 4 年 2 月 13 日から施行する。ただし、この特例施行の際、現に行われている限月取引に係る取引については、なお従前の例による。

付 則

この特例は、平成 4 年 3 月 23 日から施行する。

付 則

この特例は、平成 4 年 4 月 20 日から施行する。

付 則

この特例は、平成 4 年 7 月 20 日から施行する。

付 則

この特例は、平成 5 年 4 月 1 日から施行する。

付 則

- 1 この特例は、平成 6 年 2 月 14 日から施行する。
- 2 改正後の第 5 条第 2 項第 1 号及び同条第 3 項本文の規定にかかわらず、日経 300 株価指数オプションに係る第 1 号から第 5 号までに掲げる日を取引最終日とする限月取引の取引開始日は、平成 6 年 2 月 14 日とし、第 6 号に掲げる日を取引最終日とする限月取引の取引開始日は、平成 6 年 3 月 11 日とする。
  - (1) 平成 6 年 4 月 7 日
  - (2) 平成 6 年 5 月 12 日
  - (3) 平成 6 年 6 月 9 日
  - (4) 平成 6 年 9 月 8 日
  - (5) 平成 6 年 12 月 8 日
  - (6) 平成 7 年 3 月 9 日
- 3 改正後の第 6 条第 2 項第 1 号の規定にかかわらず、日経 300 株価指数オプションに係る前項第 3 号に掲げる日を取引最終日とする限月取引に設定する権利行使価格は、5 ポイント刻みで設定する 5 ポ

イントの整数倍の数値とする。

- 4 この特例施行の際，平成6年4月1日以降の日で，本所が定める日を施行日とする改正規定第69条中「株価指数プットオプション又は株価指数コールオプション」とあるのは，「日経300株価指数オプション又は日経平均株価指数オプション」とする。

付 則

この特例は，平成6年4月1日以降の日で，本所が定める日から施行する。

(注)「本所が定める日」は平成6年4月1日

付 則

この特例は，平成6年8月15日から施行する。

付 則

- 1 この特例は，平成7年4月3日から施行する。
- 2 第5条第2項第1号の改正規定及び同条第3項本文の規定にかかわらず，日経300株価指数オプションに係る次の各号に掲げる日を取引最終日とする限月取引の取引開始日は，平成7年4月3日とする。

(1) 平成8年6月13日

(2) 平成8年12月12日

付 則

この特例は，平成7年5月1日から施行する。

付 則

この特例は，平成7年11月1日から施行する。

付 則

この特例は，平成9年4月1日から施行し，同日以後の徴収分について適用する。

付 則

この特例は，平成9年5月16日から施行する。

付 則

この特例は，平成 9 年 6 月 1 日から施行する。

付 則

この特例は，平成 9 年 7 月 1 日から施行する。

付 則

この特例は，平成 9 年 10 月 29 日から施行する。ただし，第 43 条の 9 から第 43 条の 19 まで及び第 68 条の 2 から第 68 条の 6 までの改正規定は，平成 9 年 11 月 5 日から施行する。

付 則

この特例は，平成 10 年 4 月 1 日から施行する。

付 則

- 1 この特例は，平成 10 年 4 月 20 日から施行する。
- 2 改正後の第 43 条の 6 第 2 項及び第 62 条第 2 項の規定にかかわらず，改正後の第 4 条第 1 項第 3 号から第 5 号までに掲げるオプション対象株価指数については，当該オプション対象株価指数に係る株価指数オプションの取引開始日の 1 年後の応当日の前日までの日を取引証拠金額算定基準日又は委託証拠金額算定基準日とする場合は，改正後の第 43 条の 6 第 2 項及び第 62 条第 2 項中「オプション対象株価指数ごとに本所が定める株価指数先物取引の毎日の清算指数（指数先物特例第 28 条に規定する清算指数をいう。以下この項において同じ。）とその前日の清算指数」とあるのは「オプション対象株価指数の毎日の最終の数値とその前日の最終の数値」と，「当該 2 つの清算指数」とあるのは「当該 2 つの数値」と読み替えるものとする。

付 則

この特例は，本所が定める日から施行する。

(注)「本所が定める日」は平成 10 年 5 月 11 日

付 則

この特例は，平成 10 年 6 月 15 日から施行する。

付 則

この特例は，平成10年7月1日から施行する。

付 則

- 1 この特例は，平成10年11月30日から施行する。ただし，第7条，第9条，第16条，第47条，第48条及び第50条の改正規定は，平成10年12月1日から，第10節の節名及び第44条の改正規定は，平成11年4月1日から施行する。
- 2 前項の規定にかかわらず，この特例施行の日に預託を行う取引証拠金及び差入れを行う委託証拠金については，なお従前の例による。
- 3 第1項の規定にかかわらず，平成10年11月26日及び27日に成立した取引に係る第32条に規定する正会員又は先物取引等特別参加者に係る取引代金の授受は，同年12月1日に行うものとし，同年11月26日及び27日に成立した買付けに係る第67条に規定する顧客に係る取引代金の差入れは，同年12月1日までの正会員又は先物取引等特別参加者が指定する日時までに行うものとする。
- 4 第44条の規定については，平成10年12月1日から平成11年3月31日までの間においては，同条中「正会員又は先物取引等特別参加者」とあるのは「正会員又は先物取引等特別参加者（金融システム改革のための関係法律の整備等に関する法律（平成10年法律第107号）附則第12条第2項に規定するみなし登録証券会社又は同第59条第2項に規定するみなし登録外国証券会社に限る。）」と，「行うものとする。」とあるのは「行うものとする。ただし，当該金銭を証券取引法第47条に定める方法により自己の固有財産と分別して保管している場合は，この限りでない。」と，「金銭又は有価証券（再預託に係る取引証拠金として本所に預託した金銭又は有価証券を除く。）」とあるのは「金銭又は有価証券」と，「売買取引等」とあるのは「売買等」とする。

付 則



この特例は、平成11年 1 月 1 日から施行する。

付 則

- 1 この特例は、平成11年 4 月 1 日から施行する。
- 2 この特例施行の日前に行われた株価指数オプション取引に課せられる取引所税に相当する金額の徴収については、なお従前の例による。

付 則

この特例は、平成11年 7 月26日から施行する。

付 則

この特例は、本所が定める日から施行する。

(注)「本所が定める日」は平成11年 8 月19日

付 則

- 1 この特例は、金融システム改革のための関係法律の整備等に関する法律(平成10年法律第107号)附則第 1 条第 3 号に定める政令で定める日から施行し、同日以後の取引分から適用する。

(注)「政令で定める日」は平成11年10月 1 日

- 2 前項の規定にかかわらず、第34条及び第65条の改正規定は、本所が定める日から施行する。

(注)「本所が定める日」は平成11年 9 月 1 日

付 則

- 1 この特例は、平成11年11月 1 日から施行する。
- 2 この特例施行の日(以下「施行日」という。)前に成立した株価指数オプション取引で施行日において未決済のものについては、施行日をもって第30条の 2 の規定に基づく株価指数オプションの付与者としての地位の承継及び債務の引受けが行われたものとする。

付 則

この特例は、平成11年11月29日から施行する。

付 則

この特例は，平成11年12月1日から施行する。

付 則

- 1 この特例は，本所が定める日から施行する〔(注)「本所が定める日」は平成12年10月30日〕。ただし，第5条，第6条及び第14条の改正規定は，平成12年9月1日以降の日で，本所が定める日から施行する〔(注)「本所が定める日」は平成12年10月23日〕。
- 2 改正後の第5条第2項第2号及び同条第3項の規定にかかわらず，次の各号に掲げる日を取引最終日とする限月取引の取引開始日は，平成12年9月1日以降の日で，本所が定める日とする〔(注)「本所が定める日」は平成12年10月23日〕。

(1) 平成13年3月8日

(2) 平成13年6月7日

(3) 平成13年9月13日

(4) 平成13年12月13日

付 則

この特例は，平成12年12月1日から施行する。

付 則

この特例は，平成13年4月1日から施行する。

付 則

この特例は，平成13年5月1日から施行する。

付 則

この特例は，平成13年5月1日から施行する。

付 則

この特例は，平成14年2月1日から施行する。

付 則

この特例は，平成14年5月20日から施行する。

付 則

この特例は，平成14年5月27日から施行する。

付 則

この特例は、平成14年7月15日から施行する。

付 則

この特例は、平成14年12月13日から施行する。

付 則

この特例は、平成15年1月14日から施行する。

付 則

この特例は、平成15年4月2日から施行する。

付 則

この特例は、本所が定める日から施行する。

(注)「本所が定める日」は平成18年3月10日

付 則

この特例は、平成16年6月30日から施行する。

付 則

この特例は、平成17年4月1日から施行する。

付 則

この特例は、平成18年2月27日から施行する。

付 則

この特例は、平成18年6月26日から施行する。

付 則

この特例は、平成18年7月18日から施行する。

付 則

この特例は、平成19年5月21日から施行する。

付 則

この特例は、平成19年9月18日から施行する。

付 則

この特例は、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

この特例は、平成19年 9 月30日から施行する。

付 則

この特例は、平成19年 9 月30日から施行する。

付 則

この特例は、平成19年10月29日から施行する。

付 則

この特例は、平成20年 1 月 4 日から施行する。

付 則

この特例は、平成20年 3 月10日から施行する。

付 則

この特例は、平成20年 6 月16日から施行する。

付 則

この特例は、平成20年 9 月12日から施行する。ただし、第14条の改正規定は、平成20年 9 月16日から施行する。

付 則

この特例は、平成20年10月14日から施行する。

付 則

この特例は、平成20年12月 1 日から施行する。

付 則

この特例は、平成21年 1 月 5 日から施行する。

付 則

この特例は、平成21年 6 月12日から施行する。

付 則

この特例は、平成21年 6 月16日から施行する。

付 則

この特例は、平成21年12月30日から施行する。

付 則

この特例は，平成22年 4 月 1 日から施行する。

付 則

この特例は，平成22年 7 月20日から施行する。

付 則

この特例は，平成22年10月12日から施行する。

付 則

1 この特例は，平成23年 2 月14日から施行する。

2 前項の規定にかかわらず，売買システムの稼働に支障が生じたことにより，改正後の規定により売買を行うことができない又はそのおそれがあると本所が認める場合には，平成23年 2 月14日以後の本所が定める日から施行する。

付 則

この特例は，平成23年 7 月19日から施行する。

付 則

この特例は，平成24年 2 月27日から施行する。

付 則

この特例は，平成24年11月26日から施行する。

付 則

この特例は，平成25年 1 月 1 日から施行する。