

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

第1章 総則

(目的)

第1条 この規則は、業務方法書第65条第2項並びに清算・決済規程第37条第2項並びに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。）第37条及び第40条の規定に基づき、取引所外国為替証拠金取引（以下「取引所FX取引」という。）に係る証拠金及び未決済約定の引継ぎ等について、必要な事項を定める。

2 この規則の変更は、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。

(定義)

第2条 この規則において「FX取引参加者」とは、取引参加者規程第2条第5項に規定する外国為替証拠金取引参加者をいう。

2 この規則において「取引所FX取引に係る債務」とは、取引所FX取引の決済に係る金銭の支払債務その他の取引所FX取引に関して負担すべき債務をいう。

3 この規則において「FX取引取次者」とは、FX取引参加者に取引所FX取引の委託をした顧客が、金融商品取引業者又は登録金融機関である場合であって、当該委託がFX取引参加者に対する取引所FX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。

4 この規則において「FX取引申込者」とは、FX取引取次者に委託の取次ぎの申込みをした者をいう。

- 5 この規則において「非居住者」とは、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号に規定する居住者以外の自然人及び法人をいう。
- 6 この規則において「FX清算参加者」とは、業務方法書第4条第1項第2号に規定するFX清算資格を有する清算参加者をいう。
- 7 この規則において「FX非清算参加者」とは、業務方法書第9条に規定する非清算参加者のうちFX取引参加者であってFX清算資格を有していない者をいう。
- 8 この規則において「指定FX清算参加者」とは、業務方法書第9条に規定する指定清算参加者のうち、FX非清算参加者が取引所FX取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託先として指定した者をいう。
- 9 この規則において「支払不能による売買停止等」とは、次の各号に掲げる措置をいう。
- (1) 取引参加者規程第43条第3項の規定に基づく有価証券の売買等（有価証券等清算取次ぎによるものを除く。）若しくは有価証券等清算取次ぎの委託の停止の措置
 - (2) 次のa又はbに掲げる措置が行われた場合における取引参加者規程第47条第1項の規定に基づく有価証券の売買等（有価証券等清算取次ぎによるものを除く。）の停止の措置
 - a 業務方法書第27条の3の規定に基づく清算資格の取消し又は債務の引受けの停止（同第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に違反した場合（その具体的なおそれがあると認められる場合を含む。）等本所が債務履行確保の観点から特に必要と認めた場合に限る。）
 - b 業務方法書第68条第5項の規定に基づく債務の引受けの停止
- 10 この規則において「取引日」とは、取引所FX取引特例第2条第15号に規定する取引日をいう。

(証拠金の目的)

第3条 取引証拠金は、この規則で定めるところにより、FX清算参加者が本所に対して支払い若しくは引き渡すべき取引所FX取引に係る債務、FX非清算参加者がFX清算参加者に対して支払い若しくは引き渡すべき取引所FX取引に係る債務又は顧客がFX取引参加者に対して負担する取引所FX取引に係る債務（顧客がFX取引取次者である場合は、FX取引申込者が顧客に対して負担する取引所FX取引に係る債務を含む。）の履行を確保するためのものとする。

- 2 証拠金（前項の取引証拠金を除く。）は、この規則で定めるところにより、顧客がFX取引参加者に対して負担する取引所FX取引に係る債務の履行を確保するためのものとする。
- 3 本所、FX清算参加者、FX非清算参加者又はFX取引取次者である顧客は、前2項に規定する債務につき不履行が発生した場合には、取引証拠金又は証拠金に対する権利を行使し、当該債務の弁済に充当することができる。

(証拠金基準額)

第4条 取引所FX取引に係る1取引単位当たりの証拠金基準額は、本所が規則により定める値に取引単位を乗じて得られる額（本所が定めるところにより端数金額を切り上げる。）とする。

- 2 前項に規定する証拠金基準額は、算定基準日（毎週の最終の取引日をいう。）の属する週の翌々週の最初の取引日から適用するものとする。

第2章 清算・決済規程関係

第1節 取引証拠金等

第1款 FX清算参加者の取引証拠金等

(自己分の取引証拠金の預託)

第5条 FX清算参加者は、自己の計算による取引所FX取引の売付け又は買付けが成立した場合は、次項に規定する自己分の取引証拠金所要額以上の額の取引証拠金を、本所が定めるところにより、本所に預託しなければならない。

2 自己分の取引証拠金所要額は、取引所FX取引に係る自己の計算による建玉（業務方法書第63条の2の規定により申告した建玉をいう。以下建玉の取扱いにおいて同じ。）について、売建玉の数量と買建玉の数量のうち多い方の数量に証拠金基準額を乗じて得た額とする。

(委託分及び有価証券等清算取次ぎ分の取引証拠金の預託)

第6条 FX清算参加者は、顧客の委託又はFX非清算参加者の有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引所FX取引の売付け又は買付けが成立した場合は、第21条第1項に規定する委託分及び有価証券等清算取次ぎ分の取引証拠金所要額以上の額の取引証拠金を、本所が定めるところにより、本所に預託しなければならない。

(委託分の取引証拠金の預託)

第7条 FX清算参加者は、顧客が差し入れた取引証拠金の全部を当該顧客の代理人として、本所が定めるところにより、本所に預託しなければならない。

2 FX清算参加者は、顧客が委託証拠金を預託した場合においては、当該顧客が委託証拠金として預託した金銭の額及び有価証券の時価評価額（取引証拠金の預託を行う日の前々日（休業日（業務方法書第3条第1項に規定する休業日をいい、同条第4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、順次繰り上げる。以下同じ。）における時価（別表第2項に規定する時価をいう。以下同じ。）により評価した額（当該有価証券がアメリカ合衆国財務省証券である場合に

は、その時価を取引証拠金の預託を行う日の前々日における東京外国為替市場の対顧客直物電信買相場の1米ドル当たりの円貨額により円貨に換算した額)をいう。第9条第2項において同じ。)の合計額に相当する額以上の自己の金銭をもって取引証拠金として、本所が定めるところにより、本所に預託しなければならない。

3 前2項の場合において、各顧客がFX清算参加者に取引証拠金として差し入れた金銭の額又は委託証拠金として預託した金銭の額及び有価証券を代用価格(取引証拠金の預託を行う日の前々日における時価に別表第2項に定める率を乗じた額(当該有価証券がアメリカ合衆国財務省証券である場合は、その時価に同項に定める率を乗じた額を取引証拠金の預託を行う日の前々日における東京外国為替市場の対顧客直物電信買相場の1米ドル当たりの円貨額により円貨に換算した額)をいう。第9条第3項及び第15条第6項において同じ。)により評価した額の合計額が第35条第2項に規定する当該顧客の証拠金所要額に満たないときは、当該FX清算参加者は、当該証拠金所要額から当該顧客が差し入れた取引証拠金又は預託した委託証拠金を差し引いた額以上の自己の金銭をもって取引証拠金として、本所が定めるところにより、本所に預託しなければならない。

(FX取引取次者に係る取引証拠金の預託に関する特則)

第8条 前条第1項の規定にかかわらず、FX清算参加者は、顧客がFX清算参加者に差し入れた取引証拠金がFX取引申込者の代理人として差し入れたものである場合は、その全部を当該FX取引申込者の代理人として、本所が定めるところにより、本所に預託しなければならない。

(有価証券等清算取次ぎ分の取引証拠金の預託)

第9条 FX清算参加者は、FX非清算参加者が差し入れた取引証拠金

の全部を当該 FX 非清算参加者又は当該 FX 非清算参加者の顧客の代理人として、本所が定めるところにより、本所に預託しなければならない。

2 FX 清算参加者は、FX 非清算参加者が FX 非清算参加者証拠金(第15条第5項に規定する FX 非清算参加者証拠金をいう。以下第14条までにおいて同じ。)を預託した場合においては、当該 FX 非清算参加者が FX 非清算参加者証拠金として預託した金銭の額及び有価証券の時価評価額の合計額に相当する額以上の自己の金銭をもって取引証拠金として、本所が定めるところにより、本所に預託しなければならない。

3 前2項の場合において、各 FX 非清算参加者が FX 清算参加者に取引証拠金として差し入れた金銭の額又は委託証拠金として預託した金銭の額及び有価証券を代用価格により評価した額の合計額が第21条第2項の規定により当該 FX 非清算参加者の取引証拠金所要額として FX 非清算参加者が申告した額に満たないときは、当該 FX 清算参加者は、当該取引証拠金所要額から当該 FX 非清算参加者が差し入れた取引証拠金又は預託した FX 非清算参加者証拠金を差し引いた額以上の自己の金銭をもって取引証拠金として、本所が定めるところにより、本所に預託しなければならない。

(有価証券等清算取次ぎ分の取引証拠金のうち FX 取引取次者に係る取引証拠金の預託に関する特則)

第10条 前条第1項の規定にかかわらず、FX 清算参加者は、FX 非清算参加者が FX 清算参加者に差し入れた取引証拠金が FX 取引申込者の代理人として差し入れたものである場合は、その全部を当該 FX 取引申込者の代理人として、本所が定めるところにより、本所に預託しなければならない。

(取引証拠金の預託時限)

第11条 第5条から前条までの規定による取引証拠金の預託は、取引所FX取引の売付け又は買付けが成立した取引日の終了する日（休業日に当たるときは、順次繰り下げる。）の翌日（休業日に当たるときは、順次繰り下げる。以下同じ。）の正午までに行うものとする。

（取引証拠金の維持）

第12条 FX清算参加者は、自己分の取引証拠金として本所に預託されている金銭の額が自己分の取引証拠金所要額に満たない場合は、その不足額以上の額を、自己分の取引証拠金として、不足額が生じた日（休業日に当たるときは、順次繰り下げる。以下同じ。）の翌日の正午までに、本所が定めるところにより、本所に追加預託しなければならない。

2 FX清算参加者は、委託分及び有価証券等清算取次ぎ分の取引証拠金として本所に預託されている金銭の額が委託分及び有価証券等清算取次ぎ分の取引証拠金所要額に満たない場合は、その不足額以上の額を、委託分及び有価証券等清算取次ぎ分の取引証拠金として、不足額が生じた日の翌日の正午までに、本所が定めるところにより、本所に追加預託しなければならない。

3 FX清算参加者は、第7条第1項若しくは第2項又は第8条の規定により顧客に係る取引証拠金として本所に預託している金銭の額が、当該顧客が取引証拠金として差し入れた金銭の額又は委託証拠金として預託した金銭の額及び有価証券の時価評価額（計算する日の前日（休業日に当たるときは、順次繰り上げる。以下同じ。）における時価により評価した額（当該有価証券がアメリカ合衆国財務省証券である場合は、その時価を計算する日の前日における東京外国為替市場の対顧客直物電信買相場の1米ドル当たりの円貨額により円貨に換算した額）をいう。第5項において準用する第9条第2項、本条第6項、第18条第3項及び第19条において同じ。）の合計額に満たない場合には、その不足額以上の額を、委託分の取引証拠金として、不足額が生じた日の

翌日の正午までに第7条第1項若しくは第2項又は第8条に準じて本所に追加預託しなければならない。

4 各顧客が取引証拠金として差し入れた金銭の額又は委託証拠金として預託した金銭の額及び有価証券を代用価格（計算する日の前日における時価に別表第2項に定める率を乗じた額（当該有価証券がアメリカ合衆国財務省証券である場合は、その時価に同項に定める率を乗じた額を計算する日の前日における東京外国為替市場の対顧客直物電信買相場の1米ドル当たりの円貨額により円貨に換算した額）をいう。第7項並びに第18条第2項及び第4項において同じ。）により評価した額の合計額が第35条第2項に規定する当該顧客の証拠金所要額に満たないときは、FX清算参加者は、その不足額以上の額を、委託分の取引証拠金として、不足額が生じた日の翌日の正午までに第7条第3項に準じて本所に追加預託しなければならない。

5 FX清算参加者は、第14条、第15条第3項から第5項まで又は第16条の規定によりFX非清算参加者が当該FX清算参加者に差し入れるべき取引証拠金に不足額が生じた場合において、当該FX非清算参加者が当該不足額以上の額の取引証拠金を追加差入れしたときは、当該取引証拠金の全部を不足額が生じた日の翌日の正午までに、第9条第1項若しくは第2項又は第10条に準じて本所に追加預託しなければならない。

6 FX清算参加者は、第9条第2項（前項において準用する場合を含む。）の規定によりFX非清算参加者に係る取引証拠金として本所に預託している金銭の額が、当該FX非清算参加者が自己分の取引証拠金として差し入れた金銭の額又はFX非清算参加者証拠金として預託した金銭の額及び有価証券の時価評価額の合計に満たない場合には、その不足額以上の額を、FX非清算参加者の自己分又はFX非清算参加者の委託分の取引証拠金として、不足額が生じた日の翌日の正午までに前項において準用する第9条第2項に準じて本所に追加預託しなけ

ればならない。

7 各 FX 非清算参加者が取引証拠金として差し入れた金銭の額又は FX 非清算参加者証拠金として預託した金銭の額及び有価証券を代用価格により評価した額の合計額が第21条第2項の規定により当該 FX 非清算参加者の取引証拠金所要額として FX 非清算参加者が申告した額に満たないときは、FX 清算参加者は、その不足額以上の額を、取引証拠金として、不足額が生じた日の翌日の正午までに第9条第3項に準じて本所に追加預託しなければならない。

(取引証拠金の区分及び管理方法)

第13条 第5条から前条まで（第11条を除く。）の取引証拠金の預託は、次の各号に掲げる取引証拠金に区分して行うものとする。

- (1) FX 清算参加者が自己の計算による取引所 FX 取引につき本所に預託する取引証拠金（以下「FX 清算参加者自己分の取引証拠金」という。）
- (2) FX 清算参加者が顧客の委託に基づく取引所 FX 取引につき本所に預託する取引証拠金（以下「FX 清算参加者委託分の取引証拠金」という。）のうち、顧客から当該 FX 清算参加者に取引証拠金として差し入れられたもの（次号に定める取引証拠金を除く。以下「FX 清算参加者委託分の取引証拠金（直接預託分）」という。）
- (3) FX 清算参加者委託分の取引証拠金のうち、FX 取引申込者が顧客に取次証拠金を預託した場合において、当該顧客から FX 清算参加者に当該取次証拠金に相当する取引証拠金として差し入れられたもの（以下「FX 清算参加者委託分の取引証拠金（FX 取引取次者差換預託分）」という。）
- (4) FX 清算参加者委託分の取引証拠金のうち、前2号に定めるもの以外のもの（以下「FX 清算参加者委託分の取引証拠金（差換預託分）」という。）

- (5) 指定 FX 清算参加者が、FX 非清算参加者の自己の計算による取引所 FX 取引につき本所に預託する取引証拠金（以下「FX 非清算参加者自己分の取引証拠金」という。）のうち、当該 FX 非清算参加者から当該指定 FX 清算参加者に取引証拠金として差し入れられたもの（以下「FX 非清算参加者自己分の取引証拠金（直接預託分）」といふ。）
- (6) FX 非清算参加者自己分の取引証拠金のうち、前号に定めるもの以外のもの（以下「FX 非清算参加者自己分の取引証拠金（差換預託分）」といふ。）
- (7) 指定 FX 清算参加者が、FX 非清算参加者の顧客の委託に基づく取引所 FX 取引につき本所に預託する取引証拠金（以下「FX 非清算参加者委託分の取引証拠金」という。）のうち、当該顧客から当該 FX 非清算参加者に取引証拠金として差し入れられたもの（次号に定める取引証拠金を除く。以下「FX 非清算参加者委託分の取引証拠金（直接預託分）」といふ。）
- (8) FX 非清算参加者委託分の取引証拠金のうち、FX 取引申込者が顧客に取次証拠金を差し入れた場合において、当該顧客から FX 非清算参加者に当該取次証拠金に相当する取引証拠金として差し入れられたもの（以下「FX 非清算参加者委託分の取引証拠金（FX 取引取次者差換預託分）」といふ。）
- (9) FX 非清算参加者委託分の取引証拠金のうち前 2 号に定めるものの以外のもの（以下「FX 非清算参加者委託分の取引証拠金（差換預託分）」といふ。）
- 2 本所は、第 5 条から前条まで（第 11 条を除く。）の規定により本所に預託される取引証拠金について、前項各号に規定する区分により管理を行うものとする。

第 2 款 FX 非清算参加者の取引証拠金

(FX非清算参加者の自己分の取引証拠金の差入れ)

第14条 FX非清算参加者は、自己の計算による取引所FX取引の売付け又は買付けが成立した場合は、自己分の取引証拠金所要額以上の額の取引証拠金を、本所が定めるところにより、指定FX清算参加者に差し入れなければならない。

(FX非清算参加者の委託分の取引証拠金の差入れ又は預託)

第15条 FX非清算参加者は、顧客の委託に基づく取引所FX取引の売付け又は買付けが成立した場合は、次項に規定する委託分の取引証拠金所要額以上の額の取引証拠金を指定FX清算参加者に差し入れ又は預託しなければならない。

- 2 委託分の取引証拠金所要額は、各顧客の第35条第2項に規定する証拠金所要額をすべての顧客について合計した額とする。
- 3 FX非清算参加者は、顧客が差し入れた取引証拠金の全部を当該顧客の代理人として、指定FX清算参加者に差し入れなければならない。
- 4 FX非清算参加者は、顧客が委託証拠金を預託した場合においては、当該顧客が委託証拠金として預託した金銭の額及び有価証券の時価評価額（取引証拠金の差入れを行う日の前々日における時価により評価した額（当該有価証券がアメリカ合衆国財務省証券である場合には、その時価を取引証拠金の差入れを行う日の前々日における東京外国為替市場の対顧客直物電信買相場の1米ドル当たりの円貨額により円貨に換算した額）をいう。次項において同じ。）の合計額に相当する額以上の自己の金銭をもって取引証拠金として、指定FX清算参加者に差し入れなければならない。
- 5 前項の規定にかかわらず、FX非清算参加者は、当該顧客が委託証拠金として預託した金銭の額及び有価証券の時価評価額の合計額に相当する額以上の自己の金銭をもって取引証拠金として、指定FX清算

参加者に預託することができる。この場合において、当該取引証拠金（以下「FX非清算参加者証拠金」という。）は、有価証券をもって代用預託することができる。

6 前3項の場合において、各顧客がFX非清算参加者に取引証拠金として差し入れた金銭の額又は委託証拠金として預託した金銭の額及び有価証券を代用価格により評価した額の合計額が第35条第2項に規定する当該顧客の証拠金所要額に満たないときは、当該FX非清算参加者は、当該証拠金所要額から当該顧客が差し入れた取引証拠金又は預託した委託証拠金を差し引いた額以上の自己の金銭をもって指定FX清算参加者に取引証拠金として差し入れ又はFX非清算参加者証拠金として預託しなければならない。この場合において、当該取引証拠金は、有価証券をもって代用預託することができる。

（FX非清算参加者のFX取引取次者に係る取引証拠金の預託に関する特則）

第16条 前条第3項の規定にかかわらず、FX非清算参加者は、顧客がFX非清算参加者に差し入れた取引証拠金がFX取引申込者の代理人として差し入れたものである場合は、その全部を当該FX取引申込者の代理人として指定FX清算参加者に差し入れなければならない。

（FX非清算参加者の取引証拠金の差入期限又は預託期限）

第17条 前3条の規定による取引証拠金の差入れ又はFX非清算参加者証拠金の預託は、取引所FX取引の売付け又は買付けが成立した取引日の終了する日の翌日の第11条に定める期限までの指定FX清算参加者が指定する日時までに、次の各号に掲げる区分のいずれに該当するか明示して、これを行うものとする。

- (1) FX非清算参加者自己分の取引証拠金
- (2) FX非清算参加者委託分の取引証拠金（直接預託分）

(3) FX非清算参加者委託分の取引証拠金（FX取引取次者差換預託分）

(4) FX非清算参加者委託分の取引証拠金（差換預託分）

（FX非清算参加者の取引証拠金の維持）

第18条 FX非清算参加者は、自己分の取引証拠金として指定FX清算参加者に差し入れている金銭の額が自己分の取引証拠金所要額に満たないときは、その不足額以上の額を、自己分の取引証拠金として、不足額が生じた日の翌日の第11条に定める时限までの指定FX清算参加者が指定する日時までに、指定FX清算参加者に追加差入れ又は追加預託しなければならない。この場合において、当該取引証拠金は、有価証券をもって代用預託することができる。

2 FX非清算参加者は、委託分の取引証拠金として指定FX清算参加者に差し入れている金銭の額又は預託している金銭の額及び有価証券を代用価格により評価した額の合計額が委託分の取引証拠金所要額に満たない場合は、その不足額以上の額を、不足額が生じた日の翌日の第11条に定める时限までの指定FX清算参加者が指定する日時までに、指定FX清算参加者に取引証拠金として追加差入れ又はFX非清算参加者証拠金として追加預託しなければならない。

3 FX非清算参加者は、指定FX清算参加者に、第15条第3項から第5項まで又は第16条の規定により顧客に係る取引証拠金として差し入れ又はFX非清算参加者証拠金として預託している金銭の額及び有価証券の時価評価額の合計額が、当該顧客が取引証拠金として差し入れた又は委託証拠金として預託した金銭の額及び有価証券の時価評価額の合計額に満たない場合には、その不足額以上の額を、不足額が生じた日の翌日の第11条に定める时限までの指定FX清算参加者が指定する日時までに、第15条第3項から第5項まで又は第16条に準じて指定FX清算参加者に委託分の取引証拠金として追加差入れ又はFX非清

算参加者証拠金として追加預託しなければならない。

4 各顧客が取引証拠金として差し入れた又は委託証拠金として預託した金銭の額及び有価証券を代用価格により評価した額の合計額が第34条第2項に規定する当該顧客の証拠金所要額に満たないときは、FX非清算参加者は、その不足額以上の額を、不足額が生じた日の翌日の第11条に定める时限までの指定FX清算参加者が指定する日時までに、第15条第6項に準じて指定FX清算参加者に委託分の取引証拠金として追加差入れ又はFX非清算参加者証拠金として追加預託しなければならない。

第3款 取引証拠金に係る返還請求権

(取引証拠金に係る返還請求権)

第19条 本所に預託されたFX清算参加者の各顧客に係るFX清算参加者委託分の取引証拠金に対する返還請求権は、FX清算参加者委託分の取引証拠金（直接預託分）として本所に預託されている金銭の額及びFX清算参加者委託分の取引証拠金（差換預託分）のうち当該顧客により委託証拠金として預託されている金銭の額及び有価証券の時価評価額の合計額（以下この項において「FX清算参加者顧客分現預託合計額」という。）を限度として、次の各号に掲げる者が、当該各号に定める額に相当する部分について有するものとする。

(1) 当該顧客

FX清算参加者顧客分現預託合計額から当該顧客がFX清算参加者に対して負担する取引所FX取引に係る債務のうち未履行部分に相当する額を控除した額

(2) FX清算参加者

FX清算参加者顧客分現預託合計額から、前号に定める額及び当該FX清算参加者が本所に対して支払い又は引き渡すべき当該顧客

の委託に基づく取引所 FX 取引に係る債務のうち未履行部分に相当する額を控除した額

2 本所に預託された FX 非清算参加者の各顧客に係る FX 非清算参加者委託分の取引証拠金に対する返還請求権は、 FX 非清算参加者委託分の取引証拠金（直接預託分）として本所に預託されている金銭の額及び FX 非清算参加者委託分の取引証拠金（差換預託分）のうち当該顧客により委託証拠金として預託されている金銭の額及び有価証券の時価評価額の合計額（以下この項において「 FX 非清算参加者顧客分現預託合計額」という。）を限度として、次の各号に掲げる者が、当該各号に定める額に相当する部分について有するものとする。

(1) 当該顧客

FX 非清算参加者顧客分現預託合計額から、当該顧客が FX 非清算参加者に対して負担する取引所 FX 取引に係る債務のうち未履行部分に相当する額を控除した額

(2) FX 非清算参加者

FX 非清算参加者顧客分現預託合計額から、前号に定める額及び当該 FX 非清算参加者が指定 FX 清算参加者に対して支払い又は引き渡すべき当該顧客の委託に基づく取引所 FX 取引に係る債務のうち未履行部分に相当する額を控除した額

(3) 指定 FX 清算参加者

FX 非清算参加者顧客分現預託合計額から、前 2 号に定める額及び当該指定 FX 清算参加者が本所に対して支払い又は引き渡すべき当該顧客の委託に基づく取引所 FX 取引に係る債務のうち未履行部分に相当する額を控除した額

3 第 1 項の規定にかかわらず、 FX 清算参加者の顧客が FX 取引取次者である場合において本所に預託された各 FX 取引申込者に係る FX 清算参加者委託分の取引証拠金に対する返還請求権は、当該 FX 取引申込者により FX 清算参加者委託分の取引証拠金（直接預託分）とし

て本所に預託されている金銭の額, FX清算参加者委託分の取引証拠金 (FX取引取次者差換預託分) として本所に預託されている金銭の額のうち当該FX取引申込者により取次証拠金として預託されている金銭の額並びにFX清算参加者委託分の取引証拠金 (差換預託分) として本所に預託されている金銭の額のうち当該FX取引申込者により取次証拠金又は委託証拠金として預託されている金銭の額及び有価証券の時価評価額の合計額 (以下この項において「FX清算参加者申込者分現預託合計額」という。) を限度として, 次の各号に掲げる者が, 当該各号に定める額に相当する部分について有するものとする。

(1) 当該FX取引申込者

FX清算参加者申込者分現預託合計額から, 当該FX取引申込者が当該顧客に対して負担する取引所FX取引に係る債務のうち未履行部分に相当する額を控除した額

(2) 当該顧客

FX清算参加者申込者分現預託合計額から, 前号に定める額及び当該顧客がFX清算参加者に対して負担する当該FX取引申込者の委託に基づく取引所FX取引に係る債務のうち未履行部分に相当する額を控除した額

(3) FX清算参加者

FX清算参加者申込者分現預託合計額から, 前2号に定める額及び当該FX清算参加者が本所に対して支払い又は引き渡すべき当該FX取引申込者の委託に基づく取引所FX取引に係る債務のうち未履行部分に相当する額を控除した額

4 第1項の規定にかかわらず, FX清算参加者の顧客がFX取引取次者である場合において本所に預託された各FX取引取次者に係るFX清算参加者委託分の取引証拠金に対する返還請求権は, 当該FX取引取次者によりFX清算参加者委託分の取引証拠金 (FX取引取次者差換預託分) として本所に預託されている金銭の額のうち当該FX取引

申込者により取次証拠金として預託されている金銭の額及び有価証券の時価評価額の合計額を超えて本所に預託された額並びにFX清算参加者委託分の取引証拠金（差換預託分）として本所に預託されている金銭の額のうち当該FX取引申込者により取次証拠金として預託されている金銭の額及び有価証券の時価評価額の合計額を超えて委託証拠金としてFX清算参加者に預託された額（以下この項において「FX清算参加者取次者分現預託合計額」という。）を限度として、次の各号に掲げる者が、当該各号に定める額に相当する部分について有するものとする。

(1) 当該顧客

FX清算参加者取次者分現預託合計額から、当該顧客がFX清算参加者に対して負担する取引所FX取引に係る債務のうち未履行部分に相当する額（前項第2号の規定により控除された額を除く。）を控除した額

(2) FX清算参加者

FX清算参加者取次者分現預託合計額から、前号に定める額及び当該FX清算参加者が本所に対して支払い又は引き渡すべき当該顧客の委託に基づく取引所FX取引に係る債務のうち未履行部分に相当する額（前項第3号の規定により控除された額を除く。）を控除した額

5 第2項の規定にかかわらず、FX非清算参加者の顧客がFX取引取次者である場合において本所に預託された場合の各FX取引申込者に係るFX非清算参加者委託分の取引証拠金に対する返還請求権は、当該FX取引申込者によりFX非清算参加者委託分の取引証拠金（直接預託分）として本所に預託されている金銭の額、FX非清算参加者委託分の取引証拠金（FX取引取次者差換預託分）として本所に預託されている金銭の額のうち当該FX取引申込者により取次証拠金として預託されている金銭の額及び有価証券の時価評価額の合計額並びにF

X 非清算参加者委託分の取引証拠金（差換預託分）として本所に預託されている金銭の額のうち当該 FX 取引申込者により取次証拠金又は委託証拠金として預託されている金銭の額及び有価証券の時価評価額の合計額（以下この項において「FX 非清算参加者申込者分現預託合計額」という。）を限度として、次の各号に掲げる者が、当該各号に定める額に相当する部分について有するものとする。

(1) 当該 FX 取引申込者

FX 非清算参加者申込者分現預託合計額から、当該 FX 取引申込者が当該顧客に対して負担する取引所 FX 取引に係る債務のうち未履行部分に相当する額を控除した額

(2) 当該顧客

FX 非清算参加者申込者分現預託合計額から、前号に定める額及び当該顧客が FX 非清算参加者に対して負担する当該 FX 取引申込者の委託に基づく取引所 FX 取引に係る債務のうち未履行部分に相当する額を控除した額

(3) FX 非清算参加者

FX 非清算参加者申込者分現預託合計額から、前 2 号に定める額及び当該 FX 非清算参加者が指定 FX 清算参加者に対して支払い又は引き渡すべき当該 FX 取引申込者の委託に基づく取引所 FX 取引に係る債務のうち未履行部分に相当する額を控除した額

(4) 指定 FX 清算参加者

FX 非清算参加者申込者分現預託合計額から、前 3 号に定める額及び当該指定 FX 清算参加者が本所に対して支払い又は引き渡すべき当該 FX 取引申込者の委託に基づく取引所 FX 取引に係る債務のうち未履行部分に相当する額を控除した額

6 第 2 項の規定にかかわらず、FX 非清算参加者の顧客が FX 取引取次者である場合において本所に預託された各 FX 取引取次者に係る FX 非清算参加者委託分の取引証拠金に対する返還請求権は、当該 FX

取引取次者により FX 非清算参加者委託分の取引証拠金（FX 取引取次者差換預託分）として本所に預託されている金銭の額のうち当該 FX 取引申込者により取次証拠金として預託されている金銭の額及び有価証券の時価評価額の合計額を超えて本所に預託された額並びに FX 非清算参加者委託分の取引証拠金（差換預託分）として本所に預託されている金銭の額のうち当該 FX 取引申込者により取次証拠金として預託されている金銭の額及び有価証券の時価評価額の合計額を超えて委託証拠金として FX 非清算参加者に預託された額（以下この項において「FX 非清算参加者取次者分現預託合計額」という。）を限度として、次の各号に掲げる者が、当該各号に定める額に相当する部分について有するものとする。

(1) 当該顧客

FX 非清算参加者取次者分現預託合計額から、当該顧客が FX 非清算参加者に対して負担する取引所 FX 取引に係る債務のうち未履行部分に相当する額（前項第 2 号の規定により控除された額を除く。）を控除した額

(2) FX 非清算参加者

FX 非清算参加者取次者分現預託合計額から、前号に定める額及び当該 FX 非清算参加者が指定 FX 清算参加者に対して支払い又は引き渡すべき当該 FX 取引申込者の委託に基づく取引所 FX 取引に係る債務のうち未履行部分に相当する額（前項第 3 号の規定により控除された額を除く。）を控除した額

(3) 指定 FX 清算参加者

FX 非清算参加者取次者分現預託合計額から、前 2 号に定める額及び当該指定 FX 清算参加者が本所に対して支払い又は引き渡すべき当該 FX 取引申込者の委託に基づく取引所 FX 取引に係る債務のうち未履行部分に相当する額（前項第 4 号の規定により控除された額を除く。）を控除した額

7 本所に預託された各 FX 清算参加者に係る FX 清算参加者自己分の取引証拠金及び FX 清算参加者委託分の取引証拠金に対する返還請求権は、 FX 清算参加者自己分の取引証拠金として本所に預託されている金銭の額、 FX 清算参加者委託分の取引証拠金（差換預託分）として本所に預託されている金銭の額のうち FX 清算参加者に委託証拠金として預託されている金銭の額及び有価証券の時価評価額の合計額を超えて本所に預託された額並びに FX 非清算参加者自己分の取引証拠金（差換預託分）のうち FX 非清算参加者が取引証拠金として差し入れた金銭の額を超えて本所に預託された額並びに FX 非清算参加者委託分の取引証拠金（差換預託分）として本所に預託されている金銭の額のうち当該 FX 非清算参加者により FX 非清算参加者証拠金として FX 清算参加者に預託されている金銭の額及び有価証券の時価評価額の合計額を超えて本所に預託された額（以下この項において「FX 清算参加者分現預託合計額」という。）を限度として、 FX 清算参加者が、 FX 清算参加者分現預託合計額から当該 FX 清算参加者が本所に対して支払い又は引き渡すべきすべての取引所 FX 取引に係る債務のうち未履行部分に相当する額（第 1 項第 2 号、第 2 項第 3 号、第 3 項第 3 号、第 4 項第 2 号、第 5 項第 4 号、第 6 項第 3 号及び次項第 2 号の規定により控除された額を除く。）を控除した額に相当する部分について、当該 FX 清算参加者が有するものとする。

8 本所に預託された各 FX 非清算参加者に係る FX 非清算参加者自己分の取引証拠金及び FX 非清算参加者委託分の取引証拠金に対する返還請求権は、 FX 非清算参加者自己分の取引証拠金（直接預託分）として本所に預託されている金銭の額、 FX 非清算参加者自己分の取引証拠金（差換預託分）として本所に預託されている金銭の額のうち当該 FX 非清算参加者により取引証拠金として FX 清算参加者に差し入れられている金銭の額及び有価証券の時価評価額の合計額、 FX 非清算参加者委託分の取引証拠金（差換預託分）として本所に預託されて

いる金銭の額のうち FX 非清算参加者に委託証拠金として預託されている金銭の額及び有価証券の時価評価額の合計額を超えて本所に預託された額並びに FX 非清算参加者委託分の取引証拠金（差換預託分）として本所に預託されている金銭の額のうち FX 非清算参加者が取引証拠金として差し入れた金銭の額を超えて FX 非清算参加者証拠金として預託された額（以下この項において「FX 非清算参加者分現預託合計額」という。）を限度として、次の各号に掲げる者が、当該各号に定める額に相当する部分について有するものとする。

(1) 当該 FX 非清算参加者

FX 非清算参加者分現預託合計額から、当該 FX 非清算参加者が指定 FX 清算参加者に対して支払い又は引き渡すべきすべての取引所 FX 取引に係る債務のうち未履行部分に相当する額（第 2 項第 2 号、第 5 項第 3 号及び第 6 項第 2 号の規定により控除された額を除く。）を控除した額

(2) 指定 FX 清算参加者

FX 非清算参加者分現預託合計額から、前号に定める額及び当該指定 FX 清算参加者が本所に対して支払い又は引き渡すべき当該 FX 非清算参加者の有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引所 FX 取引に係る債務のうち未履行部分に相当する額（第 2 項第 3 号、第 5 項第 4 号及び第 6 項第 3 号の規定により控除された額を除く。）を控除した額

9 取引証拠金の返還請求権の行使は、次の各号に定める方法によるものとする。

- (1) FX 清算参加者の有する返還請求権は、当該 FX 清算参加者が当該返還請求権の行使である旨を本所に通告し、これを行使するものとする。
- (2) FX 非清算参加者の有する返還請求権は、指定 FX 清算参加者が当該 FX 非清算参加者の代理人としてこれを行使するものとする。

- (3) FX取引参加者の顧客の有する返還請求権は、当該FX取引参加者（当該FX取引参加者がFX非清算参加者である場合には、当該FX非清算参加者及びその指定FX清算参加者）が当該顧客の代理人としてこれを行使するものとする。
- (4) FX取引申込者の有する返還請求権は、当該FX取引申込者の委託に基づく取引所FX取引を顧客から受託したFX取引参加者（当該FX取引参加者がFX非清算参加者である場合には、当該FX非清算参加者及びその指定FX清算参加者）が当該FX取引申込者の代理人としてこれを行使するものとする。

(代用有価証券)

第20条 第15条第5項及び第6項並びに第18条第1項に定める代用有価証券に関する事項は、別表に定める。

2 前項の規定のほか、証拠金の代用有価証券に関する事項については、本所が定める。

(取引証拠金所要額の申告)

第21条 FX清算参加者は、毎取引日の第5条に規定する自己分の取引証拠金所要額並びに毎取引日の次項に規定する委託分及び有価証券等清算取次ぎ分の取引証拠金所要額を、本所が定める时限までに本所に申告するものとする。

2 委託分及び有価証券等清算取次ぎ分の取引証拠金所要額は、第35条第2項に規定する各顧客の証拠金所要額及び次項の規定によりFX非清算参加者の取引証拠金所要額としてFX非清算参加者が申告した額について合計した額とする。

3 FX非清算参加者は、その指定FX清算参加者に対し、毎取引日のFX非清算参加者自己分の取引証拠金所要額及びFX非清算参加者委託分の取引証拠金所要額の合計額を、本所が定める时限までの当該指

定 FX 清算参加者が指定する时限までに当該指定 FX 清算参加者に申告するものとする。

(顧客の委託に基づく取引所 FX 取引に関する事項の報告義務)

第22条 FX 取引参加者は、顧客の委託に基づく建玉の数量その他顧客の委託に基づく取引所 FX 取引に関する事項で本所が必要と認める事項について本所から報告を求められたときは、直ちに当該事項を記載した書面を本所に提出しなければならない。

第2節 支払不能による売買停止等の場合における未決済約定の引継ぎ等

(支払不能 FX 取引参加者の自己の計算による未決済約定等の取扱い)

第23条 本所は、支払不能による売買停止等を行った場合は、支払不能による売買停止等を受けた FX 取引参加者（以下「支払不能 FX 取引参加者」という。）の自己の計算による未決済約定及び次の各号に掲げる顧客の委託に基づく未決済約定について、本所が指定する他の FX 取引参加者をして転売又は買戻し（これらの委託を含む。以下同じ。）を行わせることができるものとする。

- (1) 支払不能 FX 取引参加者に対する取引所 FX 取引に係る債務について期限の利益を喪失している顧客
- (2) 支払不能 FX 取引参加者の子会社・親会社（子会社（会社法（平成17年法律第86号）第2条第3項に規定する子会社及び FX 取引参加者が他の会社の総株主の議決権（株主総会において決議することができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含む。以下同じ。）の50パーセント以上を有している場合における当該他の会社をい

う。) 又は親会社(会社法第2条第4号に規定する親会社及び他の会社がFX取引参加者の総株主の議決権の50パーセント以上を有している場合における当該他の会社をいう。)である金融商品取引業者をいう。)のうち, 本所が次条第1項に規定する未決済約定の引継ぎを行うことが適当でないと認める顧客

- 2 前項の場合においては, 本所が指定した他のFX取引参加者と支払不能FX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。
- 3 第1項第2号の場合において, FX取引参加者の子会社が他の会社の親会社である場合における当該他の会社及び他の会社がFX取引参加者の子会社の親会社である場合における当該他の会社は, 当該FX取引参加者の子会社とみなす。
- 4 第1項第2号の場合において, 他の会社がFX取引参加者の親会社の親会社である場合における当該他の会社及びFX取引参加者の親会社が他の会社の親会社である場合における当該他の会社は, 当該FX取引参加者の親会社とみなす。

(支払不能FX取引参加者の顧客の委託に基づく未決済約定の取扱い)

第24条 本所は, 支払不能による売買停止等を行った場合は, 支払不能FX取引参加者の顧客(前条第1項各号に掲げる顧客を除く。以下この条及び次条において同じ。)の委託に基づく未決済約定について, 本所が指定する他のFX取引参加者への引継ぎ又は本所が指定する他のFX取引参加者をして転売若しくは買戻しを行わせることができるものとする。

- 2 本所が前項の他のFX取引参加者への未決済約定の引継ぎ(以下の節及び第3章第2節において「売買停止等時の建玉の移管」という。)又は他のFX取引参加者をして未決済約定の転売若しくは買戻しを行わせることとした場合には, 支払不能FX取引参加者は, 支払不能による売買停止等を受けた後, 直ちに顧客に対して当該支払不能による

売買停止等を受けた旨その他本所が必要と認める事項を通知しなければならない。

(支払不能 FX 取引参加者の顧客の委託に基づく未決済約定の引継ぎ等)

第25条 前条第1項に規定する売買停止等時の建玉の移管は、支払不能 FX 取引参加者の顧客が当該売買停止等時の建玉の移管について本所が指定する他の FX 取引参加者に申し込み、かつ、当該他の FX 取引参加者が本所が定める日時までに、当該申込みを受けた旨及び当該売買停止等時の建玉の移管について承諾した旨を証する書面を本所に提出した場合に行わせるものとする。

- 2 前項の場合において、本所は、支払不能 FX 取引参加者に対し、当該売買停止等時の建玉の移管を行うために本所が必要と認めた事項を記載した書面の提出を求めることができるものとし、当該売買停止等時の建玉の移管を受ける他の FX 取引参加者に対し、当該書面を交付するものとする。
- 3 取引所 FX 取引に係る建玉の移管は、当該建玉の移管を行う取引日の前取引日における清算数値を当該未決済約定に係る約定数値として行うものとする。
- 4 前条第1項に規定する支払不能 FX 取引参加者の顧客の委託に基づく未決済約定の転売又は買戻し（次項の場合を除く。）は、支払不能 FX 取引参加者が、当該支払不能 FX 取引参加者の顧客の委託に基づく未決済約定について当該顧客から転売又は買戻しに係る指示を受けた旨を証する書面を本所が定める日時までに本所に提出した場合に、本所が指定する他の FX 取引参加者をして行わせるものとする。
- 5 本所は、前条第1項の支払不能 FX 取引参加者の顧客の委託に基づく未決済約定について、本所が定める日時までに第1項又は前項に規定する書面が提出されなかった場合には、本所が指定する他の FX 取

引参加者をして転売又は買戻しを行わせることができる。

6 前2項の場合においては、他のFX取引参加者と支払不能FX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FX取引参加者の委託分の取引証拠金の取扱い)

第26条 第24条第1項の規定により売買停止等時の建玉の移管を行った場合（移管を受けた当該他のFX取引参加者を以下この節及び第3章第2節において「売買停止等時の移管先FX取引参加者」という。）には、当該顧客が返還請求権を有する委託分の取引証拠金について、当該売買停止等時の建玉の移管が行われた日に当該売買停止等時の移管先FX取引参加者（当該売買停止等時の移管先FX取引参加者がFX非清算参加者である場合には、当該売買停止等時の移管先FX取引参加者及びその指定FX清算参加者）を代理人として本所に預託したものとみなす。

(指定FX清算参加者が支払不能等により債務の引受けの停止を受けた場合におけるFX非清算参加者に対する措置)

第27条 第23条(第1項第2号を除く。), 第24条から前条までの規定は、指定FX清算参加者が業務方法書第68条第5項の規定により債務の引受けの停止を受けたことによって取引参加者規程第48条の規定により有価証券等清算取次ぎの委託の停止を行った場合について準用する。この場合において「支払不能による売買停止等」とあるのは、「指定FX清算参加者が支払不能等により債務の引受けの停止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」と、「支払不能FX取引参加者」とあるのは「FX清算参加者が支払不能等により債務の引受けの停止を受けた場合におけるFX非清算参加者」と読み替えるものとする。

2 指定FX清算参加者が業務方法書第68条第5項の規定により債務の

引受けの停止を受けたことにより取引参加者規程第48条の規定により有価証券等清算取次ぎの委託の停止を受けたFX非清算参加者に対する措置として、当該FX非清算参加者の未決済約定について、本所が指定する他のFX取引参加者への引継ぎ又は本所が指定する他のFX取引参加者をして転売若しくは買戻しを行わせる場合には、第19条第9項第2号の指定FX清算参加者の代理権は消滅するものとする。

(委託分の取引証拠金に係る返還請求権の特例)

第28条 第26条の規定により売買停止等時の移管先FX取引参加者（当該売買停止等時の移管先FX取引参加者がFX非清算参加者である場合には、当該FX非清算参加者及びその指定FX清算参加者）が預託したものとみなされる委託分の取引証拠金に係る顧客の返還請求権は、第42条の規定により当該顧客が差し入れたものとみなされる証拠金を限度とするものとし、当該返還請求権は、当該売買停止等時の移管先FX取引参加者（当該売買停止等時の移管先FX取引参加者がFX非清算参加者である場合には、当該FX非清算参加者及びその指定FX清算参加者）が代理人としてこれを行使するものとする。

- 2 本所が第23条第1項若しくは第24条第1項の規定（第27条第1項において準用する場合を含む。）により支払不能FX取引参加者（第27条第1項において準用する場合にあっては、指定FX清算参加者が支払不能等によって債務の引受けの停止を受けた場合におけるFX非清算参加者をいう。以下次条までにおいて同じ。）の顧客の委託に基づく未決済約定について転売若しくは買戻しを行わせることとした場合又は第24条第1項の規定（第27条第1項において準用する場合を含む。）により支払不能FX取引参加者の顧客の売買停止等時の建玉の移管を行わせることとした場合には、支払不能FX取引参加者の顧客（第24条第1項の規定（第27条第1項において準用する場合を含む。）により売買停止等時の建玉の移管を行った顧客を除く。）に係る委託分の取引

証拠金の返還請求権は、本所に対し直接行使することができるものとする。この場合において、当該顧客に係る委託分の取引証拠金が委託差換預託分の取引証拠金として預託されているときは、第42条第2項に定める額を限度とするものとする。

(FX取引取次者に係る委託分の取引証拠金に係る返還請求権の特例)

第29条 本所が第23条第1項の規定（第27条第1項において準用する場合を含む。）により支払不能FX取引参加者の顧客のFX取引申込者の委託の取次ぎに基づく未決済約定について転売又は買戻しを行わせることとした場合において、FX取引取次者が同項各号に掲げる顧客であるときは、当該FX取引取次者のFX取引申込者は、第44条第1項に定める日以後に、当該FX取引取次者が第23条第1項各号に掲げる顧客である旨及び当該FX取引申込者が有する返還請求権の額を本所に通告し、本所に対し委託分の取引証拠金の返還請求権の直接行使に関する承諾を求めるものとする。

- 2 前項の場合において、本所は、支払不能FX取引参加者に対し本所が必要と認める書面の提出を求ることにより、当該通告事項の内容を確認するものとする。
- 3 本所は、前項の確認を行った場合は、当該返還請求権の直接行使に関する承諾を行うものとする。
- 4 第1項の場合において、当該FX取引申込者に係る委託分の取引証拠金（当該FX取引申込者からの直接預託分の取引証拠金として本所に預託されているものを除く。）に対する返還請求権は、次の各号に掲げる額のうちいづれか小さい額を限度とするものとする。
 - (1) 顧客のFX取引申込者が顧客に取次証拠金として又は支払不能FX取引参加者に委託証拠金として預託した金銭の額及び有価証券の時価評価額（本所が支払不能による売買停止等を行った日の前日における時価により評価した額（当該有価証券がアメリカ合衆国財務

省証券である場合には、その時価を当該支払不能による売買停止等を行った日の前日における東京外国為替市場の対顧客直物電信買相場の1米ドル当たりの円貨額により円貨を換算した額)をいう。以下この項及び第42条第2項において同じ。)の合計額に相当する額

(2) 当該顧客が本所に預託している取引証拠金(FX取引取次者差換預託分)を、当該顧客の各FX取引申込者が当該顧客に取次証拠金として預託した又は委託証拠金として預託した金銭の額及び有価証券の時価評価額の合計額に相当する額に応じてあん分した額

(移管された建玉に係る取引証拠金の返戻等)

第30条 売買停止等時の移管先FX取引参加者は、第26条の規定(第27条第1項において準用する場合を含む。)により預託したものとみなされた取引証拠金の返戻を受けようとする場合は、本所が必要と認める事項を本所に申告しなければならない。

(未決済約定の引継ぎ等に伴うその他の取扱い)

第31条 第23条から前条までに定めるもののほか、未決済約定の引継ぎ等に必要な事項は、本所がその都度定める。

第3章 受託契約準則の特例関係

第1節 証拠金等

(証拠金の差入れ又は預託)

第32条 顧客は、当該顧客の委託に基づく取引所FX取引の売付け又は買付けが成立した場合において、受入証拠金の総額(第35条第1項に規定する受入証拠金の総額をいう。以下同じ。)が証拠金所要額(同条第2項に規定する証拠金所要額をいう。以下同じ。)を下回っていると

き又は当該顧客が証拠金として差し入れている金銭の額が顧客の現金支払予定額（同条第4項に規定する顧客の現金授受予定額のうち、当該顧客が支払うべき金額をいう。以下同じ。）を下回っているときは、受入証拠金の総額と証拠金所要額との差額（以下「証拠金不足額」という。）又は当該顧客が証拠金として差し入れ又は預託している金銭の額と当該顧客の現金支払予定額との差額（以下「現金不足額」という。）のいずれか大きい額以上の額を証拠金として、当該不足額が発生した日（休業日に当たるときは順次繰り下げる。次条において同じ。）の翌日（当該顧客が非居住者である場合は、当該不足額が発生した日から起算して3日目（休業日を除外する。以下日数計算において同じ。）の日）までのFX取引参加者が指定する日時までに、FX取引参加者に差し入れ又は預託するものとする。

2 顧客が預託する証拠金は、有価証券をもって代用することができる。ただし、現金不足額に相当する額の証拠金は、有価証券をもって代用することができないものとする。

（証拠金の追加差入れ又は追加預託）

第33条 FX取引参加者は、顧客に証拠金不足額又は現金不足額が生じた場合には、いずれか大きい額以上の額を証拠金として、当該顧客から当該不足額が発生した日の翌日（当該顧客が非居住者である場合は、当該不足額が発生した日から起算して3日目の日）までのFX取引参加者が指定する日時までに差し入れ又は預託させなければならない。この場合において、現金不足額に相当する額の証拠金は、有価証券をもって代用させることができないものとする。

（証拠金の区分）

第34条 前2条の規定に基づき顧客がFX取引参加者に差し入れ又は預託した証拠金については、当該顧客が取引証拠金として差し入れたも

のとする。ただし、当該顧客の同意（金融商品取引所等に関する内閣府令（平成19年内閣府令第54号）第66条に規定する同意をいう。）がある場合には、委託証拠金として預託したものとすることができる。

- 2 前項の場合において、顧客がFX取引取次者であるときは、当該顧客が取引証拠金として差し入れる金銭又は委託証拠金として預託する金銭若しくは有価証券が次の各号に掲げる区分のいずれに該当するかを明示するものとする。
 - (1) FX取引申込者が差し入れた金銭
 - (2) FX取引申込者が預託した金銭又は有価証券に代えて、当該顧客が差し入れた自己の保有する金銭又は預託した自己の保有する金銭若しくは有価証券

(受入証拠金の総額等の計算方法)

第35条 受入証拠金の総額は、取引所FX取引口座において当該顧客が証拠金として差し入れている金銭の額又は預託している金銭の額及び有価証券を代用価格（計算する日の前日における時価に次条第1項において準用する別表第2項に定める率を乗じた額（アメリカ合衆国財務省証券については、その時価に同項に定める率を乗じた額を当該計算する日の前日における東京外国為替市場の対顧客直物電信買相場の1米ドル当たりの円貨額により円貨に換算した額）を超えない額をいう。）により評価した額の合計額に、第4項に規定する当該顧客の現金授受予定額を加減して得た額をいう。

- 2 証拠金所要額は、取引所FX取引の当該顧客の委託に基づく建玉について、売建玉の数量と買建玉の数量のうち多い方の数量に証拠金基準額を乗じて得た額とする。
- 3 計算上の損益額は、当該顧客の委託に基づく取引所FX取引のロールオーバーにより発生する損益に相当する額（当該顧客の建玉について、業務方法書第63条の4から第63条の6までに規定する金銭の額の

合計額をいう。)の合計額及び第38条の規定により払出しを行った場合の当該払出額の合計額を差し引いて得た損益額とする。

4 顧客の現金授受予定額は、計算する日における前項に規定する計算上の損益額に、顧客の委託に基づく取引所FX取引の決済損益額のうち当該顧客との間で授受を終了していないものを加減した額から当該顧客の負担すべき額でFX取引参加者が必要と認める額を減じて得た額に相当する金銭の額とする。

(委託証拠金の有価証券による代用)

第36条 第20条の規定は、第32条第2項の規定により有価証券をもって代用する場合に準用する。この場合において、別表第1項中「本所の定める率を乗じた額」とあるのは「本所の定める率を乗じた額を超えない額」と読み替えるものとする。

2 顧客が次の各号に掲げる有価証券を預託する場合には、社債、株式等の振替に関する法律(平成13年法律第75号。以下「振替法」という。)に基づく口座の振替により当該預託を行うものとし、当該預託を行うときは、あらかじめFX取引参加者の同意を得るものとする。

(1) 株券(外国株券を除く。)、優先出資証券、投資信託の受益証券、受益証券発行信託の受益証券、債券(新株予約権付社債券を除く。)及び転換社債型新株予約権付社債券

(2) 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

3 顧客が外国株券、外国株預託証券、外国投資信託の受益証券、外国投資証券又は外国受益証券発行信託の受益証券を預託する場合には、株式会社証券保管振替機構(以下「保管振替機構」という。)が定める「外国株券等の保管及び振替決済に関する規則」に規定する口座の振替により当該預託を行うものとし、当該預託を行うときは、あらかじめFX取引参加者の同意を得るものとする。

4 顧客がアメリカ合衆国財務省証券を預託する場合には、あらかじめ

FX取引参加者の同意を得るものとする。

(証拠金の引出しの制限)

第37条 FX取引参加者は、顧客から取引証拠金として差し入れられた金銭若しくは委託証拠金として預託されている金銭又は有価証券を引き出させてはならない。ただし、次の各号のいずれかに該当する場合において、当該各号に掲げる額を超えない額に相当する金銭又は有価証券については、この限りでない。

- (1) 引き出させる際に当該顧客の受入証拠金の総額が証拠金所要額を上回っている場合には、その超過額を別表第2項に定める率をもって除した額（アメリカ合衆国財務省証券については、当該超過額を東京外国為替市場の対顧客直物電信売相場の1米ドル当たりの円貨額により米貨に換算した額を同項に定める率をもって除した額をいう。次号において同じ。）に相当する有価証券又は当該超過額と現金超過額（証拠金として差し入れられ又は預託されている金銭の額が当該顧客の現金支払予定額を超えている場合の当該超過額をいう。以下同じ。）のいずれか小さい額に相当する額の金銭
- (2) 当該顧客が委託証拠金として預託している有価証券を金銭又は他の有価証券と差し換える場合には、当該金銭の額又は当該他の有価証券の額（第35条第1項に規定する代用価格により評価した額をいう。以下この項において同じ。）を別表第2項に定める率をもって除した額に相当する有価証券
- (3) 当該顧客が証拠金として預託している金銭のうち現金超過額に相当する金銭を有価証券と差し換える場合には、当該有価証券の額に相当する金銭

(計算上の利益額の払出し)

第38条 FX取引参加者は、顧客の請求に応じ、当該顧客の計算上の利

益額に相当する金銭を払い出すことができる。

- 2 前項の払出しは、当該顧客の受入証拠金の総額が証拠金所要額を上回っているときの差額を限度とする。

第2節 支払不能による売買停止等の場合における未決済約定の引継ぎ等

(支払不能 FX取引参加者による通知)

第39条 本所が第23条第1項若しくは第24条第1項の規定（第27条第1項において準用する場合を含む。）により他のFX取引参加者をして未決済約定の転売若しくは買戻しを行わせることとした場合又は第24条第1項の規定（第27条第1項において準用する場合を含む。）により売買停止等時の建玉の移管を行わせることとした場合には、支払不能FX取引参加者（指定FX清算参加者が支払不能等により債務の引受けの停止を受けた場合におけるFX非清算参加者を含む。）は、支払不能による売買停止等（指定FX清算参加者が支払不能等により債務の引受けの停止を受けたことによるFX非清算参加者の有価証券等清算取次ぎの委託の停止を含む。）を受けた後、直ちに顧客に対してその旨その他本所が必要と認める事項を通知しなければならない。

- 2 前項の通知を受けた顧客がFX取引取次者である場合は、当該顧客は、そのFX取引申込者に対して当該通知に準じた事項を通知しなければならない。

(顧客の建玉の移管に係る手続き)

第40条 顧客（第23条第1項各号に掲げる顧客を除く。以下この条及び次条において同じ。）は、前条第1項に規定する通知を受けた場合において、売買停止等時の建玉の移管を希望するときは、本所が指定した他のFX取引参加者のうち一の者に売買停止等時の建玉の移管につい

て申し込み、本所が定める日時までにその承諾を受けなければならぬ。

- 2 前項の売買停止等時の建玉の移管についての承諾を受けた顧客は、取引所FX取引特例の規定により売買停止等時の移管先FX取引参加者に取引所FX取引口座を設定するものとする。ただし、現に当該売買停止等時の移管先FX取引参加者に取引所FX取引口座を設定している場合は、この限りでない。
- 3 取引所FX取引に係る建玉の移管は、当該建玉の移管を行う取引日の前取引日における清算数値を当該未決済約定に係る約定数値として行うものとする。

(顧客の転売又は買戻しに係る手続き)

第41条 顧客は、第39条第1項の通知を受けた場合において、未決済約定について転売又は買戻しを希望するときは、本所が定める日時までに、支払不能FX取引参加者（指定FX清算参加者が支払不能等により債務の引受けの停止を受けた場合においてはFX非清算参加者）にその旨を指示するものとする。

(証拠金の特例)

第42条 第40条第1項の売買停止等時の建玉の移管が行われた場合は、顧客は、支払不能FX取引参加者（指定FX清算参加者が支払不能等により債務の引受けの停止を受けた場合においてはFX非清算参加者。以下この条において同じ。）が本所に預託していた当該顧客に係る委託分の取引証拠金（第19条の規定により当該顧客又はそのFX取引申込者が返還請求権を有する部分に限る。次項において同じ。）を、取引証拠金として売買停止等時の移管先FX取引参加者に差し入れ又は預託したものとみなす。

- 2 前項の場合において、顧客に係る委託差換預託分の取引証拠金とし

て預託されているものについては、顧客が支払不能 FX 取引参加者に委託証拠金として預託した金銭の額及び有価証券の時価評価額の合計額（支払不能 FX 取引参加者が当該顧客から差し入れられた取引証拠金を本所に預託するまでの間における当該取引証拠金に係る金銭の額及び有価証券の時価評価額の合計額を含む。）に相当する額を、取引証拠金として差し入れ又は預託したものとみなす。

（証拠金の返還の特例）

第43条 売買停止等時の移管先 FX 取引参加者は、第40条第1項の売買停止等時の建玉の移管が行われた場合において、その日以後に顧客から前条第2項に規定する取引証拠金の返還請求を受けたときは、金銭により返還するものとする。

（取引証拠金の返還の特例）

第44条 顧客は、第28条第2項の規定により委託分の取引証拠金の返還請求権を本所に対し直接行使する場合は、当該顧客の委託に基づく未決済約定について、転売又は買戻しが行われた日以後において、本所が必要と認める事項を本所に申告することにより行うものとする。

2 前項の場合において、当該顧客に係る委託差換預託分の取引証拠金として預託されているものの返還請求を受けたときは、本所は金銭により返還するものとする。

第3節 顧客と FX 取引申込者との契約

（顧客と FX 取引申込者との契約）

第45条 顧客が FX 取引取次者である場合は、あらかじめ、顧客はその FX 取引申込者との間でこの規則に定める事項に準じた内容の契約を締結するものとする。

第4章 雜則

(有価証券等清算取次ぎに対する適用)

第46条 取引所FX取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託の取次ぎについては、有価証券等清算取次ぎを委託したFX取引参加者を当該取引所FX取引の取次ぎを行う者とみなして、第3条、第2章及び第3章の規定を適用する。

(証拠金及び未決済約定の引継ぎ等に関する必要事項の決定)

第47条 本所は、この規則に定める事項のほか、取引所FX取引に係る証拠金及び未決済約定の引継ぎ等につい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。

付 則

この規則は、平成21年6月16日から施行する。

付 則

この規則は、平成21年9月28日から施行する。

付 則

この規則は、平成22年7月1日から施行する。

付 則

この規則は、平成22年8月1日から施行する。

付 則

この規則は、平成23年2月28日から施行する。ただし、別表第2項（注）4の改正規定は、同年1月1日から施行する。

付 則

この規則は、平成24年1月30日から施行する。

付 則

この規則は、平成25年1月1日から施行する。

別表

代用有価証券の種類及びその代用価格等に関する表

- 1 第20条（第36条において準用する場合を含む。）の有価証券の代用価格は、当該有価証券の預託日の前々日（休業日に当たるときは、順次繰り上げる。）における時価に本所の定める率を乗じた額（第36条において準用する場合にあっては、本所の定める率を乗じた額を超えない額）とする。ただし、本所は、業務方法書第28条第3項の規定により、代用価格を変更することができる。
- 2 前項の有価証券の種類、時価及び本所の定める率は以下のとおりとする。

有価証券の種類	時価	時価に乘すべき率
日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの	当該売買参考統計値のうち平均値	(1) 国債証券（変動利付国債、分離元本振替国債及び分離利息振替国債を除く。) a 残存期間1年以内のもの 100分の99 b 残存期間1年超5年以内のもの 100分の99 c 残存期間5年超10年以内のもの 100分の97 d 残存期間10年超20年以内のもの 100分の97 e 残存期間20年超30年以内のもの 100分の95 f 残存期間30年超のもの 100分の95 (2) 変動利付国債
国債証券	売買参考統計値が発表されていないもののうち国内の金融商品取引所において上場されているもの	金融商品取引所（注1）における最終価格（注2）

		<p>a 残存期間 1 年以内のもの 100 分の 98</p> <p>b 残存期間 1 年超 5 年以内のもの 100 分の 98</p> <p>c 残存期間 5 年超 10 年以内のもの 100 分の 96</p> <p>d 残存期間 10 年超 20 年以内のもの 100 分の 96</p> <p>(3) 分離元本振替国債及び分離利息振替国債</p> <p>a 残存期間 1 年以内のもの 100 分の 98</p> <p>b 残存期間 1 年超 5 年以内のもの 100 分の 98</p> <p>c 残存期間 5 年超 10 年以内のもの 100 分の 96</p> <p>d 残存期間 10 年超 20 年以内のもの 100 分の 96</p> <p>e 残存期間 20 年超 30 年以内のもの 100 分の 93</p> <p>f 残存期間 30 年超のもの 100 分の 92</p>	
政府保証債券	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの	当該売買参考統計値のうち平均値	(1) 残存期間 1 年以内のもの

金融商品取引法施行令第2条の11に定める債券である円貨債券（注3）	売買参考統計値が発表されていないもののうち国内の金融商品取引所において上場されているもの	金融商品取引所（注1）における最終価格（注2）	100分の98 (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の98 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の96 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の96 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の94 (6) 残存期間30年超のもの 100分の94
アメリカ合衆国財務省証券	ニューヨーク市場における前日の最終の気配相場		(1) 残存期間1年以内のもの 100分の85 (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の85 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の85 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の84 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の83 (6) 残存期間30年超のもの 100分の83
地方債証券（注3）	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの	当該売買参考統計値のうち平均値	(1) 残存期間1年以内のもの 100分の98

	売買参考統計値が発表されていないもののうち国内の金融商品取引所において上場されているもの	金融商品取引所(注1)における最終価格(注2)	(2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の98 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の96 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の96 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の94 (6) 残存期間30年超のもの 100分の94
特殊債券(政府保証債券を除く。) (注4)	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの	当該売買参考統計値のうち平均値	(1) 残存期間1年以内のもの 100分の97 (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の97 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の95 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の95 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の93 (6) 残存期間30年超のもの 100分の93
社債券(新株予約権付社債券及び交換社債券を除く。) (注3) (注4)	売買参考統計値が発表されていないもののうち国内の金融商品取引所において上場されているもの	金融商品取引所(注1)における最終価格(注2)	(1) 残存期間1年以内のもの 100分の83 (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の83 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の81 (4) 残存期間10年超20年以内のもの
円貨建外国債券(金融商品取引法施行令第2条の11に定める債券である円貨債券、転換社債型新株予約権付社債券及び交換社債券を除く。) (注3)(注4)	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの	当該売買参考統計値のうち平均値	

	もの		100 分の 81 (5) 残存期間 20 年超 30 年以内のもの 100 分の 79 (6) 残存期間 30 年超 のもの 100 分の 79
公社債投資信託の受益証券	社団法人投資信託協会が前日の時価を発表するもの	当該時価	100 分の 85
転換社債型新株予約権付社債券 (注 3) (注 5) 交換社債券 (注 3) (注 6)	国内の金融商品取引所に上場されているもの	金融商品取引所(注 1)における最終価格(注 2)	100 分の 80
株券 優先出資証券 外国株預託証券 外国投資信託の受益証券 外国投資証券 受益証券発行信託の受益証券 外国受益証券発行信託の受益証券	国内の金融商品取引所に上場されているもの	金融商品取引所(注 1)における最終価格(注 2)	100 分の 70
投資信託の受益証券(公社債投資信託の受益証券を除く。) 投資証券	国内の金融商品取引所に上場されているもの 社団法人投資信託協会が前日の時価を発表するもの	金融商品取引所(注 1)における最終価格(注 2) 当該時価	100 分の 70

(注) 1 複数の金融商品取引所に上場している銘柄については、本所が定める順位により選択した金融商品取引所とする。

- 2 最終価格については、当該金融商品取引所において気配表示が行われている場合は当該最終気配値段をいう。
 - 3 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。
 - 4 特殊債券（政府保証債券を除く。）、社債券（新株予約権付社債券及び交換社債券を除く。）及び円貨建外国債券（金融商品取引法施行令（昭和40年政令第321号）第2条の11に定める債券である円貨債券、転換社債型新株予約権付社債券及び交換社債券を除く。）については、適格格付機関（金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第2条第36項に規定する信用格付業者及び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116条の3第2項に規定する特定関係法人をいう。）から取得している格付がすべてA格相当以上であること等、発行企業の信用力その他の事情を勘案して、本所が適当と認めるものに限る。
 - 5 転換社債型新株予約権付社債券については、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ものに限る。
 - 6 交換社債券とは、社債券（外国法人により発行されるものを含む。）であって、それを保有する者の請求により発行者以外の特定の会社の株券により償還されるものをいう。
- 3 前項の規定における本所が定める順位は、第一順位は、本所とし、それ以降は、取引所・業界団体等コード（証券コード協議会の定めるものをいう。）の順序とする。ただし、国債証券にあっては、取引所・業界団体等コード（証券コード協議会の定めるものをいう。）の順序とする。