

## 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 関する規則の取扱い

### (目的)

第1条 この規則は、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。)に基づき、本所が定める事項に関し、必要な事項を定める。

### (金銭の取扱い)

第2条 清算参加者が、証拠金規則第5条から第10条まで(第6条及び第9条を除き、証拠金規則第10条第3項から第7項までにおいて準用する場合を含む。)に規定する取引証拠金を金銭により本所に預託する場合には、清算参加者は、本所が指定する銀行のうちから当該清算参加者が選定した銀行に設けられた本所名義の口座への振込みにより当該預託を行うものとする。

2 本所に取引証拠金として預託されている金銭の清算参加者への返戻は、本所が本所名義の口座から当該清算参加者名義の口座への振込みにより行うものとする。

### (清算価格を定める場合の時間帯)

第3条 証拠金規則第6条第2項第1号に規定する本所が定める時間帯は、午後3時から個別証券オプション特例第10条第1項に規定する立会の終了時又は指數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7条第1項第1号に規定

する日中立会の終了時までとする。

( 人的分割による権利落後始値が決定した日の個別証券オプションの本質的価値 )

第4条 証拠金規則第6条第3項第1号かっこ書に規定する本所が定める値段は、人的分割に係る権利落の期日の前日（休業日に当たるときは、順次繰り上げる。以下同じ。）のオプション対象証券の最終値段（当該個別証券オプションに係る指定市場（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。）第7条第2項に規定する指定市場をいう。）における当該オプション対象証券の最終の約定値段（当該指定市場を開設する金融商品取引所が定めるところにより気配表示（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の施行規則第4条の2第1項に規定する気配表示をいう。）された最終気配値段を含む。）をいう。その日に当該約定値段がない場合には、本所がその都度定める値段とする。この項において同じ。）を証拠金規則第6条第3項第1号に規定する人的分割による権利落後始値で除して得た数値に、人的分割による権利落後始値決定日における最終値段を乗じて得た値段（円位未満の端数が生じたときはこれを四捨五入する。）とする。

( 緊急取引証拠金を預託する場合等 )

第5条 証拠金規則第12条第1項に規定する本所が定める基準は、Large取引のうち本所が定める限月取引について、午前11

時における立会による直前の約定数値と前取引日の清算数値との差が、本所があらかじめ定めた数値を超えた場合とする。

2 証拠金規則第13条第1号、第2号a及び第3号並びに第14条第3項及び第4項に規定する本所が定める時間は、午前11時とする。

(緊急清算数値等を定める場合の時間帯)

第6条 証拠金規則第14条第2項第1号において準用する業務方法書第48条第2項ただし書及び証拠金規則第14条第2項第2号aにおいて準用する同第6条第2項第1号に規定する本所が定める時間帯は、午前10時45分から11時までとする。

(緊急清算数値を定める場合の理論価格)

第7条 証拠金規則第14条第2項第1号において準用する業務方法書第48条第2項の理論価格は、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の施行規則別表2「理論価格算出に関する表」により算出するものとする。

(本所が定める数値)

第8条 証拠金規則第14条第2項第1号ただし書に規定する本所が定める数値は、次の各号に定める数値とする。

(1) 主たる取引所金融商品市場（取引対象指数の算出者が当該取引対象指数の算出のために価格を採用してい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又は市場デリバティブ取引がその立会開始時から午前11時まで停止された場合において本所が必要と認める場合は、本所がその

### 都度定める数値

(2) 前号以外の場合は、その日の午前11時における直前の取引対象指数（NYダウを対象とする指数先物取引については、本所がその都度定める数値）

（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の申告）

第9条 証拠金規則第17条第2項及び第4項に規定する本所が定める时限は、当日の午後6時とする。

（建玉の移管の申請时限等）

第9条の2 証拠金規則第18条の3第1項に規定する本所が定める时限は、午後2時とする。

2 証拠金規則第18条の3第2項に規定する本所が定める时刻は、午後3時とする。

（端数金額の調整）

第10条 証拠金規則別表第2項に掲げる有価証券について、当該差入日又は預託日の前々日における時価に同項に掲げる率を乗じた場合の端数金額の調整は次のとおりとする。

(1) 株券、優先出資証券、外国株預託証券、投資信託の受益証券、外国投資信託の受益証券、投資証券、外国投資証券、受益証券発行信託の受益証券及び外国受益証券発行信託の受益証券については、円位未満の端数金額は、これを切り捨てる。

(2) 前号に規定する有価証券以外の有価証券については、銭位未満の端数金額は、これを切り捨てる。

(国債証券の取扱い)

第11条 清算参加者が、証拠金規則別表第2項に規定する国債証券を本所に預託する場合には、日本銀行に設けられた本所名義の口座への振替により当該預託を行うものとする。

2 非清算参加者が、証拠金規則別表第2項に規定する国債証券を指定清算参加者に取引証拠金の代用有価証券として差し入れ又は非清算参加者証拠金の代用有価証券として預託する場合には、口座の振替により当該差入れ又は預託を行うものとし、当該差入れ又は預託を行うときは、あらかじめ指定清算参加者の同意を得るものとする。

(株券等の取扱い)

第11条の2 清算参加者が、次の各号に掲げる有価証券を本所に預託する場合には、株式会社証券保管振替機構（以下「保管振替機構」という。）に開設された本所名義の口座への振替により当該預託を行うものとする。

- (1) 証拠金規則別表第2項に規定する株券（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（国債証券及び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) 証拠金規則別表第2項に規定する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) 外国株券、外国株預託証券、外国投資信託の受益証券、外国投資証券及び外国受益証券発行信託の受益証券
- 2 非清算参加者が、前項第1号及び第2号に掲げる有価証券を

指定清算参加者に差し入れる場合には、口座の振替により当該差入れを行うものとし、当該差入れを行うときは、あらかじめ指定清算参加者の同意を得るものとする。

3 非清算参加者が、第1項第3号に掲げる有価証券を指定清算参加者に差し入れる場合には、保管振替機構が定める「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差入れを行うものとし、当該差入れを行うときは、あらかじめ指定清算参加者の同意を得るものとする。

4 本所は、次の各号に掲げる預託有価証券に係る保管振替機構に対する報告を預託元の清算参加者に委託し、当該委託を受けた清算参加者は保管振替機構に対し当該報告を行うものとする。この場合において、当該委託を受けた清算参加者は他の者をして当該報告を行わせることができる。

- (1) 内国法人の発行する株券に係る特別株主管理事務委託状況の報告
- (2) 優先出資証券に係る特別優先出資者管理事務委託状況の報告
- (3) 投資証券に係る特別投資主管理事務委託状況の報告
- (4) 受益証券発行信託の受益証券に係る特別受益者管理事務委託状況の報告
- (5) 投資信託の受益証券に係る特別受益者管理事務委託状況の報告

(アメリカ合衆国財務省証券の取扱い)

第12条 清算参加者が、証拠金規則別表第2項に規定するアメリカ合衆国財務省証券（以下「財務省証券」という。）を本所に

預託する場合には、預託の都度、本所の同意を得るものとする。

- 2 清算参加者が、前項の規定に基づき財務省証券を預託する場合には、預託しようとする財務省証券について、先物・オプション取引の取引証拠金代用有価証券を保有するためにアメリカ合衆国ニューヨーク州ニューヨーク市に所在する銀行に設けられた本所名義の口座に、預託日の前日のアメリカ合衆国東部時間の午後2時までに振替を行うものとし、当該口座振替を行う日の午後4時までに、その旨を本所に通知するものとする。この場合における口座振替（同一銀行内の口座振替を除く。）は、アメリカ合衆国のFederal Reserve Communications Systemを通じて行うものとする。
- 3 清算参加者が、取引証拠金代用有価証券として預託している財務省証券の返戻を求める場合には、当該返戻を受けようとする日の正午までに、その旨を本所に通知するものとする。
- 4 非清算参加者が、証拠金規則別表第2項に規定する財務省証券を指定清算参加者に取引証拠金の代用有価証券として差し入れ又は非清算参加者証拠金の代用有価証券として預託する場合には、あらかじめ指定清算参加者の同意を得るものとする。

（代用有価証券からの除外）

第13条 国内の金融商品取引所に上場されている株券（優先出資証券、外国株預託証券、投資信託の受益証券、外国投資信託の受益証券、投資証券、外国投資証券、受益証券発行信託の受益証券及び外国受益証券発行信託の受益証券を含む。以下同じ。）が、その上場されている国内のすべての金融商品取引所において、当該金融商品取引所の定める上場廃止の基準に該当した場

合（次の各号に掲げる場合を除く。）には、該当した日の翌日（休業日に当たるときは、順次繰り下げる。以下同じ。）から、当該株券及び当該株券（当該外国株預託証券、投資信託の受益証券、外国投資信託の受益証券、受益証券発行信託の受益証券及び外国受益証券発行信託の受益証券を除く。）の発行者が発行する社債券を、取引証拠金、委託証拠金及び取次証拠金の代用有価証券から除外する。

- (1) 当該株券の発行者が株式交換又は株式移転により国内の金融商品取引所に株券が上場されている会社（以下「上場会社」という。）の完全子会社となる場合
  - (2) 当該株券の発行者が上場会社に吸収合併される場合
  - (3) その他当該株券が上場廃止となる場合であって当該株券と引換えに交付される株券が国内の金融商品取引所に速やかに上場される見込みがあるとき。
- 2 前項の規定は、取引証拠金の代用有価証券である債券の発行者が当該債券の期限の利益を喪失した場合の当該債券について準用する。

#### 付 則

- 1 この取扱いは、平成15年1月14日から施行する。
- 2 商法等の一部を改正する法律（平成13年法律第128号）附則第7条第1項の規定によりなお従前の例によるとされた転換社債又は新株引受権付社債は、それぞれ、転換社債型新株予約権付社債又は転換社債型新株予約権付社債以外の新株予約権付社債とみなして、この取扱いを適用する。

付 則

この取扱いは、平成15年1月27日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成16年9月10日から施行する。

付 則

1 この取扱いは、平成16年10月1日から施行する。

2 清算参加者又は非清算参加者は、平成16年12月30日までに、この改正規定施行の際現に本券により取引証拠金の代用有価証券として差し入れている有価証券（証拠金規則別表第2項に規定する国債証券及び改正後の第11条の2第1項各号に掲げる有価証券をいう。）の返戻を受けるものとする。

付 則

この取扱いは、本所が定める日から施行する。

（注）「本所が定める日」は平成16年12月13日

付 則

この取扱いは、平成17年4月25日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成17年12月19日から施行する。

付 則

1 この取扱いは、平成18年1月10日から施行する。

2 清算参加者は、この取扱い施行の際、現に債券（国債証券、新株予約権付社債券及び交換社債券を除く。）を本券により本所に差し入れている場合には、平成18年6月30日までに返戻を受けるものとする。

付 則

この取扱いは、平成18年7月18日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成19年1月4日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成19年2月26日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成19年4月1日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成19年5月21日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成19年9月18日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成19年9月30日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成20年1月4日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成20年4月21日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成21年1月5日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成21年6月16日から施行する。

付 則

1 この取扱いは、平成21年12月30日から施行する。ただし、第4条の改正規定は、平成22年1月4日から施行する。

2 前項の規定にかかわらず、第4条の改正規定は、東京証券取引所において呼値に関する規則第11条の規定が施行されない場合には、平成22年1月4日以後の本所が定める日から施

行する。

付 則

この取扱いは、平成22年7月1日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成22年10月12日から施行する。

付 則

1 この取扱いは、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

この取扱いは、平成24年2月27日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成25年1月1日から施行する。