

## 東京証券取引所との現物市場の統合及び日本証券クリアリング機構との清算機関の統合等に伴う関連諸規則の一部改正等について

### I 改正概要

#### 1 東京証券取引所との現物市場の統合等に伴う関連諸制度の整備

##### (1) 現物市場の統合に伴う関連諸規則の廃止

- ・ 現物市場の統合に伴い当社現物市場を閉鎖することから、関連諸規則を廃止する。

##### (2) 規則体系の変更

- ・ 指数先物特例<sup>1</sup>、個別証券オプション特例<sup>2</sup>及び指数オプション特例<sup>3</sup>を廃止し、当該特例において規定している事項のうち、取引制度に係るものは業務規程、受託契約準則に係るものは受託契約準則においてそれぞれ規定する。

##### (3) 取引参加者制度の整備

- ・ 現物市場統合に伴い、現物取引に係る取引資格を廃止し、当社の取引資格は先物取引等取引資格及びF X取引資格の2種類とする。
- ・ 現物取引資格の廃止に伴い、取引参加者参加金について、先物取引等取引資格は3,000万円、F X取引資格は300万円とし、基本料について、先物取引等取引参加者は24万円、F X取引参加者は3万円とする。
- ・ 取引参加者は、当月分の基本料を毎月20日に当社に納入するものとする。
- ・ 自主規制業務を東証自主規制法人に委託することに伴い、取引資格の資格審査料の額は100万円、取引資格の喪失に係る手数料は50万円とし、取引資格取得時及び取引資格喪失時の公告に係る費用の負担は取引参加者に求めないこととする。

##### (4) 個別証券オプション取引に関する整備

- ・ 個別証券オプションの権利行使により成立するオプション対象証券の売

---

<sup>1</sup> 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

<sup>2</sup> 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

<sup>3</sup> 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

買に係る決済のために、先物取引等取引参加者（東京証券取引所の総合取引参加者又は現物取引参加者である者に限る。）は、東京証券取引所の信用取引・貸借取引規程に準じて貸借取引を行うことができるものとする。

(5) 自主規制業務の委託に伴う整備

- ・ 当社は、以下に掲げる自主規制業務について、東証自主規制法人に委託する。
  - － 個別証券オプションの上場及び上場廃止の審査、取引参加者の資格の審査、取引参加者の法令等の遵守の状況の調査、市場デリバティブ取引の内容の審査、処分その他の措置に関する業務
- ・ 取引参加者及び取引資格を取得しようとする者は、当社が東証自主規制法人に委託した業務について、東証自主規制法人が行う審査、調査、報告又は資料の提出の請求、検査及び審問等に応じなければならない。
- ・ 当社は、東証自主規制法人が行う審査又は調査等の結果に基づき承認又は処分その他の措置等を行う。

(6) その他

- ・ 自主規制業務の委託に伴う所要の改正を行う。
- ・ 国外取引参加者（「リモート取引参加者」に改称。）に当社が認める日本証券業協会規則等の遵守を求めることとし、これに伴い、取引所取引許可業者の取引資格取得要件である取引所取引許可業者の外国自主規制機関への加入を不要とする。
- ・ その他所要の改正及び文言の修正を行う。

2 クリアリング機構との清算機関の統合に伴う関連諸制度の整備

(1) 清算機関の統合に伴う関連諸規則の廃止

- ・ 清算機関の統合に伴い金融商品債務引受業を廃止することから、関連諸規則を廃止する。

(2) 清算機関の統合に伴う清算機関の指定

- ・ 当社の先物・オプション取引及び取引所外国為替証拠金取引（以下「先物・オプション取引等」という。）に係る金融商品取引清算機関として、クリアリング機構を指定する。

### (3) 取引参加者制度

#### (a) 取引参加者の義務

- ・ 当社の取引参加者は、その有する取引資格の種類に応じて、クリアリング機構の清算資格を取得するか、クリアリング機構の他社清算参加者との間で、クリアリング機構の定める様式による清算受託契約を締結しなければならない。
- ・ クリアリング機構の清算資格を有しない取引参加者（以下「非清算参加者」という。）は、当該非清算参加者と清算受託契約を締結しているクリアリング機構の他社清算参加者のうちから、有価証券等清算取次ぎの委託先とする者（以下「指定清算参加者」という。）を1社指定しなければならない。

#### (b) 証拠金の管理等

- ・ 取引参加者は、当社の定めるところにより<sup>4</sup>、顧客及び指定清算参加者との間の証拠金の差入れ・預託等の管理を行う。

#### (c) 取引参加者に対するリスク管理

- ・ 取引参加者は、保有するポジションの管理等に関し適切なリスク管理体制を整備しなければならない。

#### (d) 取引参加者に対する措置

- ・ 取引参加者における当社市場の先物・オプション取引等に係るポジションが財務体力に比して著しく過大であると認められる場合又はポジションに関するリスク管理体制が当社の市場の運営に鑑みて著しく適当でないと認められる場合には、当該取引参加者に対し、その改善のために必要な措置を講じることを求めることができることとする。
- ・ 取引参加者において必要な措置が講じられていないと認められる場合には、先物・オプション取引等の停止又は制限等、必要な措置を行うことができることとする。

---

<sup>4</sup> 業務方法書の廃止に伴い、現行の「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」及び「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に関する規則」は廃止し、同時に、主に非清算参加者と指定清算参加者及び取引参加者と顧客との間の証拠金に係る事項を規定する同名の規則を新設する。

- ・ クリアリング機構の清算参加者がクリアリング機構から債務引受停止等の措置を受けた場合、当社は、当該措置を受けた清算参加者である取引参加者又は当該措置を受けた清算参加者を指定清算参加者とする取引参加者に対し、当社の市場における先物・オプション取引等の制限等の必要な措置を行うことができる。

(e) 取引参加者料金

- ・ 取引参加者料金のうち、建玉移管負担金を廃止する<sup>5</sup>。

(f) 取引参加者保証金の預託

- ・ 取引参加者は、取引手数料等の支払に係る債務の履行を確保するため取引参加者保証金を当社へ預託しなければならない。取引参加者保証金は、有価証券による代用預託を可能とする<sup>6</sup>。
- ・ 取引参加者保証金の額は、次の合計とする。
  - ① 取引参加者料金のうち、当該取引参加者の直前事業年度末における基本料（現物取引に係るものを除く。）及びデリバティブ売買システム接続料の月額合計の1か月分
  - ② 取引参加者料金のうち、当該取引参加者の直前事業年度における取引手数料（現物取引に係るものを除く。）及びギブアップ負担金の月間平均の合計額の2か月分
- ・ 取引参加者保証金の預託に係る事務は、クリアリング機構に委託し、取引参加者はクリアリング機構の口座に差し入れることとする。

(g) 信認金の預託

- ・ 信認金の預託に係る事務は、クリアリング機構に委託し、取引参加者はクリアリング機構の口座に差し入れることとする。

(3) 先物・オプション取引等の決済

- ・ 当社の市場において成立した先物・オプション取引等の決済は、クリアリング機構の定めるところにより、清算参加者とクリアリング機構との

---

<sup>5</sup> 建玉の移管に係る手数料は、クリアリング機構において徴収する。

<sup>6</sup> 取引参加者保証金の代用有価証券に関する事項は信認金に係るものと同じとする。なお、取引参加者保証金及び信認金の預託に係る事務をクリアリング機構に委託することに伴い、代用価格の計算に用いる掛目等について所要の改正を行う。

間で行う。

- ・ 非清算参加者は、当社の市場において成立した先物・オプション取引等について、当社の定めるところにより、指定清算参加者との間で決済を行う。

#### (4) その他

- ・ 清算機関の統合を機に、先物・オプション取引口座設定約諾書について、東京証券取引所の同約諾書と統一化することとし、所要の改正を行う<sup>7</sup>。
- ・ 清算機関の統合等に伴い、取引所 F X 取引口座設定約諾書について、所要の改正を行う。
- ・ その他所要の改正及び文言の修正を行う。

## II 施行日等

### 1 施行日

- ・ 平成 25 年 7 月 16 日から施行する。ただし、業務規程第 41 条の改正規定は同年 7 月 22 日から施行する。

### 2 経過措置

- ・ 施行日においてクリアリング機構の指数先物等清算資格を取得する予定である先物取引等取引参加者及び F X 清算資格を取得する予定である F X 取引参加者は、平成 25 年 6 月 28 日までにクリアリング機構の定めるところによりクリアリング機構に当該清算資格の取得の申請を行うものとする。
- ・ 当社の定めるところによる清算参加者が施行日の前日において当社に預託している清算預託金は、施行日に、清算参加者に代わって当社が清算基金としてクリアリング機構に預託する。
- ・ 当社の定めるところによる取引参加者が施行日の前日において当社に預託している取引証拠金は、施行日に、取引参加者、顧客及び申込者に代わって当社がクリアリング機構に預託する。
- ・ 施行日の属する月（以下「開始月」という。）分の取引参加者料金の基本料は、当社の定めるところにより日割り計算した額とし、開始月の翌月 20 日に翌月分の基本料と合わせて、納入するものとする。

---

<sup>7</sup> 先物・オプション取引口座設定約諾書は、指数先物特例等の廃止に伴い廃止し、同時に、改正受託契約準則に基づき新設する。

- 有価証券上場規程別表の取扱い等の廃止に伴い、平成25年8月末を納入期限とする平成25年7月1日から施行日前日までに係る各種年賦課金は、当社の定めるところにより日割り計算した額を納入するものとする。
- 清算参加者料金等に関する規則の廃止に伴い、開始月における清算参加者料金は、当社の定めるところにより日割り計算した額を納入するものとする。
- その他所要の経過措置を設ける。

以 上