

東京証券取引所とのデリバティブ市場の統合等に伴う定款等の一部改正等について（１）

目 次

(ページ)

１． 定款の一部改正新・旧対照表	１
２． 業務規程の一部改正新・旧対照表	１３
３． 業務規程の一部改正新・旧対照表（平成 26 年 4 月 1 日施行分）	５７
４． 取引参加者規程の一部改正新・旧対照表	５８
５． 取引参加者規程の一部改正新・旧対照表（平成 26 年 4 月 1 日施行分）	６７
６． 清算・決済規程の一部改正新・旧対照表	６８
７． 受託契約準則の一部改正新・旧対照表	８３
８． J－N E T 市場に関する業務規程及び受託契約準則の特例の一部改正新・旧対照表	101
９． 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の一部改正新・旧 対照表	105
10． 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一部改正 新・旧対照表	107
11． 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の 一部改正新・旧対照表	112
12． 定款等の読点を変更する規則	113

定款の一部改正新・旧対照表

新	旧
第1章 総 則 (商 号) 第1条 当社は、<u>株式会社大阪取引所</u>と称し、英文では、<u>O s a k a E x c h a n g e , I n c .</u> と表示する。 (目 的) 第2条 当社は、<u>次の事業</u>を営むことを目的とする。 (1) <u>市場デリバティブ取引を行うための市場施設の提供、相場の公表及び市場デリバティブ取引の公正の確保その他の取引所金融商品市場の開設に係る業務</u> (2) 前号に附帯する業務 2 当社は、公益及び投資者保護に資するため、<u>市場デリバティブ取引を公正かつ円滑ならしめることを旨として業務を営むものとする。</u> (本店の所在地) 第3条 当社は、<u>本店</u>を大阪市に置く。 (公告の方法) 第4条 当社の公告方法は、電子公告とする。ただし、<u>事故その他</u>のやむを得ない事由によって電子公告による公告をすることができない場合は、日本経済新聞に掲載<u>する。</u> (削る)	第1章 総 則 (商 号) 第1条 当社は、<u>株式会社大阪証券取引所</u>と称し、英文では<u>Osaka Securities Exchange Co., Ltd.</u> と表示する。 (目 的) 第2条 当社は、<u>次の各号に掲げる業務</u>を営むことを目的とする。 (1) <u>取引所金融商品市場の開設</u> (2) <u>その他前号に掲げる業務に附帯する業務</u> 2 当社の<u>開設する取引所金融商品市場（以下「当社の市場」という。）</u>は、公益及び投資者の<u>保護に資するため、市場デリバティブ取引が公正、円滑に行われることを旨として運営されるものとする。</u> (本店の所在地) 第3条 当社の<u>本店</u>は、大阪市に置く。 (公告方法) 第4条 当社の公告方法は、電子公告とする。ただし、<u>事故その他</u>やむを得ない事由によって電子公告による公告をすることができない場合は、日本経済新聞に掲載<u>して行う。</u> (機 関) 第5条 当社は、株主総会及び取締役のほか、<u>次の機関を置く。</u> (1) <u>取締役会</u> (2) <u>監査役</u> (3) <u>監査役会</u> (4) <u>会計監査人</u>

(削る)

(削る)

第2章 取引所金融商品市場

(取引所金融商品市場に関する事項)

第6条 当社の市場においては、市場デリバティブ取引を行う。

(規則の制定)

(削る)

第7条 当社は、当社の市場における市場デリバティブ取引を公正かつ円滑にならしめ、かつ、投資者の保護に資するため、本定款のほか、業務規程、受託契約準則その他の規則を定めるものとする。

(取引参加者の法令等の遵守義務)

(削る)

第8条 取引参加者は、法令（金融商品取引法（昭和23年法律第25号）及びその関係法令をいう。第9条及び第10条において同じ。）、法令に基づく行政官庁の処分、当社の定款、業務規程、受託契約準則その他の規則（以下「規則」という。）及び取引の信義則を遵守しなければならない。

(取引参加者の処分)

(削る)

第9条 当社は、取引参加者が法令、法令に基づいてする行政官庁の処分又は当社の規則に違反した場合、取引の信義則に背反する行為をした場合その他の業務規程で定める処分事由に該当した場合は、その定めるところにより、過怠金の賦課、当社の市場における市場デリバティブ取引又はその有価証券等清算取次ぎの委託の停止又は制限、取引資格の取消しその他の処分を行うことができる。

(資料等の提出義務等)

(削る)

第10条 当社は、取引参加者の法令、法令に基づく行政官庁の処分又は当社の規則若しくはこれらに基づく処分又は取引の信義則の遵守の状況の調査を行うとき、その他の当社の目的及び市場の運営にかんがみて必要があると認めるときは、取引参加者に対し、当該取引参加者の営業若しくは財産に関して参考となるべき報告若しくは資料の提出を請求

第2章 株 式

第5条～第9条 (略)

(株主の住所等の届出)

第10条 当社の株主及び登録株式質権者又はその法定代理人若しくは代表者は、当社所定の書式により、その氏名又は名称、住所及び印鑑を当社に届出なければならない。

2 (略)

第3章 株主総会

(株主総会の招集)

第11条 当社の定時株主総会は、毎事業年度終了後3か月以内にこれを招集し、臨時株主総会は、必要がある場合に随時これを招集する。

(削る)

(基準日)

第12条 (略)

(株主総会の招集権者及び議長)

第13条 株主総会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会の決議によって、取締役社長が招集し、議長となる。

2 取締役社長に事故があるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順序により、他の取締役が株主総会を招集し、議長となる。

し、又は当社の職員をして当該取引参加者の営業若しくは財産の状況若しくは帳簿、書類その他の物件を検査させることができる。

第3章 株 式

第11条～第15条 (略)

(株主の住所等の届出)

第16条 当社の株主及び登録株式質権者又はその法定代理人若しくは代表者は、当社所定の書式により、その氏名又は名称、住所及び印鑑を当社に届出なければならない。

2 (略)

第4章 株主総会

(招 集)

第17条 株主総会は、定時株主総会及び臨時株主総会とし、定時株主総会は毎事業年度終了の日の翌日から3か月以内に招集し、臨時株主総会は随時必要に応じて、招集する。

2 株主総会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会の決議により、取締役社長が招集する。ただし、取締役社長事故あるときは、あらかじめ取締役会の定めた順序に従い、他の取締役が招集する。

(定時株主総会の基準日)

第18条 (略)

(新設)

(株主総会参考書類等のインターネット開示とみなし提供)

第14条 当社は、株主総会の招集の通知に際し、株主総会参考書類、事業報告、計算書類及び連結計算書類に記載又は表示をすべき事項に係る情報を、法務省令に定めるところに従いインターネットを利用する方法で開示することにより、株主に対して提供したものとみなすことができる。

(削る)

(株主総会の決議の方法)

第15条 (略)

2 会社法第309条第2項に定める株主総会の決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の3分の2以上をもって行う。

(議決権の代理行使)

第16条 株主は、当社の議決権を有する他の出席株主1名を代理人として、その議決権を行使することができる。

2 前項の規定により議決権を行使する場合、株主又は代理人は、株主総会ごとに代理権を証明する書面を当社に提出しなければならない。

第4章 取締役及び取締役会

(取締役会の設置)

第17条 当社は、取締役会を置く。

(取締役の員数)

第18条 (略)

(株主総会参考書類等のインターネット開示とみなし提供)

第19条 当社は、株主総会の招集に際し、株主総会参考書類、事業報告、計算書類及び連結計算書類に記載又は表示をすべき事項に係る情報を、法務省令に定めるところに従いインターネットを利用する方法で開示することにより、株主に対して提供したものとみなすことができる。

(議 長)

第20条 株主総会の議長は、取締役社長がこれに当たる。ただし、取締役社長事故あるときは、あらかじめ取締役会の定めた順序に従い、他の取締役がこれに当たる。

(決議方法)

第21条 (略)

2 会社法第309条第2項の規定による株主総会の決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の3分の2以上に当たる多数決をもって行う。

(議決権の代理行使)

第22条 株主は、当社の議決権を有する他の株主1名を代理人として、議決権を行使することができる。この場合には、株主又は代理人は代理権を証明する書面を当社に提出しなければならない。

(新設)

第5章 取締役及び取締役会等

(新設)

(員 数)

第23条 (略)

(取締役の選任)

第19条 取締役は、株主総会の決議によって選任する。

2 取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行う。

3 (略)

(取締役の任期)

第20条 取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとする。

2 増員により、又は補欠として選任された取締役の任期は、在任の取締役の任期の満了する時までとする。

(代表取締役等)

第21条 取締役会は、その決議によって、代表取締役を選定する。

2 取締役会は、その決議によって、取締役会長及び取締役社長については各1名、取締役副社長、専務取締役及び常務取締役については各若干名を定めることができる。

3 当社の常務に従事する取締役は、その在任中、金融商品取引業と直接関係のある業務に従事することができない。

(削る)

(選任方法)

第24条 取締役は、株主総会において、選任する。

2 前項の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行う。

3 (略)

(任期)

第25条 取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとする。ただし、補欠として選任された取締役の任期は、前任者の残任期間とする。

(新設)

(代表取締役)

第26条 取締役会は、その決議によって代表取締役を選定する。

2 代表取締役は、各自当社を代表し、取締役会の決議に従い業務を執行する。

(新設)

(取締役)

第27条 取締役会は、その決議によって取締役会長1名、取締役社長1名、取締役副社長、専務取締役及び常務取締役各若干名を選定することができる。

2 当社の常務に従事する取締役は、その在任中、金融商品取引業に従事することができない。

3 前項に規定する取締役は、その在任中、取締役会の承認を受けなければ、他の業務に従事することができない。

(取締役会の招集権者及び議長)

第22条 取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会において指名する取締役がこれを招集し、議長となる。

(削る)

(削る)

(取締役会の招集通知)

第23条 取締役会を招集するには、各取締役及び各監査役に対して会日の3日前までにその通知を発するものとする。ただし、緊急の場合はこの期間を短縮することができる。

2 取締役及び監査役全員の同意があるときは、招集の手続きを経ないで取締役会を開催することができる。

(取締役会の決議の方法)

第24条 取締役会の決議は、議決に加わることができる取締役の過半数が出席し、その過半数をもって行う。

(取締役会の決議の省略)

第25条 議決に加わることができる取締役の全員が取締役会の決議事項について書面又は電磁的記録により同意したときは、当該決議事項を可決する旨の取締役会の決議があったものとみなす。ただし、監査役が異議を述べたときはこの限りでない。

(取締役会規則)

第26条 取締役会に関する事項は、法令又は本定款のほか、取締役会において定める取締役会規則による。

(招 集)

第28条 取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役社長が招集する。ただし、取締役社長事故あるときは、あらかじめ取締役会の定めた順序に従い、他の取締役が招集する。

2 前項の招集は、各取締役及び各監査役に対し取締役会の日3日前までに、その通知を発するものとする。ただし、緊急の必要があるときは、この期間を短縮することができる。

3 取締役及び監査役全員の同意があるときは、招集の手続きを経ないで取締役会を開くことができる。

(新設)

(決議方法)

第29条 取締役会の決議は、取締役の過半数が出席し、その出席取締役の過半数をもって行う。

(決議の省略)

第30条 当社は、会社法第370条の要件を満たしたときは、取締役会の決議があったものとみなす。

(取締役会規程)

第31条 取締役会に関する事項は、法令又は本定款のほか、取締役会において定める取締役会規程による。

(報酬等)

(削る)

(取締役の責任免除等)

第27条 当社は、会社法第426条第1項の規定により、任務を怠ったことによる取締役（取締役であった者を含む。）の損害賠償責任を、法令の限度において、取締役会の決議によって免除することができる。

2 当社は、会社法第427条第1項の規定により、社外取締役との間に、任務を怠ったことによる損害賠償責任を限定する契約を締結することができる。ただし、当該契約に基づく損害賠償責任の限度額は、法令が規定する額とする。

第5章 監査役及び監査役会

(監査役及び監査役会の設置)

第28条 当社は、監査役及び監査役会を置く。

(監査役の員数)

第29条 (略)

(監査役の選任)

第30条 監査役は、株主総会の決議によって選任する。

2 監査役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行う。

(削る)

第32条 取締役の報酬、賞与その他の職務執行の対価として当社から受ける財産上の利益（以下「報酬等」という。）は、株主総会の決議によって定める。

(取締役の責任免除)

第33条 当社は、会社法第426条第1項の規定により、任務を怠ったことによる取締役（取締役であった者を含む。）の損害賠償責任を、法令の限度において取締役会の決議によって免除することができる。

2 当社は、会社法第427条第1項の規定により、社外取締役との間に、任務を怠ったことによる損害賠償責任を限定する契約を締結することができる。ただし、当該契約に基づく賠償責任の限度額は、法令が規定する額とする。

第6章 監査役及び監査役会

(新設)

(員 数)

第35条 (略)

(選任方法)

第36条 監査役は、株主総会において、選任する。

2 前項の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行う。

(補欠監査役の選任の効力)

第37条 法令又は本定款に定める監査役の員数を欠くこととなるときに備えて選任された補欠の監査役の選任決議の有効期間は、当該決議後4年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の開始の時までとする。ただし、株主総会の決議によってその期間を短縮することができる。

(監査役の任期)

第31条 監査役の任期は、選任後4年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとする。

2 任期の満了前に退任した監査役の補欠として選任された監査役の任期は、退任した監査役の任期の満了する時までとする。

(常勤の監査役)

第32条 監査役会は、その決議によって常勤の監査役を選定する。

2 常勤の監査役は、その在任中、金融商品取引業と直接関係のある業務に従事することができない。

(削る)

(監査役会の招集権者)

第33条 監査役会は、各監査役がこれを招集する。

(削る)

(削る)

(監査役会の招集通知)

第34条 監査役会を招集するには、各監査役に対して会日の3日前までにその通知を発するものとする。ただし、緊急の場合はこの期間を短縮することができる。

2 監査役全員の同意があるときは、招集の手続きを経ないで監査役会を開催することができる。

(監査役会の決議の方法)

(任 期)

第38条 監査役の任期は、選任後4年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとする。ただし、補欠として選任された監査役の任期は、前任者の残任期間とする。

2 法令又は本定款に定める監査役の員数を欠くこととなるときに備えて選任された補欠の監査役が監査役に就任した場合、当該監査役の任期は、前任者の残任期間とする。

(常勤監査役)

第39条 監査役会は、その決議によって常勤の監査役（以下「常勤監査役」という。）を選定する。

2 常勤監査役は、その在任中、金融商品取引業に従事することができない。

3 常勤監査役は、その在任中、監査役会の承認を受けなければ、他の業務に従事することができない。

(招 集)

第40条 監査役会は、各監査役が招集する。

2 前項の招集は、各監査役に対し監査役会の日の3日前までに、その通知を発するものとする。ただし、緊急の必要があるときは、この期間を短縮することができる。

3 監査役全員の同意があるときは、招集の手続きを経ないで監査役会を開催することができる。

(新設)

第35条 監査役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、監査役の過半数をもって行う。

(監査役会規則)

第36条 監査役会に関する事項は、法令又は本定款のほか、監査役会において定める監査役会規則による。

(削る)

(監査役の責任免除等)

第37条 当社は、会社法第426条第1項の規定により、任務を怠ったことによる監査役（監査役であった者を含む。）の損害賠償責任を、法令の限度において、取締役会の決議によって免除することができる。

2 当社は、会社法第427条第1項の規定により、社外監査役との間に、任務を怠ったことによる損害賠償責任を限定する契約を締結することができる。ただし、当該契約に基づく損害賠償責任の限度額は、法令が規定する額とする。

第6章 会計監査人

(会計監査人の設置)

第38条 当社は、会計監査人を置く。

(会計監査人の選任)

第39条 会計監査人は、株主総会の決議によって選任する。

(会計監査人の任期)

第40条 会計監査人の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとする。

2 会計監査人は、前項の定時株主総会において別段の決議がされなかったときは、当該定時株主総会

(新設)

(監査役会規程)

第41条 監査役会に関する事項は、法令又は本定款のほか、監査役会において定める監査役会規程による。

(報酬等)

第42条 監査役の報酬等は、株主総会の決議によって定める。

(監査役の責任免除)

第43条 当社は、会社法第426条第1項の規定により、任務を怠ったことによる監査役（監査役であった者を含む。）の損害賠償責任を法令の限度において、取締役会の決議によって免除することができる。

2 当社は、会社法第427条第1項の規定により、社外監査役との間に、任務を怠ったことによる損害賠償責任を限定する契約を締結することができる。ただし、当該契約に基づく賠償責任の限度額は、法令が規定する額とする。

(新設)

(新設)

(新設)

(新設)

において再任されたものとみなす。

第7章 諮問委員会

(諮問委員会)

第41条 当社に諮問委員会を設ける。

2 諮問委員会は、当社の開設する取引所金融商品市場（以下「当社の市場」という。）の運営に関する重要事項について、取締役会の諮問に応じ又は取締役会に意見を述べることができる。

3 諮問委員会の構成、議事手続その他諮問委員会の運営に関し必要な事項は、取締役会において定める諮問委員会規則による。

第8章 取引所金融商品市場

(取引所金融商品市場)

第42条 当社の市場においては、市場デリバティブ取引を行う。

(市場デリバティブ取引のための標準物の設定)

第43条 当社は、市場デリバティブ取引のため、利率、償還期限その他の条件を標準化した標準物を設定することができる。

(業務規程及び受託契約準則等)

第44条 当社の市場における市場デリバティブ取引に関して必要な事項は、業務規程をもって定める。

2 取引参加者の当社の市場における市場デリバティブ取引（有価証券等清算取次ぎを除く。）の受託に関する契約は、受託契約準則をもって定める。

3 当社は、前2項のほか、当社の市場の運営上の必要に応じて、規則を定めることができる。

第9章 取引参加者の調査及び処分

(取引参加者による法令諸規則等の遵守)

第45条 取引参加者は、金融商品取引法及びその関係法令（以下この章において「法令」という。）、法令に基づいてする行政官庁の処

第7章 諮問委員会

(諮問委員会)

第44条 当社は、諮問委員会を置くことができる。

2 諮問委員会は、当社の運営に関する重要事項について、取締役会の諮問に応じ又は取締役会に意見を述べることができる。

3 諮問委員会に関する事項は、取締役会において定める諮問委員会規則による。

(新設)

(新設)

(新設)

(新設)

(新設)

(新設)

分、当社の定款、業務規程、受託契約準則その他の規則（以下この章において「当社の規則」という。）並びに取引の信義則を遵守しなければならない。

（取引参加者の調査）

第46条 当社は、取引参加者の法令、法令に基づく行政官庁の処分若しくは当社の規則又は取引の信義則の遵守状況の調査を行う場合その他の業務規程で定める場合には、その定めるところにより、必要な調査を行うことができる。

（新設）

（取引参加者の処分）

第47条 当社は、取引参加者が法令、法令に基づいてする行政官庁の処分又は当社の規則に違反した場合、取引の信義則に背反する行為をした場合その他の業務規程で定める処分事由に該当した場合は、その定めるところにより、過怠金の賦課、当社の市場における市場デリバティブ取引若しくはその有価証券等清算取次ぎの委託の停止又は制限、取引資格の取消しその他の処分を行うことができる。

（新設）

第10章 計 算

（事業年度）

第48条 当社の事業年度は、毎年4月1日から翌年3月31日までの1年とする。

（期末配当金）

第49条 当社は、株主総会の決議によって、毎年3月31日の最終の株主名簿に記載又は記録された株主又は登録株式質権者に対し金銭による剰余金の配当（以下「期末配当金」という。）を支払う。

（削る）

（削る）

第8章 計 算

（事業年度）

第45条 当社の事業年度は、毎年4月1日から翌年3月31日までとする。

（剰余金の配当）

第46条 株主総会の決議により、毎年3月31日の最終の株主名簿に記載又は記録された株主若しくは登録株式質権者に対し、期末配当を行うことができる。

2 前項のほか、取締役会の決議により、毎年9月30日の最終の株主名簿に記載又は記録された株主若しくは登録株式質権者に対し、中間配当を行うことができる。

3 前2項の期末配当金又は中間配当金が、支払開

<u>(中間配当金)</u> <u>第50条 当社は、取締役会の決議によって、毎年9月30日の最終の株主名簿に記載又は記録された株主又は登録株式質権者に対し、会社法第454条第5項に定める剰余金の配当（以下「中間配当金」という。）を支払うことができる。</u> <u>(配当金の除斥期間)</u> <u>第51条 期末配当金及び中間配当金が支払開始の日から満3年を経過してもなお受領されないときは、当社はその支払義務を免れる。</u> <u>2 期末配当金及び中間配当金には、利息をつけない。</u> 付 則 1 この改正規定は、当社が別に定める日から施行する。 2 改正前の第37条及び第38条第2項の規定は、この改正規定施行の日において現に選任されている補欠の監査役について、なおその効力を有する。	<u>始の日から3年以内に受領されないときは、当社は、その支払いの義務を免れるものとする。</u> (新設) (新設)
---	--

業務規程の一部改正新・旧対照表

新	旧
(目 的) 第1条 この規程は、<u>定款第44条第1項</u>の規定に基づき、本所の開設する取引所金融商品市場(以下「本所の市場」という。)における市場デリバティブ取引に関し必要な事項を定める。ただし、取引所外国為替証拠金取引(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通貨の価格に係るものをいう。)については、この規程に定めるもののほか、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をもって定める。 2 (略) (自主規制業務の委託) 第2条の2 本所は、法第84条第2項に規定する自主規制業務のうち、<u>第3条第1項第3号</u>に定める<u>有価証券</u>オプションの上場及び上場廃止に関する業務について、東京証券取引所自主規制法人(以下「自主規制法人」という。)に委託することができる。 2 (略) (市場デリバティブ取引の種類) 第3条 本所の市場における市場デリバティブ取引は、次の各号に定める取引とする。 (1) <u>国債証券先物取引</u> a <u>Large取引</u> <u>法第2条第21項第1号に掲げる取引のうち国債証券の標準物に係るものをいう。</u> b <u>Mini取引</u> <u>法第2条第21項第2号に掲げる取引のうち国債証券の標準物の価格に係るものをいう。</u> (2) (略) (3) <u>有価証券オプション取引</u> 有価証券の売買に係る法第2条第21項第3号に掲げる取引であって、<u>有価証券オプション</u>(権利取得者(当該<u>有価証券</u>オプションを付与され	(目 的) 第1条 この規程は、<u>定款第7条</u>の規定に基づき、本所の開設する取引所金融商品市場(以下「本所の市場」という。)における市場デリバティブ取引に関し必要な事項を定める。ただし、取引所外国為替証拠金取引(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通貨の価格に係るものをいう。)については、この規程に定めるもののほか、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をもって定める。 2 (略) (自主規制業務の委託) 第2条の2 本所は、法第84条第2項に規定する自主規制業務のうち、<u>第3条第1項第2号</u>に定める<u>個別証券</u>オプションの上場及び上場廃止に関する業務について、東京証券取引所自主規制法人(以下「自主規制法人」という。)に委託することができる。 2 (略) (市場デリバティブ取引の種類) 第3条 本所の市場における市場デリバティブ取引は、次の各号に定める取引とする。 (新設) (1) (略) (2) <u>個別証券オプション取引</u> 有価証券の売買に係る法第2条第21項第3号に掲げる取引であって、<u>個別証券オプション</u>(権利取得者(当該<u>個別証券</u>オプションを付与され

た者をいう。)の意思表示により当事者間において、有価証券の売買を成立させることができる権利をいう。以下同じ。)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。

(4) 国債証券先物オプション取引

権利取得者(国債証券先物オプションを付与された者をいう。)の意思表示により当事者間において国債証券の標準物に係る国債証券先物取引を成立させることができる権利をいう。

(5) 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この規程に定める取引に係るものであって、指数オプション(権利取得者(当該指数オプションを付与された者をいう。第14条において同じ。))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(第14条において「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。以下同じ。)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。

(用語の意義)

第4条 この規程において使用する用語の意義については、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) 先物取引とは、国債証券先物取引又は指数先物取引をいう。

(1)の2 オプションとは、有価証券オプション、国債証券先物オプション又は指数オプションをいい、オプション取引とは、有価証券オプション取引、国債証券先物オプション取引又は指数オプション取引をいう。

(2) (略)

(3) 権利行使とは、オプションの行使をいう。

た者をいう。)の意思表示により当事者間において、有価証券の売買を成立させることができる権利をいう。以下同じ。)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。

(新設)

(3) 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この規程に定める取引に係るものであって、指数オプション(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(第14条において「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。以下同じ。)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。

(用語の意義)

第4条 この規程において使用する用語の意義については、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。

(新設)

(1) オプションとは、個別証券オプション又は指数オプションをいい、オプション取引とは、個別証券オプション取引又は指数オプション取引をいう。

(2) (略)

(3) 権利行使とは、オプションの行使をいい、権利

(3)の2 権利行使日とは、有価証券オプション又は指数オプションの権利行使を行うことができる日をいい、権利行使期間とは、国債証券先物オプションの権利行使を行うことができる期間をいう。

(4) 権利行使価格とは、有価証券オプション及び国債証券先物オプションについては、当該オプションの権利行使を行う場合の約定値段としてあらかじめ設定した価格をいい、指数オプションについては、前条第5号の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をいう。

(5) 売付けとは、次のaからcまでに掲げる市場デリバティブ取引の区分に従い、当該aからcまでに定めるところによる。

a 国債証券先物取引

(a) Large取引

国債証券を引き渡す立場の当事者になる取引をいう。

(b) Mini取引

現実数値（将来の一定の時期における国債証券の標準物の価格の数値をいう。次号a(b)において同じ。）が約定数値（当事者があらかじめ標準物の価格として約定する数値をいう。次号a(b)において同じ。）を下回った場合に金銭を受領する立場の当事者となる取引をいう。

b 指数先物取引

現実数値（将来の一定の時期における現実の指数の数値をいう。次号bにおいて同じ。）が約定数値（当事者があらかじめ指数として約定する数値をいう。次号bにおいて同じ。）を下回った場合に金銭を受領する立場の当事者となる取引をいう。

c （略）

(6) 買付けとは、次のaからcまでに掲げる市場デリバティブ取引の区分に従い、当該aからcまでに定めるところによる。

a 国債証券先物取引

行使日とは、権利行使を行うことができる日をいう。

(新設)

(4) 権利行使価格とは、個別証券オプションについては、個別証券オプションの権利行使を行う場合の約定値段としてあらかじめ設定した価格をいい、指数オプションについては、前条第3号の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をいう。

(5) 売付けとは、次のa及びbに掲げる市場デリバティブ取引の区分に従い、当該a及びbに定めるところによる。

(新設)

a 指数先物取引

現実数値（将来の一定の時期における現実の指数の数値をいう。以下この条において同じ。）が約定数値（当事者があらかじめ指数として約定する数値をいう。以下同じ。）を下回った場合に金銭を受領する立場の当事者となる取引をいう。

b （略）

(6) 買付けとは、次のa及びbに掲げる市場デリバティブ取引の区分に従い、当該a及びbに定めるところによる。

(新設)

(a) Large取引

国債証券を受領する立場の当事者になる取引をいう。

(b) Mini取引

現実数値が約定数値を上回った場合に金銭を受領する立場の当事者となる取引をいう。

b・c (略)

(7) 値段とは、次の a から c までに掲げる市場デリバティブ取引の区分に従い、当該 a から c までに定めるところによる。

a 国債証券先物取引

(a) Large取引

国債証券の標準物の売付け又は買付けにおける対価となる額をいう。

(b) Mini取引

国債証券の標準物の価格の数値をいう。

b・c (略)

(8)～(10) (略)

(11) 取引日とは、次の a 及び b に掲げる市場デリバティブ取引の区分に従い、当該 a 及び b に定めるところによる。

a 国債証券先物取引及び国債証券先物オプション取引

一の日（休業日（第19条第3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。以下同じ。）の午後3時25分から、その翌日（休業日に当たるときは、順次繰り下げる。第18条第1項第2号及び第26条第3項を除き、以下同じ。）の午後3時15分までをいう。

b 指数先物取引及び指数オプション取引

一の日の午後4時15分から、その翌日の午後4時までをいう。

(12)～(14) (略)

第2章 取引の対象及び限月取引等

第1節 国債証券先物取引の標準物等

a・b (略)

(7) 値段とは、次の a 及び b に掲げる市場デリバティブ取引の区分に従い、当該 a 及び b に定めるところによる。

(新設)

a・b (略)

(8)～(10) (略)

(11) 取引日とは、一の日（休業日（第19条第3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18条第1項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。同項第2号及び第26条第3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。

(12)～(14) (略)

第2章 取引の対象及び限月取引等

(新設)

(Large取引における標準物の条件)

第4条の2 Large取引における標準物の条件は、銘柄ごとに、次の各号に定めるところによる。

(新設)

- (1) 中期国債標準物については、額面100円、利率年3パーセント及び償還期限5年とする。
- (2) 長期国債標準物については、額面100円、利率年6パーセント及び償還期限10年とする。
- (3) 超長期国債標準物については、額面100円、利率年6パーセント及び償還期限20年とする。

(Mini取引における取引の対象)

第4条の3 Mini取引の対象は、長期国債標準物の価格とする。

(新設)

(限月取引及びその数)

第4条の4 Large取引及びMini取引は、銘柄ごとに、限月取引に区分する。

(新設)

2 前項の限月取引とは、次の各号に掲げる取引をいう。

(1) Large取引については、3月20日（休業日に当たるときは、順次繰り下げる。以下この項において同じ。）、6月20日、9月20日及び12月20日を受渡決済期日とする取引

(2) Mini取引については、3月、6月、9月及び12月のLarge取引の取引最終日が終了する日の前日（休業日に当たるときは、順次繰り上げる。以下同じ。）に終了する取引日を取引最終日とする取引

3 Large取引及びMini取引は、それぞれ3限月取引制とし、各限月取引の期間は9か月とする。

4 Large取引について、最初に受渡決済期日が到来する限月取引の受渡決済期日の7日前（休業日を除く。）の日に終了する取引日を当該限月取引の取引最終日とし、当該取引最終日の終了する日の翌日の本所が定める時刻から新たな限月取引を開始する。

5 Mini取引について、最初に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々日（休業日に当たるときは、順次繰り下げる。）の本所が定める時刻から新たな限月取引を開始する。

6 第2項から前項までの規定にかかわらず、本所は、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。

第1節の2 指数先物取引の対象等

(取引の対象)

第5条 指数先物取引の対象は、次の各号に掲げる指数とする。

(1) (略)

(2) 東証株価指数（東京証券取引所の上場株券（内国法人の発行する株券（無議決権株式（東京証券取引所の有価証券上場規程第2条第87号に規定する無議決権株式をいう。）、議決権の少ない株式（同第205条第9号の2bに掲げるものをいう。）及び優先株等（同第2条第90号に規定する優先株等をいう。）を除く。）に限る。以下同じ。）のうち市場第一部銘柄を対象とする浮動株時価総額方式の株価指数であって、東京証券取引所が算出するものをいう。以下同じ。）

(3) Russell/Nomura Prime インデックス（国内の金融商品取引所に上場されている銘柄からFrank Russell Company及び野村證券株式会社（以下「ラッセル野村」という。）が選定した銘柄を対象とする浮動株時価総額方式の株価指数であって、ラッセル野村が算出するもの（以下「RNP指数」という。）をいう。以下同じ。）

(4) TOPIX Core30（東京証券取引所の上場株券のうち市場第一部銘柄の中から東京証券取引所が選定した30銘柄を対象とする浮動株時価総額方式の株価指数であって、東京証券取引所が算出するものをいう。以下同じ。）

(5) 東証銀行業株価指数（東京証券取引所の上場株券のうち証券コード協議会により銀行業に分類された市場第一部銘柄を対象とする浮動株時価総額方式の株価指数であって、東京証券取引所が算出するものをいう。以下同じ。）

(6) 東証REIT指数（東京証券取引所の上場不動産投

第1節 指数先物取引の対象等

(取引の対象)

第5条 指数先物取引の対象は、次の各号に掲げる指数とする。

(1) (略)

(2) 日経株価指数300（東京証券取引所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、日本経済新聞社が算出するもの（以下「日経300」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。）

(6) MSCI JAPAN Index（国内の金融商品取引所に上

資信託証券（東京証券取引所の有価証券上場規程第1201条第7号に規定する上場不動産投資信託証券をいう。）を対象とする時価総額方式の指数であって、東京証券取引所が算出するものをいう。以下同じ。）

(7) Dow Jones Industrial Average（外国金融商品市場に上場されている銘柄のうちS&P Dow Jones Indices LLCが選定した30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、S&P Dow Jones Indices LLCが算出するもの（以下「NYダウ」という。）をいう。以下同じ。）

(8) CNX Nifty（National Stock Exchange of India Limited（以下「NSE」という。）に上場されている銘柄のうちIndia Index Services & Products Limited（以下「IISL」という。）が選定した50銘柄を対象とする浮動株時価総額方式の株価指数であって、IISLが算出するものをいう。以下同じ。）

(9) （略）

(10) 日経平均・配当指数（日経平均の構成銘柄を対象とする配当指数（配当（剰余金の配当をいう。以下同じ。）の額に基づき算出される指数をいう。以下同じ。）であって、日本経済新聞社が算出するものをいう。以下同じ。）

(11) TOPIX配当指数（東証株価指数の構成銘柄を対象とする配当指数であって、東京証券取引所が算出するものをいう。以下同じ。）

(12) TOPIX Core30配当指数（TOPIX Core30の構成銘柄を対象とする配当指数であって、東京証券取引所が算出するものをいう。以下同じ。）

(Large取引及びMini取引)

第6条 日経平均及び東証株価指数を対象とする指数先物取引は、次の各号に定めるところにより、Large取引及びMini取引に区分して行うものとする。

(1) 日経平均

場されている銘柄からMorgan Stanley Capital International Inc.（以下「MSCI」という。）が選定した銘柄を対象とする浮動株時価総額方式の株価指数であって、MSCIが算出するもの（以下「MSCI JAPAN」という。）をいう。以下同じ。）

(7) Russell/Nomura Prime インデックス（国内の金融商品取引所に上場されている銘柄からFrank Russell Company及び野村證券株式会社（以下「ラッセル野村」という。）が選定した銘柄を対象とする浮動株時価総額方式の株価指数であって、ラッセル野村が算出するもの（以下「RNP指数」という。）をいう。以下同じ。）

(8) Dow Jones Industrial Average（外国金融商品市場に上場されている銘柄のうちS&P Dow Jones Indices LLCが選定した30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、S&P Dow Jones Indices LLCが算出するもの（以下「NYダウ」という。）をいう。以下同じ。）

(9) （略）
（新設）

（新設）

（新設）

(Large取引及びMini取引)

第6条 日経平均を対象とする指数先物取引は、第29条第1号a(a)に定める額を1単位とする取引（以下「Large取引」という。）及び同a(b)に定める額を1単位とする取引（以下「Mini取引」という。）に区分して行うものとする。

（新設）

第29条第2号a(a)に定める額を1単位とする取引をLarge取引、同a(b)に定める額を1単位とする取引をMini取引とする。

(2) 東証株価指数

第29条第2号b(a)に定める額を1単位とする取引をLarge取引、同b(b)に定める額を1単位とする取引をMini取引とする。

(限月取引及びその数)

第7条 指数先物取引は、次の各号に掲げる取引対象指数(指数先物取引の対象の指数をいう。以下同じ。)ごとに当該各号に定める取引日を取引最終日とする限月取引に区分して行うものとする。

- (1) 日経平均、東証株価指数、RNP指数、TOPIX Core30、東証銀行業株価指数及び東証REIT指数

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。以下同じ。)の前日に終了する取引日

- (2) NYダウ

毎月の第三金曜日(休業日又はアメリカ合衆国東部時間における該当日がNYダウが算出されない予定の日に当たるときは、順次繰り上げる。)に終了する取引日

- (3) CNX Nifty

毎月の最終木曜日(休業日又はインド共和国における該当日がCNX Niftyが算出されない予定の日に当たるときは、順次繰り上げる。)に終了する取引日

- (4) (略)

- (5) 配当指数(日経平均・配当指数、TOPIX配当指数、TOPIX Core30配当指数をいう。以下同じ。)

3月末日(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

2 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指数の区分に従い、当該各号に定めるところによる。

- (1) (略)

(新設)

(限月取引及びその数)

第7条 指数先物取引は、次の各号に掲げる取引対象指数(指数先物取引の対象の指数をいう。以下同じ。)ごとに当該各号に定める取引日を取引最終日とする限月取引に区分して行うものとする。

- (1) 日経平均、日経300、業種別指数(ハイテク指数、フィナンシャル指数又はコンシューマー指数をいう。以下同じ。)、MSCI JAPAN 及びRNP指数

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。以下同じ。)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

- (2) NYダウ

毎月の第三金曜日(休業日又はアメリカ合衆国東部時間における該当日がNYダウが算出されない予定の日に当たるときは、順次繰り上げる。以下同じ。)に終了する取引日

(新設)

- (3) (略)

(新設)

2 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指数の区分に従い、当該各号に定めるところによる。

- (1) (略)

(2) 東証株価指数

a Large取引

特定限月取引の5限月取引制とし、各限月取引の期間は1年3か月とする。

b Mini取引

特定限月取引の3限月取引制とし、各限月取引の期間は9か月とする。

(3) RNP指数

特定限月取引の5限月取引制とし、各限月取引の期間は1年3か月とする。

(4) TOPIX Core30、東証銀行業株価指数及び東証REIT指数

特定限月取引の3限月取引制とし、各限月取引の期間は9か月とする。

(5) (略)

(6) CNX Nifty

各月の限月取引の3限月取引制とし、各限月取引の期間は3か月とする。

(7) (略)

(8) 配当指数

12月限月取引の8限月取引制（1月4日（休業日に当たるときは、順次繰り下げる。以下同じ。）から最初取引最終日が到来する限月取引（以下「直近の限月取引」という。）の取引最終日の終了する日までの間においては9限月取引制）とし、各限月取引の期間は8年3か月とする。

3 (略)

4 新たな限月取引の取引開始は、次の各号に定めるところによる。

(1) 指数先物取引（配当指数先物取引（配当指数を対象とする指数先物取引をいう。以下同じ。）を除く。）については、直近の限月取引の取引最終日の終了する日の翌日の本所が定める時刻から開始する。

(2) 配当指数先物取引については、直近の限月取引の取引最終日の終了する日の属する年の1月4日の本所が定める時刻から開始する。

(新設)

(2) 日経300、業種別指数、MSCI JAPAN 及びRNP指数

特定限月取引の5限月取引制とし、各限月取引の期間は1年3か月とする。

(新設)

(3) (略)

(新設)

(4) (略)

(新設)

3 (略)

4 新たな限月取引の取引開始日は、第2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（以下「直近の限月取引」という。）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。

第2節 有価証券オプション取引の対象等
(取引の対象)

第8条 有価証券オプション取引の対象は、国内の金融商品取引所に上場されている有価証券のうち、次条に定める基準に基づき本所が選定した有価証券（以下「オプション対象証券」という。）に係る次の各号に掲げる有価証券オプションとする。

- (1) 権利行使により成立する有価証券の売買において、権利行使価格で次項及び第3項に規定するオプション対象証券の数量（次号において同じ。）の売付けを成立させることができる有価証券オプション（以下「有価証券プットオプション」という。）
- (2) 権利行使により成立する有価証券の売買において、権利行使価格でオプション対象証券の数量の買付けを成立させることができる有価証券オプション（以下「有価証券コールオプション」という。）
- 2 最小単位の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数量（以下「有価証券オプション1単位のオプション対象証券の数量」という。）は、オプション対象証券の売買単位（当該オプション対象証券を上場する取引所金融商品市場を開設する金融商品取引所（以下「オプション対象証券上場取引所」という。）が規則により定める売買単位をいう。以下同じ。）に係る数量とする。
- 3 前項の規定にかかわらず、有価証券オプションについて、第12条第2項の規定に基づき有価証券オプション1単位のオプション対象証券の数量を調整した場合には、当該調整した数量のオプション対象証券の売買が最小単位の権利行使により成立するものとする。
- 4 有価証券オプション取引において、銘柄とは、オプション対象証券、有価証券オプション1単位のオプション対象証券の数量、権利行使日及び権利行使価格を同一とする有価証券プットオプション及び有価証券コールオプションをいうものとする。

第2節 個別証券オプション取引の対象等
(取引の対象)

第8条 個別証券オプション取引の対象は、国内の金融商品取引所に上場されている有価証券のうち、次条に定める基準に基づき本所が選定した有価証券（以下「オプション対象証券」という。）に係る次の各号に掲げる個別証券オプションとする。

- (1) 権利行使により成立する有価証券の売買において、権利行使価格で次項及び第3項に規定するオプション対象証券の数量（次号において同じ。）の売付けを成立させることができる個別証券オプション（以下「個別証券プットオプション」という。）
- (2) 権利行使により成立する有価証券の売買において、権利行使価格でオプション対象証券の数量の買付けを成立させることができる個別証券オプション（以下「個別証券コールオプション」という。）
- 2 最小単位の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数量（以下「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」という。）は、オプション対象証券の売買単位（当該オプション対象証券を上場する取引所金融商品市場を開設する金融商品取引所（以下「オプション対象証券上場取引所」という。）が規則により定める売買単位をいう。以下同じ。）に係る数量とする。
- 3 前項の規定にかかわらず、個別証券オプションについて、第12条第2項の規定に基づき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を調整した場合には、当該調整した数量のオプション対象証券の売買が最小単位の権利行使により成立するものとする。
- 4 個別証券オプション取引において、銘柄とは、オプション対象証券、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、権利行使日及び権利行使価格を同一とする個別証券プットオプション及び個別証券コールオプションをいうものとする。

(オプション対象証券の選定基準)

第9条 オプション対象証券の選定は、次の各号に定める上場有価証券の区分に従って、当該各号に定める基準のいずれかに適合する有価証券を対象として行うものとする。

(1) 株券

次のa又はbに適合すること。

a (略)

b 前a(a)に適合し、かつ、上場株式数が50万単位以上であること。

(2)・(3) (略)

2 (略)

3 第1項の規定にかかわらず、オプション対象証券の発行会社(投資法人を含む。)の企業再編(合併、株式交換、株式移転及び会社分割等をいう。以下同じ。)が行われた場合において、当該企業再編に係る新設会社又は存続会社の発行する有価証券をオプション対象証券に選定するときは、企業再編の形態及び企業再編前のオプション対象証券の売買高等を勘案するものとする。

(限月取引及びその数)

第10条 有価証券オプション取引は、有価証券オプションについて、毎月の第二金曜日の前日を取引最終日とする限月取引に区分して行うものとする。

2・3 (略)

4 前3項の規定にかかわらず、本所は、オプション対象証券を新たに選定し、当該オプション対象証券に係る有価証券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11条 有価証券オプション取引は、有価証券オプションについて、オプション対象証券ごとの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、オプション対

(オプション対象証券の選定基準)

第9条 オプション対象証券の選定は、次の各号に定める上場有価証券の区分に従って、当該各号に定める基準のいずれかに適合する有価証券を対象として行うものとする。

(1) 株券

次のa又はbに適合すること。

a (略)

b 前aの2(a)に適合し、かつ、上場株式数が50万単位以上であること。

(2)・(3) (略)

2 (略)

3 第1項の規定にかかわらず、オプション対象証券の発行会社(投資法人を含む。以下この条において同じ。)の企業再編(合併、株式交換、株式移転及び会社分割等をいう。以下同じ。)が行われた場合において、当該企業再編に係る新設会社又は存続会社の発行する有価証券をオプション対象証券に選定するときは、企業再編の形態及び企業再編前のオプション対象証券の売買高等を勘案するものとする。

(限月取引及びその数)

第10条 個別証券オプション取引は、個別証券オプションについて、毎月の第二金曜日の前日を取引最終日とする限月取引に区分して行うものとする。

2・3 (略)

4 前3項の規定にかかわらず、本所は、オプション対象証券を新たに選定し、当該オプション対象証券に係る個別証券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11条 個別証券オプション取引は、個別証券オプションについて、オプション対象証券ごとの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、オプション対

象証券1株（オプション対象証券が優先出資証券、投資信託受益証券又は投資証券の場合にあつては1口。次条、第13条及び第26条第8項第3号において同じ。）につき、指定市場（オプション対象証券上場取引所が開設する取引所金融商品市場のうちオプション対象証券の売買高等を基準として本所が指定する取引所金融商品市場をいう。以下同じ）におけるオプション対象証券の値段に基づき、次の各号に定める刻みの幅で設定する当該刻みの幅の整数倍の価格とし、当該限月取引の取引開始日に本所が定めるところにより5種類設定する。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)～(16) (略)

3 (略)

(権利行使価格等の調整)

第12条 オプション対象証券の売買において、次の各号に掲げる権利落の区分に従い、当該各号に定める日に、本所が定めるところにより、当該オプション対象証券に係る有価証券オプションについて、権利行使価格を調整するものとする。

(1)・(2) (略)

2 前項の規定に基づき権利行使価格を調整するときは、有価証券オプション1単位のオプション対象証券の数量を、本所が定めるところにより調整するものとする。ただし、オプション対象証券につき1株を1株の整数倍に分割する株式の分割が行われる場合、又は、オプション対象証券につき1株に対して1株の整数倍の同一種類の株式を割り当てる株式無償割当てが行われる場合で、調整する場合の数量がオプション対象証券の売買単位の整数倍の数量となると、オプション対象証券の発行者が人的分割を行う場合で、人的分割に係る権利落の期日の前日における当該オプション対象証券の最終値段（指定市場における当該オプション対象証券の最終の約定値段（当該指定取引所が定めるところにより気配表示された最終気配値段を含む。）をいう。ただし、その日に当該約定値段がない場合には、本所が定める値段とする。）が人的分割による権利落

象証券1株（オプション対象証券が優先出資証券、投資信託受益証券又は投資証券の場合にあつては1口。次条、第13条及び第26条第8項第2号において同じ。）につき、指定市場（オプション対象証券上場取引所が開設する取引所金融商品市場のうちオプション対象証券の売買高等を基準として本所が指定する取引所金融商品市場をいう。以下同じ）におけるオプション対象証券の値段に基づき、次の各号に定める刻みの幅で設定する当該刻みの幅の整数倍の価格とし、当該限月取引の取引開始日に本所が定めるところにより5種類設定する。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)～(16) (略)

3 (略)

(権利行使価格等の調整)

第12条 オプション対象証券の売買において、次の各号に掲げる権利落の区分に従い、当該各号に定める日に、本所が定めるところにより、当該オプション対象証券に係る個別証券オプションについて、権利行使価格を調整するものとする。

(1)・(2) (略)

2 前項の規定に基づき権利行使価格を調整するときは、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を、本所が定めるところにより調整するものとする。ただし、オプション対象証券につき1株を1株の整数倍に分割する株式の分割が行われる場合、又は、オプション対象証券につき1株に対して1株の整数倍の同一種類の株式を割り当てる株式無償割当てが行われる場合で、調整する場合の数量がオプション対象証券の売買単位の整数倍の数量となると、オプション対象証券の発行者が人的分割を行う場合で、人的分割に係る権利落の期日の前日における当該オプション対象証券の最終値段（指定市場における当該オプション対象証券の最終の約定値段（当該指定取引所が定めるところにより気配表示された最終気配値段を含む。）をいう。ただし、その日に当該約定値段がない場合には、本所が定める値段とする。）が人的分割による権利落

後始値の整数倍となるときその他本所が認めるときは、当該オプション対象証券の数量の調整は行わないものとする。

- 3 前2項の規定にかかわらず、本所が必要と認める場合には、本所がその都度定める方法により有価証券オプションの権利行使価格を調整できるものとする。

(権利行使価格の特別設定)

第13条 前条第2項の規定に基づき数量の調整を行った場合には、原則として、当該限月取引について、次の各号に定める権利落の区分に従い、当該各号に定める日に、前条第1項の規定により調整した権利行使価格と区分して、オプション対象証券の売買単位に係る数量を有価証券オプション1単位とする権利行使価格の設定（以下「権利行使価格の特別設定」という。）を行う。

(1)・(2) (略)

2・3 (略)

第2節の2 国債証券先物オプション取引の対象等 (取引の対象)

第13条の2 国債証券先物オプション取引の対象は、長期国債標準物に係る次の各号に掲げる国債証券先物オプションとする。

(1) 権利行使により成立する国債証券先物取引の限月取引としてあらかじめ定められた限月取引
(以下「権利行使対象先物限月取引」という。)
において、権利行使価格で額面1億円の売付けを成立させることができる国債証券先物オプション（以下「国債証券先物プットオプション」という。）

(2) 権利行使対象先物限月取引において、権利行使価格で額面1億円の買付けを成立させることができる国債証券先物オプション（以下「国債証券先物コールオプション」という。）

2 国債証券先物オプション取引において、銘柄とは、権利行使により成立する国債証券先物取引の対象銘柄、権利行使期間満了の日及び権利行使価格を同一とする国債証券先物プットオプション及び国

後始値の整数倍となるときその他本所が認めるときは、当該オプション対象証券の数量の調整は行わないものとする。

- 3 前2項の規定にかかわらず、本所が必要と認める場合には、本所がその都度定める方法により個別証券オプションの権利行使価格を調整できるものとする。

(権利行使価格の特別設定)

第13条 前条第2項の規定に基づき数量の調整を行った場合には、原則として、当該限月取引について、次の各号に定める権利落の区分に従い、当該各号に定める日に、前条第1項の規定により調整した権利行使価格と区分して、オプション対象証券の売買単位に係る数量を個別証券オプション1単位とする権利行使価格の設定（以下「権利行使価格の特別設定」という。）を行う。

(1)・(2) (略)

2・3 (略)

(新設)

(新設)

債証券先物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13条の3 国債証券先物オプション取引は、国債証券先物プットオプション及び国債証券先物コールオプションについて、権利行使により成立する国債証券先物取引の対象銘柄ごとに、毎月の末日（休業日に当たるときは、順次繰り上げる。）に終了する取引日を取引最終日とする限月取引に区分する。

(新設)

2 前項の限月取引のうち、3月、6月、9月及び12月の前月に取引最終日が到来する限月取引（以下「四半期限月取引」という。）は、2限月取引制とし、各四半期限月取引の期間は6か月とする。この場合において、2限月取引のうち、最初に取引最終日が到来する四半期限月取引の取引最終日の終了する日の翌日の本所が定める時刻から新たな四半期限月取引を開始する。

3 第1項の限月取引のうち、3月、6月、9月及び12月以外の月の前月に取引最終日が到来する限月取引（以下「四半期限月取引以外の限月取引」という。）の期間は2か月とする。この場合において、当該限月取引の取引最終日の属する月の前月の1日（休業日に当たるときは、順次繰り下げる。以下同じ。）の終了する日の本所が定める時刻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、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。

(権利行使対象先物限月取引)

第13条の4 国債証券先物オプション取引は、各限月取引の取引最終日後最初に受渡決済期日が到来する国債証券先物取引の限月取引を権利行使対象先物限月取引として行うものとする。

(新設)

(権利行使価格及びその数)

第13条の5 国債証券先物オプション取引は、国債証券先物プットオプション及び国債証券先物コールオプションについて、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。

(新設)

2 前項に規定する権利行使価格は、権利行使により成立する国債証券先物取引の対象銘柄の額面100円につき、50銭刻みで設定する50銭の整数倍の価格とし、各限月取引の取引開始日の本所が定める時刻に本所が定めるところにより21種類設定する。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。

3 前項のほか、本所が定めるところにより、全部又は一部の限月取引について、新たな権利行使価格を設定することができる。

(取引の対象)

第14条 (略)

2 指数オプション取引における対象指数は、次の各号に掲げる指数とする。

(1) (略)

(2) 東証株価指数

(削る)

(削る)

(削る)

3 取引換算額は、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。）に係るものにあつては1,000円、東証株価指数オプション（東証株価指数に係る指数オプションをいう。以下同じ。）に係るものにあつては1万円とする。

4 (略)

(限月取引及びその数)

第15条 (略)

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) (略)

(2) 東証株価指数オプション

特定限月取引の5限月取引と特定限月取引以外の直近の3限月取引の8限月取引制とし、各限月取引の期間は、特定限月取引については1年3か月、特定限月取引以外の各限月取引に

(取引の対象)

第14条 (略)

2 指数オプション取引における対象指数は、次の各号に掲げる指数とする。

(1) (略)

(2) 日経300

(3) ハイテク指数

(4) フィナンシャル指数

(5) コンシューマー指数

3 取引換算額は、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（業種別指数に係る指数オプションをいう。以下同じ。）に係るものにあつては1,000円、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。）に係るものにあつては1万円とする。

4 (略)

(限月取引及びその数)

第15条 (略)

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) (略)

(2) 日経300オプション

特定限月取引の6限月取引と特定限月取引以外の直近の2限月取引の8限月取引制とし、各限月取引の期間は、特定限月取引については2年（3月及び9月の各限月取引については1

については4か月又は5か月とする。

(削る)

- 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、最初に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刻から新たな限月取引を開始する。

4 (略)

(権利行使価格及びその数)

第16条 (略)

- 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刻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) (略)

(2) 東証株価指数オプション

a 特定限月取引以外の限月取引（1月、4月、7月及び10月の限月取引に限る。）及び特定限月取引

指数オプション取引における東証株価指数の数値につき、50ポイント刻みで設定する50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13種類設定する。

b 特定限月取引以外の限月取引（2月、5月、8月及び11月の限月取引に限る。）

指数オプション取引における東証株価指数の数値につき、25ポイント刻みで設定する25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19種類設定する。

(削る)

年）、特定限月取引以外の各限月取引については3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、各特定限月取引については8か月、特定限月取引以外の各限月取引については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、最初に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 (略)

(権利行使価格及びその数)

第16条 (略)

- 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) (略)

(2) 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、特定限月取引にあつては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つては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。

(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

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) (略)

(2) 東証株価指数オプション

a 特定限月取引以外の限月取引（1月、4月、7月及び10月の限月取引に限る。）及び特定限月取引

(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限月取引
50ポイント刻みで設定する50ポイントの整数倍の数値

(b) 前(a)に掲げる限月取引以外の限月取引
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 特定限月取引以外の限月取引（2月、5月、8月及び11月の限月取引に限る。）
25ポイント刻みで設定する25ポイントの整数倍の数値

(削る)

(ストラテジー取引)

の数値につき、特定限月取引にあつては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つては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) (略)

(2) 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

(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17条 取引参加者（先物取引等取引参加者（取引参加者規程第2条第2項に規定する先物取引等取引参加者をいう。以下同じ。）又は国債先物等取引参加者（取引参加者規程第2条第3項に規定する国債先物等取引参加者をいう。以下同じ。）をいう。第41条及び第54条を除き、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、市場デリバティブ取引に係る複数の限月取引又は銘柄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市場デリバティブ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。ただし、オプション取引に係るストラテジー取引については、この限りでない。

3・4 （略）

（立会の区分及び取引時間等）

第18条 競争売買市場（本所の市場のうち立会による市場デリバティブ取引を行う市場をいう。）における市場デリバティブ取引（以下この章から第5章までにおいて単に「市場デリバティブ取引」という。）の立会の区分及び各立会の取引時間は、次の各号に掲げる市場デリバティブ取引の区分に従い、当該各号に定めるところによる。

(1) 国債証券先物取引及び国債証券先物オプション取引

午前立会、午後立会及び夜間立会に分ち、各立会の取引時間は、次のaからcまでに掲げる立会の区分に従い、当該aからcまでに定めるところによる。

a 午前立会

(a) オープニング・オークション

午前8時45分とする。

(b) レギュラー・セッション

午前8時45分から11時までとする。

(c) クロージング・オークション

第17条 取引参加者（取引参加者規程第2条第2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、市場デリバティブ取引に係る複数の限月取引又は銘柄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市場デリバティブ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・4 （略）

（立会の区分及び取引時間等）

第18条 競争売買市場（本所の市場のうち立会による市場デリバティブ取引を行う市場をいう。）における市場デリバティブ取引（以下この章から第5章までにおいて単に「市場デリバティブ取引」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。ただし、日経平均V Iを対象とする指数先物取引及び個別証券オプション取引の立会は、日中立会のみとする。

(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

午前11時2分とする。

b 午後立会

(a) オープニング・オークション

午後0時30分とする。

(b) レギュラー・セッション

午後0時30分から3時までとする。

(c) クロージング・オークション

午後3時2分とする。

c 夜間立会

(a) オープニング・オークション

午後3時30分とする。

(b) レギュラー・セッション

午後3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) 指数先物取引及び指数オプション取引

日中立会及び夜間立会に分ち、各立会の取引時間は、次のa及びbに掲げる立会の区分に従い、当該a及びbに定めるところによる。ただし、日経平均V Iを対象とする指数先物取引の立会は、日中立会のみとする。

a 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。

b 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。

(3) 有価証券オプション取引

午前立会及び午後立会に分ち、各立会の取引時間は、次のa及びbに掲げる立会の区分に

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。

従い、当該 a 及び b に定めるところによる。

a 午前立会

(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 11 時 30 分までとする。

(c) クロージング・オークション

午前 11 時 35 分とする。

b 午後立会

(a) オープニング・オークション

午後 0 時 30 分とする。

(b) レギュラー・セッション

午後 0 時 30 分から 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 (略)

(立会の臨時停止、臨時挙行)

第 20 条 (略)

(売買システムによる取引等)

第 22 条 (略)

2 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) 日経平均オプション

1,000 円を 1 円として行う。

(2) 東証株価指数オプション

1 万円を 1 ポイントとして行う。

(個別競争取引)

第 24 条 (略)

2 レギュラー・セッションにおける個別競争取引は、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(約定数値(第 4 条第 5 号 a (b) 又は同号 b に規定する約定数値をいう。))を含む。以下この章において同じ。)とし、

2 (略)

(売買立会の臨時停止、臨時挙行)

第 20 条 (略)

(売買システムによる取引等)

第 22 条 (略)

2 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。

(2) 日経 300 オプション

1 万円を 1 ポイントとして行う。

(個別競争取引)

第 24 条 (略)

2 レギュラー・セッションにおける個別競争取引は、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(指数先物取引に係る約定数値を含む。以下この章において同じ。)とし、前条第 2 項に定める呼値の順位に従っ

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・4 (略)

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、本所が定める基準となる値段を基準として、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・7 (略)

(呼 値)

第26条 (略)

2 (略)

3 取引参加者は、次の各号に掲げる市場デリバティブ取引の区分に従い、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) 国債証券先物取引及び国債証券先物オプション取引

a 午前立会

(a) オープニング・オークション

午前8時から8時45分までの間

(b) レギュラー・セッション

午前8時45分から11時までの間

(c) クロージング・オークション

午前11時から11時2分までの間

b 午後立会

(a) オープニング・オークション

午後0時5分から0時30分までの間

(b) レギュラー・セッション

午後0時30分から3時までの間

(c) クロージング・オークション

午後3時から3時2分までの間

c 夜間立会

(a) オープニング・オークション

午後3時25分から3時30分までの間

(b) レギュラー・セッション

午後3時30分から翌日の午前2時55分までの間

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・4 (略)

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・7 (略)

(呼 値)

第26条 (略)

2 (略)

3 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

(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

(2) 指数先物取引及び指数オプション取引

a 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

b 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

(3) 有価証券オプション取引

a 午前立会

(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11時30分までの間

(c) クロージング・オークション

午前11時30分から11時35分までの間

b 午後立会

(a) オープニング・オークション

午後0時5分から0時30分までの間

(b) レギュラー・セッション

午後0時30分から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

4 (略)

5 本所は、第3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より記録するものとする。

6・7 (略)

8 呼値の単位は、次の各号に掲げる市場デリバティブ取引の区分に従い、当該各号に定めるところに

4 (略)

5 本所は、前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より記録するものとする。

6・7 (略)

8 呼値の単位は、次の各号に掲げる市場デリバティブ取引の区分に従い、当該各号に定めるところに

よる。

(1) 国債証券先物取引

a Large取引

額面100円につき1銭とする。ただし、超長期国債標準物に係るLarge取引については、額面100円につき5銭とする。

b Mini取引

5厘とする。

(2) 指数先物取引

a (略)

b 東証株価指数

(a) Large取引

0.5ポイントとする。ただし、ストラテジー取引については、0.1ポイントとする。

(b) Mini取引

0.25ポイントとする。ただし、ストラテジー取引については、0.05ポイントとする。

c RNP指数、TOPIX Core30及び東証REIT指数

0.5ポイントとする。ただし、ストラテジー取引については、0.1ポイントとする。

d 東証銀行業株価指数

0.1ポイントとする。

e NYダウ及びCNX Nifty

1ポイントとする。

f (略)

g 日経平均・配当指数

0.1円とする。

h TOPIX配当指数及びTOPIX Core30配当指数

0.01ポイントとする。

(3) 有価証券オプション取引

a オプション対象証券1株につき、有価証券オプション取引の呼値の値段に応じて、次に定めるところによる。ただし、ストラテジー取引については、10銭とする。

呼値の値段

呼値の単位

50円未満の場合

10銭

50円以上

1,000円 //

50銭

1,000円 //

3,000円 //

1円

よる。

(新設)

(1) 指数先物取引

a (略)

b 日経300

0.1ポイントとする。

c 業種別指数

5円とする。

d MSCI JAPAN及びRNP指数

0.5ポイントとする。ただし、RNP指数に係るストラテジー取引については、0.1ポイントとする。

e NYダウ

1ポイントとする。

f (略)

(新設)

(新設)

(2) 個別証券オプション取引

オプション対象証券1株につき、個別証券オプション取引の呼値の値段に応じて、次に定めるところによる。

呼値の値段

呼値の単位

20円未満の場合

10銭

20円以上

50円 //

50銭

50円 //

100円 //

1円

<u>3,000円</u> //	<u>3万円</u> //	<u>5円</u>
<u>3万円</u> //	<u>5万円</u> //	<u>25円</u>
<u>5万円</u> //	<u>10万円</u> //	<u>50円</u>
<u>10万円</u> //	<u>100万円</u> //	<u>500円</u>
<u>100万円以上の場合</u>		<u>5,000円</u>

b 売買単位の数が奇数であるオプション対象証券に係る有価証券オプション取引における前 a の規定の適用については、有価証券オプション取引の呼値の値段が50円未満の場合の呼値の単位について「10銭」とあるのは「1円」と、50円以上1,000円未満の場合の呼値の単位について「50銭」とあるのは「1円」とする。ただし、当該オプション対象証券に係るストラテジー取引については、1円とする。

(4) 国債証券先物オプション取引

権利行使により成立する国債証券先物取引の対象銘柄の額面100円につき、1銭とする。

(5) 指数オプション取引

a (略)

b 東証株価指数オプション

呼値が20ポイント以下の場合は0.1ポイント、20ポイントを超える場合は0.5ポイントとする。ただし、ストラテジー取引については0.1ポイントとする。

(削る)

9 国債証券先物取引に係るLarge取引の呼値は、裸相場とする。

10 (略)

11 取引参加者は、呼値を行おうとするときは、新規の売付け若しくは新規の買付け又は転売若しくは買戻しの別を明らかにすることを要しない。

<u>100円</u> //	<u>200円</u> //	<u>2円</u>
<u>200円</u> //	<u>500円</u> //	<u>5円</u>
<u>500円</u> //	<u>1,000円</u> //	<u>10円</u>
<u>1,000円</u> //	<u>2,000円</u> //	<u>20円</u>
<u>2,000円</u> //	<u>5,000円</u> //	<u>50円</u>
<u>5,000円</u> //	<u>1万円</u> //	<u>100円</u>
<u>1万円</u> //	<u>2万円</u> //	<u>200円</u>
<u>2万円</u> //	<u>5万円</u> //	<u>500円</u>
<u>5万円</u> //	<u>10万円</u> //	<u>1,000円</u>
<u>10万円</u> //	<u>20万円</u> //	<u>2,000円</u>
<u>20万円</u> //	<u>50万円</u> //	<u>5,000円</u>
<u>50万円</u> //	<u>100万円</u> //	<u>1万円</u>
<u>100万円以上の場合</u>		<u>2万円</u>

(新設)

(新設)

(3) 指数オプション取引

a (略)

b 日経300オプション

0.1ポイントとする。

c 業種別指数オプション

5円とする。

(新設)

9 (略)

(新設)

12 (略)

(インプライド機能)

第28条 (略)

2 第23条の規定にかかわらず，前項の市場デリバティブ取引における呼値の順位は，本所がその都度定める。

(取引単位)

第29条 取引単位は，次の各号に掲げる市場デリバティブ取引の区分に従い，当該各号に定めるところによる。

(1) 国債証券先物取引

a Large取引

額面1億円とする。

b Mini取引

10万円に長期国債標準物の価格の数値を乗じて得た額を1単位として行う。

(2) 指数先物取引

次のaからeまでに掲げる取引対象指数の区分に従い，当該aからeまでに定める額に取引対象指数の数値を乗じて得た額を1単位として行う。

a (略)

b 東証株価指数

(a) Large取引

1万円

(b) Mini取引

1,000円

c RNP指数，東証銀行業株価指数，日経平均V I，TOPIX配当指数及びTOPIX Core30配当指数
1万円

d TOPIX Core30，東証REIT指数及び日経平均・配当指数

1,000円

e NYダウ及びCNX Nifty

100円

(3) 有価証券オプション取引

有価証券プットオプション又は有価証券コールオプション1単位を最小単位として行う。

10 (略)

(インプライド機能)

第28条 (略)

(新設)

(取引単位)

第29条 取引単位は，次の各号に掲げる市場デリバティブ取引の区分に従い，当該各号に定めるところによる。

(新設)

(1) 指数先物取引

次のaからcまでに掲げる取引対象指数の区分に従い，当該aからcまでに定める額に取引対象指数の数値を乗じて得た額を1単位として行う。

a (略)

(新設)

b 日経300，MSCI JAPAN，RNP指数及び日経平均V I

1万円

c 業種別指数

1,000円

d NYダウ

100円

(2) 個別証券オプション取引

個別証券プットオプション又は個別証券コールオプション1単位を最小単位として行う。

(4) 国債証券先物オプション取引

国債証券先物プットオプション又は国債証券先物コールオプション1単位を最小単位として行う。

(5) (略)

(取引の一時中断)

第33条 本所は、レギュラー・セッションにおける先物取引（Mini取引を除く。）の中心限月取引（対象銘柄（取引対象とする国債証券の標準物をいう。以下同じ。）又は取引対象指数が当該中心限月取引と同一の先物取引の限月取引のうち流動性が最も集中しているものとして本所が指定する限月取引をいう。以下同じ。）において、売呼値又は買呼値が次の各号に定める値段で行われた後、本所が定める一定の時間が経過するまでの間に本所が定める値幅外の値段で取引（ストラテジー取引を除く。）が成立しない場合には、その直後の本所がその都度定める時から本所が適当と認める時間を経過するまでの間、対象銘柄又は取引対象指数が当該中心限月取引と同一の先物取引について一時中断を行う。ただし、本所が定める場合その他取引の状況等を勘案して取引の一時中断を行うことが適当でないと本所が認める場合には、取引の一時中断を行わない。

(1) 売呼値にあつては、第26条第10項の規定により定める値幅の限度（以下「呼値の制限値幅」という。）の下限の値段（次項の規定により呼値の制限値幅を拡大した場合における拡大後の下限の値段を含む。）

(2) 買呼値にあつては、呼値の制限値幅の上限の値段（次項の規定により呼値の制限値幅を拡大した場合における拡大後の上限の値段を含む。）

(新設)

(3) (略)

(取引の一時中断)

第33条 本所は、レギュラー・セッションにおける指数先物取引の中心限月取引（取引対象指数が当該中心限月取引と同一の指数先物取引の限月取引のうち流動性が最も集中しているものとして本所が指定する限月取引をいう。以下同じ。）において次の各号のいずれかに該当した場合には、当該各号に該当した直後の本所がその都度定める時から本所が適当と認める時間を経過するまでの間、取引対象指数が当該中心限月取引と同一の指数先物取引について一時中断を行う。ただし、本所が定める場合その他取引の状況等を勘案して取引の一時中断を行うことが適当でないと本所が認める場合には、取引の一時中断を行わない。

(1) 立会において、第26条第9項の規定により定める値幅の限度（以下「呼値の制限値幅」という。）の下限の値段（次項の規定により呼値の制限値幅の下限を1回拡大した場合における拡大後の下限の値段を含む、同項の規定により呼値の制限値幅の下限を2回拡大した場合における拡大後の下限の値段を除く。次号において同じ。）で取引が成立した場合（ストラテジー取引により取引が成立した場合を除く。第3号及び第4項において同じ。）

(2) 呼値の制限値幅の下限の値段に売呼値が提示された場合であつて、かつ、当該売呼値が提示されてから本所が定める時間を経過してもなお取引が成立しない場合

(3) 立会において、呼値の制限値幅の上限の値段

2 本所は、前項の規定により取引を一時中断する場合には、対象銘柄又は取引対象指数が当該中心限月取引と同一の先物取引について、次の各号に定めるところにより呼値の制限値幅を拡大する。

(1) 前項第1号に該当する場合

呼値の制限値幅の下限を本所が定めるところにより拡大する。

(2) 前項第2号に該当する場合

呼値の制限値幅の上限を本所が定めるところにより拡大する。

3 本所は、長期国債標準物に係るLarge取引について第1項の規定により取引を一時中断した場合には、取引を中断している間、国債証券先物取引に係るMini取引について、取引を一時中断する。この場合において、当該Mini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。

4 本所は、国債証券先物取引又は指数先物取引について第1項の規定により取引を一時中断した場合には、取引を中断している間、対象銘柄が当該国債証券先物取引と同一の国債証券先物オプション取引又は当該指数先物取引の取引対象指数と同一の対象指数に係る指数オプション取引について、取引を一時中断する。この場合において、当該国債証券先物オプション取引又は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。

(次項の規定により呼値の制限値幅の上限を1回拡大した場合における拡大後の上限の値段を含み、同項の規定により呼値の制限値幅の上限を2回拡大した場合における拡大後の上限の値段を除く。次号において同じ。)で取引が成立した場合

(4) 呼値の制限値幅の上限の値段に買呼値が提示された場合であって、かつ、当該買呼値が提示されてから本所が定める時間を経過してもなお取引が成立しない場合

2 本所は、前項各号のいずれかに該当したことにより取引を一時中断する場合には、取引対象指数が当該中心限月取引と同一の指数先物取引について、次の各号に定めるところにより呼値の制限値幅を拡大する。この場合において、本所は、当該指数先物取引の取引対象指数と同一の対象指数に係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。

(1) 前項第1号又は第2号に該当した場合

呼値の制限値幅の下限を本所が定めるところにより拡大する。

(2) 前項第3号又は第4号に該当した場合

呼値の制限値幅の上限を本所が定めるところにより拡大する。

(新設)

3 本所は、指数先物取引について第1項の規定により取引を一時中断した場合には、取引を中断している間、当該指数先物取引の取引対象指数と同一の対象指数に係る指数オプション取引について、取引を一時中断する。この場合において、当該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。

5 本所は、市場デリバティブ取引に係る各限月取引又は各銘柄について、本所が定める基準となる値段（次項において「基準値段」という。）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、当該限月取引又は当該銘柄の取引を一時中断する。

6 前項の規定により取引を一時中断した場合（この規定により取引を一時中断した場合を含む。）において、本所が適当と認める時間の経過後に、基準値段から本所が定める値幅外の値段で呼値が対当しているときは、当該値幅の限度の値段に本所が定めるところにより当該基準値段を更新し、本所が適当と認める時間の間、取引の一時中断を継続する。

7 （略）

第4章の2 移管取引

（移管取引）

第33条の2 この規程において提携外国取引所とは、外国金融商品市場（取引所金融商品市場に類似する市場で外国に所在するものをいう。）を開設する者で、本所と移管取引（第33条の4第2項に規定する移管取引をいう。以下同じ。）に係る取り極めを締結している本所が定める者をいう。

2 この規程において提携外国清算機関とは、提携外国取引所で行われる提携外国市場デリバティブ取引に係る金融商品債務引受業と同種類の業務を行う者をいう。

3 この規程において提携外国取引所等とは、提携外国取引所又は提携外国清算機関をいう。

4 この規程において提携外国市場デリバティブ取引とは、提携外国取引所で行われる外国市場デリバティブ取引であって、本所が定める取引をいう。

5 この規程において外国清算参加者とは、提携外国取引所等の清算参加者をいう。

6 この規程においてメンバーリンク契約とは、移管取引を成立させるために、本所が定める様式により、取引参加者と外国清算参加者との間で締結され

4 本所は、市場デリバティブ取引に係る各限月取引又は各銘柄について、立会における直前の約定値段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、当該限月取引又は当該銘柄の取引を一時中断する。

（新設）

5 （略）

（新設）

（新設）

る契約をいう。

(メンバーリンク契約の締結等の届出)

第33条の 3 取引参加者は、外国清算参加者とメンバーリンク契約を締結しようとするときは、本所が定めるところにより、あらかじめ本所に届け出なければならない。

(新設)

2 取引参加者は、メンバーリンク契約の解約又は変更を行おうとするときは、当該解約又は変更を行おうとする日の5営業日前までに、その内容を本所に届け出なければならない。

(移管取引の成立)

第33条の 4 提携外国取引所等から提携外国市場デリバティブ取引に係る決済が未了である約定(以下「外国建玉」という。)の明細が本所に送信された場合には、本所は、当該明細の内容について本所が定める事項を確認する。

(新設)

2 本所が、前項に規定する明細の内容の確認及び承認を行ったとき、移管取引(当該明細に記載されるところに従い、本所が定める市場デリバティブ取引を、外国清算参加者とメンバーリンク契約を締結する取引参加者の名において立会による取引によらずに成立させることをいう。以下同じ。)が成立する。

3 前項に規定する移管取引により成立する市場デリバティブ取引の約定値段は、本所が定める値段とする。

4 本所は、第2項に規定する明細の内容の確認及び承認を行ったときは、その旨を提携外国取引所等に通知する。

5 本所は、次の各号に掲げる場合には、第2項に規定する承認を行わないことができる。この場合にあっては、当該取引日における移管取引は一切成立しない。

(1) 各取引日の本所が定める時間までに、本所が第1項に規定する明細の内容について本所が定める事項を確認できない場合

(2) 第1項に規定する明細に、本所の市場における移管取引の対象となる市場デリバティブ取引

(有価証券等清算取次ぎによるものを除く。)
又は有価証券等清算取次ぎの委託の停止を受けて
いる取引参加者が記載されている場合
(3) その他本所が移管取引の成立が適当でないと
認めた場合

(移管取引により成立する市場デリバティブ取引の
内容の通知等)

第33条の5 第31条の規定にかかわらず、本所は、
前条第2項の規定に基づき移管取引が成立したと
きは当該移管取引により成立した市場デリバティ
ブ取引の内容を、同条第5項の規定に基づき移管取
引が成立しないときはその旨を、取引参加者に対し
て通知する。

(新設)

2 取引参加者は、移管取引により成立した市場デ
リバティブ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。

(自己又は委託の別の申告)

第33条の6 取引参加者は、移管取引が成立したと
きは、当該移管取引により成立した市場デリバティ
ブ取引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、本所が定める時限までに、本所
に対して申告するものとする。

(新設)

2 本所は、前項に規定する申告が行われない市場
デリバティブ取引については顧客の委託に基づく
取引であるものとみなす。

第5章の2 権利行使による国債証券先物取引の成
立

(新設)

(権利行使による国債証券先物取引の成立)

第34条の2 国債証券先物オプション取引における
権利行使の申告が行われた場合には、当該申告が行
われた日の本所が定める時刻に当該権利行使の意
思表示が行われたものとみなして、当該時刻に国債
証券先物取引が成立するものとする。

(新設)

第6章 受渡決済、最終決済等
第1節 国債証券先物取引における受渡決済等

第6章 最終決済等
(新設)

第1款 Large取引における受渡決済

(新設)

(受渡決済)

第34条の3 Large取引の各限月取引について、最終
売建玉(売建玉のうち、取引最終日までの間に買戻
しが行われなかったものをいう。以下同じ。)又は
最終買建玉(買建玉のうち取引最終日までの間に転
売が行われなかったものをいう。以下同じ。)につ
いては、当該限月取引の受渡決済期日において当該
最終売建玉及び当該最終買建玉の受渡決済(受渡決
済代金及び国債証券を授受することにより決済す
ることをいう。以下同じ。)を行う。

(新設)

(受渡適格銘柄)

第34条の4 受渡決済においては、次の各号に掲げ
る国債証券(以下「受渡適格銘柄」という。)を決
済物件として取り扱うものとする。

(新設)

(1) 中期国債標準物については、発行日(利付国債
証券について、同一の名称及び記号を有し、か
つ、先に発行された利付国債証券がある場合に
は、当該同一の名称及び記号を有し、かつ、先
に発行された利付国債証券のうち、発行日が最
初であるものの発行日。以下同じ。)及び受渡
決済期日に4年以上5年3か月未満の残存期間
を有する利付国債証券(国債証券として発行さ
れたものであって、かつ、国債募集引受団によ
る募集引受けの方法、入札の方法その他発行に
際して不特定多数の者による取得を前提とする
方法によりその発行総額の全部又は一部が発行
されたものに限る。以下同じ。)のうち、発行
日の属する月が受渡決済期日の属する月の3か
月前の月以前のもの

(2) 長期国債標準物については、発行日及び受渡決
済期日に7年以上11年未満の残存期間を有する
利付国債証券のうち、発行日の属する月が受渡
決済期日の属する月の3か月前の月以前のもの

(3) 超長期国債標準物については、発行日及び受渡
決済期日に18年以上21年未満の残存期間を有す
る利付国債証券のうち、発行日の属する月が受
渡決済期日の属する月の3か月前の月以前のも
の

(標準物と受渡適格銘柄との交換比率の算定)

第34条の5 標準物と受渡適格銘柄との交換比率 (新設)
は、別表「標準物と受渡適格銘柄との交換比率の算定に関する表」により算定するものとする。

(受渡決済値段)

第34条の6 受渡決済において授受する受渡決済代 (新設)
金を算出するための基準とする値段（以下「受渡決済値段」という。）は、当該限月取引の取引最終日の清算値段（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。）が国債証券先物取引の清算値段として定める値段をいう。）とする。

(受渡決済代金の算出方法)

第34条の7 受渡決済における受渡決済代金は、受 (新設)
渡決済値段に受渡適格銘柄ごとの交換比率を乗じて得た額に、当該受渡適格銘柄の額面総額の100分の1を乗じて算出するものとする。

(利子の日割計算)

第34条の8 受渡決済においては、最終売建玉に係 (新設)
る受渡適格銘柄ごとの国債証券の額面総額に当該受渡適格銘柄の利率を乗じて算出した額を、日割をもって計算し、その受渡決済期日までの分（以下「経過利子」という。）を前条の規定に基づき算出した受渡決済代金に加算するものとする。ただし、その受渡決済期日が当該受渡適格銘柄の利払期日に当たるときは、経過利子を受渡決済代金に加算しないものとする。

2 前項の経過利子は、課税扱いと非課税扱いに区分して取り扱うものとし、課税扱いの経過利子は、経過利子の計算に当たって利子から税額相当額として本所が定める額を差し引くものとする。

第2款 Mini取引における最終決済

(新設)

(最終決済)

第34条の9 Mini取引の各限月取引について、取引 (新設)
最終日までの間に転売又は買戻しが行われなかつ

た建玉については、次条に基づき最終清算数値を定める日の翌日（以下「最終決済期日」という。）に同条に規定する最終清算数値による決済（以下「最終決済」という。）を行う。

（最終清算数値）

第34条の10 最終清算数値は、Mini取引の当該限月取引の取引最終日の終了する日の翌日に定めるものとし、当該限月取引と取引最終日の属する月を同一とする長期国債標準物に係るLarge取引の限月取引に係る立会開始時の約定値段（当該Large取引の限月取引において取引最終日の終了する日の翌日の立会開始時に約定値段がない場合は本所が定める値段）とする。ただし、当該Large取引の限月取引の立会が停止された場合において必要と認めるときは、最終清算数値は、本所がその都度定める日に、本所がその都度定める。

第1節の2 指数先物取引の最終決済

（最終決済）

第35条 取引参加者は、指数先物取引の各限月取引について取引最終日までの間に転売又は買戻しが行われなかった建玉については、当該限月取引の最終決済期日に次条に規定する最終清算数値による決済を行うものとする。

（最終清算数値）

第36条 最終清算数値は、取引最終日の終了する日の翌日に定めるものとし、次の各号に掲げる取引対象指数の区分に従い、当該各号に定めるところにより算出した特別な指数（以下「特別清算数値」という。）とする。

(1) 日経平均、東証株価指数、TOPIX Core30、東証銀行業株価指数及び東証REIT指数

取引最終日の終了する日の翌日における東京証券取引所が開設する取引所金融商品市場における各構成銘柄の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

（新設）

第1節 指数先物取引の最終決済

（最終決済）

第35条 取引参加者は、指数先物取引の各限月取引について取引最終日までの間に転売又は買戻しが行われなかった建玉については、当該限月取引の最終決済期日に次条に規定する最終清算数値による決済（以下「最終決済」という。）を行うものとする。

（最終清算数値）

第36条 最終清算数値は、取引最終日の終了する日の翌日に定めるものとし、次の各号に掲げる取引対象指数の区分に従い、当該各号に定めるところにより算出した特別な指数（以下「特別清算数値」という。）とする。

(1) 日経平均、日経300及び業種別指数

取引最終日の終了する日の翌日における東京証券取引所が開設する取引所金融商品市場における各構成銘柄の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

づき算出した指数

(2) RNP指数

取引最終日の終了する日の翌日における主たる取引所金融商品市場（指数算出者が当該取引対象株価指数の算出のために株価を採用している取引所金融商品市場をいう。次項第2号において同じ。）における各構成銘柄の売買の始めの約定値段（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）に基づき算出した株価指数

(3) NYダウ

本国取引（The Board of Trade of the City of Chicago, Inc.（以下「CBOT」という。）が開設する外国金融商品市場において取引されているNYダウを対象とした指数先物取引に類似の取引であって、取引最終日の属する月が本所NYダウ先物取引（本所が開設する金融商品市場において取引されているNYダウを対象とする指数先物取引をいう。）における限月取引と同じ限月取引をいう。）の最終清算数値としてS&P Dow Jones Indices LLCが算出する指数

(4) CNX Nifty

本国取引（NSEが開設する外国金融商品市場において取引されているCNX Niftyを対象とした指数先物取引に類似の取引であって、取引最終日の属する月が本所CNX Nifty先物取引（本所が開設する金融商品市場において取引されているCNX Niftyを対象とする指数先物取引をいう。）における限月取引と同じ限月取引をいう。）の最終清算数値としてIISLが算出する指数

(5) (略)

(6) 配当指数

各構成銘柄に係る配当（取引最終日の終了する日が属する年の前年に基準日が到来した配当に限る。）の額に基づき算出した指数の最終の値として本所が定める指数

2 前項の規定にかかわらず、次の各号に掲げる取引対象指数の区分に従い、当該各号のいずれかに該当した場合で本所が必要と認めるときにおける最終清算数値は、本所がその都度定める日に、本所が

づき算出した株価指数

(2) MSCI JAPAN及びRNP指数

取引最終日の終了する日の翌日における主たる取引所金融商品市場（指数算出者が当該取引対象株価指数の算出のために株価を採用している取引所金融商品市場をいう。以下同じ。）における各構成銘柄の売買の始めの約定値段（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）に基づき算出した株価指数

(3) NYダウ

本国取引（The Board of Trade of the City of Chicago, Inc.（以下「CBOT」という。）が開設する外国金融商品市場において取引されているNYダウを対象とした指数先物取引に類似の取引であって、取引最終日の属する月が当社NYダウ先物取引（当社が開設する金融商品市場において取引されているNYダウを対象とする指数先物取引をいう。）においてCBOTが定めた最終清算数値と同じ値

（新設）

(4) (略)

（新設）

2 前項の規定にかかわらず、次の各号に掲げる取引対象指数の区分に従い、当該各号のいずれかに該当した場合で本所が必要と認めるときにおける最終清算数値は、本所がその都度定める日に、本所が

その都度定める。

(1) 日経平均、東証株価指数、TOPIX Core30、東証銀行業株価指数及び東証REIT指数

取引最終日の終了する日の翌日に東京証券取引所が開設する取引所金融商品市場における有価証券の売買立会が停止された場合（東京証券取引所の業務規程第29条第3号又は第4号の規定により有価証券の売買が停止された場合を含む。）

(2) RNP指数

取引最終日の終了する日の翌日に主たる取引所金融商品市場における株券の売買が停止された場合（東京証券取引所の業務規程第29条第3号又は第4号の規定（主たる取引所金融商品市場を開設する者が定める当該規定に相当する規定を含む。）により株券の売買が停止された場合を含む。）

(3) (略)

3・4 (略)

(権利行使日等)

第37条 有価証券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とし、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 国債証券先物オプション取引における権利行使期間は、各銘柄の取引開始日から取引最終日の終了する日までとする。

3 前2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又は権利行使期間を変更することができる。

4 有価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買に係る決済は、権利行使日から起算して5日目（休業日を除外する。以下日数計算について同じ。）の日に行うものとする。ただし、権利行使日がオプション対象証券の売買に係る配当落等の期日（指定取引所が定める配当落等の期日であって、普通取引に係るものに限る。）若しくは株式併合後の株券の売買開始の期日（指定取引所が定める株式併合後の株券（投資信託受益証券及

その都度定める。

(1) 日経平均、日経300及び業種別指数

取引最終日の終了する日の翌日に東京証券取引所が開設する取引所金融商品市場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。）

(2) MSCI JAPAN及びRNP指数

取引最終日の終了する日の翌日に主たる取引所金融商品市場における株券の売買が停止された場合（東京証券取引所の業務規程第29条第3号又は第4号の規定（主たる取引所金融商品市場を開設する者が定める当該規定に相当する規定を含む。）により株券の売買が停止された場合を含む。）

(3) (略)

3・4 (略)

(権利行使日等)

第37条 個別証券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とし、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。

(新設)

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 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買に係る決済は、権利行使日から起算して5日目（休業日を除外する。以下日数計算について同じ。）の日に行うものとする。ただし、権利行使日がオプション対象証券の売買に係る配当落等の期日（指定取引所が定める配当落等の期日であって、普通取引に係るものに限る。）若しくは株式併合後の株券の売買開始の期日（指定取引所が定める株式併合後の株券の売買開始の期日で

び投資証券を含む。以下同じ。)の売買開始の期日であって、普通取引に係るものに限る。)の前日に当たるときは、当該権利行使日から起算して4日目の日において、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に係る決済を行う。

5 (略)

(オプションの消滅)

第39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有価証券オプション及び指数オプションは、本所が定める時限に消滅するものとする。

2 権利行使期間満了の日 (第37条第2項に規定する権利行使期間の満了の日をいう。以下同じ。)において、権利行使の申告が行われなかった国債証券先物オプションは、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40条 (略)

2 前項のオプション清算数値は、権利行使日における対象指数の各構成銘柄の東京証券取引所が開設する取引所金融商品市場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。

3～5 (略)

(権利行使に伴う貸借取引)

第41条 取引参加者 (先物取引等取引参加者であって、東京証券取引所の総合取引参加者である者に限る。次項において同じ。)は、有価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買(制度信用取引に基づくもの又は自己の信用売り若しくは信用買いに係るものに限る。)に係る決済(第12条第2項前段に規定するオプション対象証券の数量の売買が成立する権利行使である場合には、清算・決済規程第17条第1項第2号b及び第3号又はクリアリング機構の業務方法書第55条第1項第1号b及び第2号に規定する金銭の授受を除

あって、普通取引に係るものに限る。)の前日に当たるときは、当該権利行使日から起算して4日目の日において、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に係る決済を行う。

4 (略)

(オプションの消滅)

第39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オプションは、本所が定める時限に消滅するものとする。

(新設)

(オプション清算数値)

第40条 (略)

2 前項のオプション清算数値は、権利行使日における対象指数の各構成銘柄の東京証券取引所が開設する取引所金商品市場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。

3～5 (略)

(権利行使に伴う貸借取引)

第41条 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に限る。)は、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買(制度信用取引に基づくもの又は自己の信用売り若しくは信用買いに係るものに限る。)に係る決済(第12条第2項前段に規定するオプション対象証券の数量の売買が成立する権利行使である場合には、清算・決済規程第17条第1項第2号b及び第3号又は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。)の業務方法書第55条第1項第1号b及び第2号に規定する

く。)のために貸借取引を行うことができる。

2・3 (略)

(ギブアップ)

第42条 (略)

2 (略)

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市場デリバティブ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、当該消滅した市場デリバティブ取引の売付け又は買付けと同一内容の市場デリバティブ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(取引参加者規程第24条第2項に規定する国債先物等非清算参加者又は同条第3項に規定する指数先物等非清算参加者をいう。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国債先物等他社清算参加者(国債先物等清算資格(クリアリング機構の業務方法書に規定する国債先物等清算資格をいう。))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。以下同じ。))を有する者をいう。)又は指数先物等他社清算参加者(指数先物等清算資格(クリアリング機構の業務方法書に規定する指数先物等清算資格をいう。))に係る他社清算資格を有する者をいう。)をいう。)の名において当該清算執行取引参加者の計算により、当該消滅した市場デリバティブ取引の売付け又は買付けと同一内容の市場デリバティブ取引の売付け又は買付けが、本所と当該指定指数先物等清算参加者との間に新たに発生するものとする。

(本所の市場における市場デリバティブ取引の方法等)

第51条 (略)

2 取引参加者は、取引参加者端末装置と売買システムの接続においては、接続仕様その他の本所が定

金銭の授受を除く。)のために貸借取引を行うことができる。

2・3 (略)

(ギブアップ)

第42条 (略)

2 (略)

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市場デリバティブ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、当該消滅した市場デリバティブ取引の売付け又は買付けと同一内容の市場デリバティブ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指数先物等非清算参加者(取引参加者規程第24条第2項に規定する指数先物等非清算参加者をいう。以下同じ。)である場合には、その指定指数先物等清算参加者(当該指数先物等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指数先物等他社清算参加者(指数先物等清算資格(クリアリング機構の業務方法書に規定する指数先物等清算資格をいう。))を有する者をいう。))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、当該消滅した市場デリバティブ取引の売付け又は買付けと同一内容の市場デリバティブ取引の売付け又は買付けが、本所と当該指定指数先物等清算参加者との間に新たに発生するものとする。

(本所の市場における市場デリバティブ取引の方法等)

第51条 (略)

(新設)

める事項を遵守しなければならない。

3 取引参加者は、本所が定めるところにより取引参加者端末装置に関する事項について本所に報告するとともに、売買システムが安定的に稼働するよう協力するものとする。

4 取引参加者は、本所の市場における次の各号に掲げる市場デリバティブ取引の業務を担当する役員又はその責任者の地位にある従業員のうちから、当該各号に定める責任者(本所の市場における当該各号に掲げる市場デリバティブ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者をいう。以下この条において同じ。)1人を選任し、あらかじめ本所に届け出なければならない。ただし、国債先物等取引参加者は、第2号に定める責任者の選任及び本所への届出を要しない。

(1) 国債証券先物取引及び国債証券先物オプション取引

国債証券先物取引等責任者

(2) 指数先物取引、有価証券オプション取引及び指数オプション取引

指数先物取引等責任者

5 前項の規定にかかわらず、取引参加者規程第25条第6項の承認を得た先物取引等取引参加者は、前項第1号に規定する責任者の選任及び本所への届出を要しない。

6 第4項の規定にかかわらず、本所が国債証券先物取引等責任者又は指数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、国債証券先物取引等責任者又は指数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。

(過誤のある注文の公表)

第52条 本所は、過誤のある注文が発注された場合において、本所が取引管理上必要と認めるときは、当該注文に係る銘柄(先物取引については、限月取引)、当該注文を発注した取引参加者の名称その他の本所が定める事項を公表することができる。

(新設)

2 取引参加者は、本所の市場における市場デリバティブ取引の業務を担当する役員又はその責任者の地位にある従業員のうちから市場デリバティブ取引責任者(本所の市場における市場デリバティブ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者をいう。以下この条において同じ。)1人を選任し、あらかじめ本所に届け出なければならない。

(新設)

(新設)

(新設)

3 前項の規定にかかわらず、本所が市場デリバティブ取引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、市場デリバティブ取引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。

(過誤のある注文の公表)

第52条 本所は、過誤のある注文が発注された場合において、本所が取引管理上必要と認めるときは、当該注文に係る銘柄(指数先物取引については、限月取引)、当該注文を発注した取引参加者の名称その他の本所が定める事項を公表することができる。

(有価証券オプションの上場廃止等)

第53条 本所は、次の各号のいずれかに該当する場合には、本所が定める日に、当該各号に定める有価証券オプションの上場を廃止する。

(1) オプション対象証券上場取引所がオプション対象証券の上場廃止を行うことにより、当該オプション対象証券が国内のいずれの金融商品取引所においても上場されなくなった場合

(2) 同一のオプション対象証券に係る有価証券オプションを対象とする有価証券オプション取引について、次のaからcまでに該当する場合

a 本所が当該有価証券オプションの上場廃止に係る該当性の判断を行うための基準となる日として本所がその都度定める日（以下この号において「基準日」という。）からさかのぼって1年間に本所において取引が成立していない場合（当該基準日において、上場日から1年を経過していない有価証券オプションを除く。）

b 当該基準日において本所が当該有価証券オプションの上場の継続を必要としないと認めた場合

c （略）

2 前項の場合において、当該有価証券オプションを対象とする有価証券オプション取引の限月取引及びその数は、第10条の規定にかかわらず、本所が別に定めるところによる。

(建玉の内容に関する報告)

第53条の2 取引参加者は、国債証券先物取引に係るLarge取引（第34条に規定する過誤訂正等のための取引を含む。）における直近の限月取引において、自己の計算による売建玉と買建玉の差引数量又は一の顧客の委託に基づく売建玉と買建玉の差引数量が、本所が定める取引日に本所が銘柄ごとに定める報告数量以上となっている場合は、本所が定めるところにより、その内容を本所に報告するものとする。

2 取引参加者は、国債証券先物取引における直近の限月取引を権利行使対象先物限月取引とする国

(個別証券オプションの上場廃止等)

第53条 本所は、次の各号のいずれかに該当する場合には、本所が定める日に、当該各号に定める個別証券オプションの上場を廃止する。

(1) オプション対象証券上場取引所がオプション対象証券の上場廃止を行うことにより、当該オプション対象証券が国内のいずれの金融商品取引所においても上場されなくなった場合

(2) 同一のオプション対象証券に係る個別証券オプションを対象とする個別証券オプション取引について、次のaからcまでに該当する場合

a 本所が当該個別証券オプションの上場廃止に係る該当性の判断を行うための基準となる日として本所がその都度定める日（以下この号において「基準日」という。）からさかのぼって1年間に本所において取引が成立していない場合（当該基準日において、上場日から1年を経過していない個別証券オプションを除く。）

b 当該基準日において本所が当該個別証券オプションの上場の継続を必要としないと認めた場合

c （略）

2 前項の場合において、当該個別証券オプションを対象とする個別証券オプション取引の限月取引及びその数は、第10条の規定にかかわらず、本所が別に定めるところによる。

(新設)

債証券先物オプション取引(第34条に規定する過誤訂正等のための取引を含む。)において、自己の計算による次の各号に掲げる数量又は一の顧客の委託に基づく次の各号に掲げる数量が、本所が定める取引日に本所が権利行使により成立する国債証券先物取引の対象銘柄ごとに定める報告数量以上となっている場合は、本所が定めるところにより、その内容を本所に報告するものとする。

- (1) 国債証券先物プットオプションに係る売建玉と買建玉の差引数量
- (2) 国債証券先物コールオプションに係る売建玉と買建玉の差引数量
- (3) 前2号に掲げる差引数量のうち、いずれか一方において売建玉が買建玉を超え、他方において買建玉が売建玉を超えている場合には、第1号の差引数量に前号の差引数量を加えた数量

(自己計算による取引の制限及び大口建玉の報告)

第54条 取引参加者(先物取引等取引参加者に限る。以下この条において同じ。)は、同一のオプション対象証券に係る有価証券オプションを対象とする有価証券オプション取引(第34条に規定する過誤訂正等のための取引を含む。以下この条において同じ。)を行う場合には、自己の計算による次の各号に掲げる数量が、第3項に規定する制限数量を超えることとなる新規の売付け若しくは新規の買付け又は転売若しくは買戻しを行ってはならない。この場合において、当該オプション対象証券に係る有価証券オプションが国内の他の金融商品取引所が開設する取引所金融商品市場における有価証券オプション取引の対象であるときは、当該有価証券オプション取引における建玉の数量を、次の各号に掲げる数量に含めるものとする。

- (1) 有価証券プットオプションに係る売建玉と買建玉の差引数量
- (2) 有価証券コールオプションに係る売建玉と買建玉の差引数量
- (3) (略)

2 前項各号の規定にかかわらず、次の各号に掲げる場合には、当該各号に定める数量を前項各号に規

(自己計算による取引の制限及び大口建玉の報告)

第54条 取引参加者は、同一のオプション対象証券に係る個別証券オプションを対象とする個別証券オプション取引(第34条に規定する過誤訂正のための取引を含む。以下この条及び次条において同じ。)を行う場合には、自己の計算による次の各号に掲げる数量が、第3項に規定する制限数量を超えることとなる新規の売付け若しくは新規の買付け又は転売若しくは買戻しを行ってはならない。この場合において、当該オプション対象証券に係る個別証券オプションが国内の他の金融商品取引所が開設する取引所金融商品市場における個別証券オプション取引の対象であるときは、当該個別証券オプション取引における建玉の数量を、次の各号に掲げる数量に含めるものとする。

- (1) 個別証券プットオプションに係る売建玉と買建玉の差引数量
- (2) 個別証券コールオプションに係る売建玉と買建玉の差引数量
- (3) (略)

2 前項各号の規定にかかわらず、次の各号に掲げる場合には、当該各号に定める数量を前項各号に規

定する数量から減じるものとする。

(1) (略)

(2) 当該オプション対象証券に係る有価証券オプションを対象とする有価証券オプション取引において、顧客の注文を執行するために必要と認められる売付け又は買付けを行った場合には、当該売付け又は買付けに係る建玉の数量

3～6 (略)

(取引に関する通知書の送付)

第55条 取引参加者は、市場デリバティブ取引〔第34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) 次の a から e までの市場デリバティブ取引の区分に従い、当該区分に定める事項

a 国債証券先物取引

(a) 銘柄

(b) 限月取引

b 指数先物取引

(a) (略)

(b) 日経平均及び東証株価指数を対象とする指数先物取引については、Large取引又はMini取引の別

(c) (略)

c 有価証券オプション取引

(a) (略)

(b) 有価証券オプション1単位のオプション対象証券の数量

(c) 有価証券プットオプション又は有価証券コールオプションの別

(d)・(e) (略)

d 国債証券先物オプション取引

(a) 権利行使により成立する国債証券先物取引の対象銘柄

(b) 国債証券先物プットオプション又は国債証券先物コールオプションの別

(c) 限月取引

(d) 権利行使価格

定する数量から減じるものとする。

(1) (略)

(2) 当該オプション対象証券に係る個別証券オプションを対象とする個別証券オプション取引において、顧客の注文を執行するために必要と認められる売付け又は買付けを行った場合には、当該売付け又は買付けに係る建玉の数量

3～6 (略)

(取引に関する通知書の送付)

第55条 取引参加者は、市場デリバティブ取引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) 次の a から c までの市場デリバティブ取引の区分に従い、当該区分に定める事項

(新設)

a 指数先物取引

(a) (略)

(b) 日経平均を対象とする指数先物取引については、Large取引又はMini取引の別

(c) (略)

b 個別証券オプション取引

(a) (略)

(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

(c) 個別証券プットオプション又は個別証券コールオプションの別

(d)・(e) (略)

(新設)

e (略)

(2) (略)

(3) 取引契約数量 (国債証券先物取引に係るLarge取引にあつては取引額面金額)

(4)・(5) (略)

(6) 次の a から d までの市場デリバティブ取引の区分に従い、当該区分に定める事項

a 国債証券先物取引及び指数先物取引

当該限月取引の取引最終日の終了する日

b 有価証券オプション取引

当該限月取引の取引最終日及び権利行使日

c 国債証券先物オプション取引

当該限月取引の取引最終日の終了する日及び権利行使期間満了の日

d (略)

2～5 (略)

(権利行使の割当て及び顧客への割当通知)

第56条 取引参加者は、クリアリング機構の業務方法書に基づき顧客の委託に基づく建玉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 (略)

(公開買付期間中における取引参加者の自己買付け等)

第57条 金融商品取引法施行令(昭和40年政令第321号)第12条第2号及び同第14条の3の7第5号に規定する金融商品取引所の定める規則において有価証券の流通の円滑化を図るため認められている買付け等は、本所の市場における次の各号に掲げる有価証券コールオプションの買付けとする。

(1)・(2) (略)

付 則

1 この改正規定は、平成26年3月24日から施行する。

2 前項の規定にかかわらず、この改正規定は、売買システムの稼働に支障が生じた場合その他やむ

c (略)

(2) (略)

(3) 取引契約数量

(4)・(5) (略)

(6) 次の a から c までの市場デリバティブ取引の区分に従い、当該区分に定める事項

a 指数先物取引

当該限月取引の取引最終日の終了する日

b 個別証券オプション取引

当該限月取引の取引最終日及び権利行使日
(新設)

c (略)

2～5 (略)

(権利行使の割当て及び顧客への割当通知)

第56条 取引参加者は、クリアリング機構の業務方法書に基づき顧客の委託に基づく建玉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 (略)

(公開買付期間中における取引参加者の自己買付け等)

第57条 金融商品取引法施行令(昭和40年政令第321号)第12条第2号及び同第14条の3の7第5号に規定する金融商品取引所の定める規則において有価証券の流通の円滑化を図るため認められている買付け等は、本所の市場における次の各号に掲げる個別証券コールオプションの買付けとする。

(1)・(2) (略)

を得ない事由により、平成26年3月24日に施行することが適当でないと本所が認める場合には、当該日以後の本所が定める日から施行する。

- 3 この改正規定施行の日（以下「施行日」という。）の前日における東京証券取引所の開設する取引所金融商品市場における市場デリバティブ取引に係る未決済約定については、取引参加者は、施行日以降、本所の市場において転売又は買戻しを行うことができる。
- 4 第9条の規定にかかわらず、施行日の前日において、東京証券取引所の有価証券オプション取引に係る対象有価証券であって、本所におけるオプション対象証券ではない有価証券について、本所は、施行日に当該有価証券をオプション対象証券に選定する。
- 5 取引参加者規程平成26年3月24日改正付則第6項により国債先物等取引資格又は先物取引等取引資格の付与を受ける者が、施行日の前日における東京証券取引所の国債証券先物取引に関する業務規程及び受託契約準則の特例第43条の2第4項により国債証券先物取引等責任者を、及び、東京証券取引所の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第41条第4項により指数先物取引等責任者を選任し届け出ている場合は、改正後の第51条第4項第1号により国債証券先物取引等責任者を、及び、同項第2号の規定により指数先物取引等責任者を選任し届け出たものとみなす。
- 6 施行日の前日において、東京証券取引所の総合取引資格を有する者のうち、本所の先物取引等取引資格を有する者が、施行日の前日までに東京証券取引所の国債証券先物取引に関する業務規程及び受託契約準則の特例第43条の2第4項により国債証券先物取引等責任者を選任し届け出ている場合は、施行日において、当該取引参加者が改正後の第51条第4項第1号の規定により国債証券先物取引等責任者を選任し届け出たものとみなす。

(別表)

標準物と受渡適格銘柄との交換比率の算定に関する

(新設)

る表

$$\text{交換比率} = \frac{\frac{\text{受渡適格銘柄の年利子}}{x} \times \left\{ \left(1 + \frac{x}{2} \right)^{\left(\frac{\text{受渡適格銘柄の受渡決済期日}}{\text{後に到来する利払回数}} \right) - 1 \right\} + 100}{\left(1 + \frac{x}{2} \right)^{\left(\frac{\text{受渡適格銘柄の受渡決済期日における残存期間}}{6} \right)} \times 100}$$

$$= \frac{\text{受渡適格銘柄の年利子} \times \left(6 - \frac{\text{受渡適格銘柄の受渡決済期日}}{\text{から次回利払日までの期間}} \right)}{1200}$$

(注)

- 1 この表におけるXは、銘柄ごとに、次に定めるところによる。
 - (1) 中期国債標準物については、0.03とする。
 - (2) 長期国債標準物については、0.06とする。
 - (3) 超長期国債標準物については、0.06とする。
- 2 受渡適格銘柄の受渡決済期日における残存期間及び受渡適格銘柄の受渡決済期日から次回利払日までの期間は月数とする。
- 3 交換比率は、小数点以下第6位まで求め、第7位以下切捨てとする。
- 4 計算過程において算出される数値は、小数点以下第10位まで求め、第11位以下切捨てとする。
- 5 第1回目の利払い前の国債証券を受渡決済のために授受する場合において、受渡決済期日における残存期間が、長期国債標準物においては10年を超える銘柄、超長期国債標準物においては20年を超える銘柄の交換比率の算定については、別表中「受渡適格銘柄の受渡決済期日以降に到来する利払回数」とあるのは「受渡適格銘柄の受渡決済期日以降に到来する利払回数+1」と、「受渡適格銘柄の受渡決済期日から次回利払日までの期間」とあるのは「(受渡適格銘柄の受渡決済期日から第1回目の利払日までの期間-6)」とする。

業務規程の一部改正新・旧対照表

新	旧
(自主規制業務の委託) 第2条の2 本所は、法第84条第2項に規定する自主規制業務のうち、第3条第1項第2号に定める個別証券オプションの上場及び上場廃止に関する業務について、<u>日本取引所自主規制法人</u>（以下「自主規制法人」という。）に委託することができる。 2 (略) 付 則 この改正規定は、平成26年4月1日から施行する。	(自主規制業務の委託) 第2条の2 本所は、法第84条第2項に規定する自主規制業務のうち、第3条第1項第2号に定める個別証券オプションの上場及び上場廃止に関する業務について、<u>東京証券取引所自主規制法人</u>（以下「自主規制法人」という。）に委託することができる。 2 (略)

取引参加者規程の一部改正新・旧対照表

新	旧
(取引参加者) 第2条 本所の取引参加者は、先物取引等取引参加者、<u>国債先物等取引参加者及び外国為替証拠金取引参加者の3種類とする。</u> 2 先物取引等取引参加者は、本所の市場において、次の各号に掲げる取引(有価証券等清算取次ぎによるものを除く。)を行うための取引資格(以下「先物取引等取引資格」という。)を有する。 (1) <u>国債証券先物取引(国債証券の標準物に係る金融商品取引法(昭和23年法律第25号。以下「法」という。)第2条第21項第1号に掲げる取引又は当該標準物の価格に係る同項第2号に掲げる取引をいう。以下同じ。)</u> (2) <u>指数先物取引(法第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。)</u> (3) <u>有価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。)</u> (4) <u>国債証券先物オプション取引(法第2条第21項第3号に掲げる取引のうち国債証券先物取引に係るものをいう。以下同じ。)</u> (5) (略) 3 <u>国債先物等取引参加者とは、本所の市場における前項第1号及び第4号に掲げる取引(有価証券等清算取次ぎによるものを除く。)を行うための取引資格(以下「国債先物等取引資格」という。)を有する者をいう。</u> 4 (略) 5 <u>取引参加者は、先物取引等取引資格と国債先物等取引資格を同時に有することはできない。</u> (過誤のある注文の公表) 第22条の2 過誤のある注文が発注された場合であって、本所が業務規程第52条の規定に基づき公表を	(取引参加者) 第2条 本所の取引参加者は、先物取引等取引参加者及び外国為替証拠金取引参加者の<u>2種類とする。</u> 2 先物取引等取引参加者は、本所の市場において、次の各号に掲げる取引(有価証券等清算取次ぎによるものを除く。)を行うための取引資格(以下「先物取引等取引資格」という。)を有する。 (新設) (1) <u>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。)</u> (2) <u>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。)</u> (新設) (3) (略) (新設) 3 (略) (新設) (過誤のある注文の公表) 第22条の2 過誤のある注文が発注された場合であって、本所が業務規程第52条の規定に基づき公表を

行なったときは、当該注文を発注した取引参加者は、遅滞なく、当該注文に係る銘柄（国債証券先物取引及び指数先物取引については、限月取引）その他の本所が定める事項を公表しなければならない。

（非清算参加者の定義）

第24条 （略）

2 国債先物等非清算参加者とは、国債先物等清算資格（クリアリング機構の業務方法書に規定する国債先物等清算資格をいう。以下同じ。）を有しない先物取引等取引参加者及び国債先物等取引参加者をいう。

3・4 （略）

5 この規程においては、現物非清算参加者、国債先物等非清算参加者、指数先物等非清算参加者及びF X非清算参加者を総称して、非清算参加者という。

（清算受託契約の締結）

第25条 現物非清算参加者は、本所の市場における有価証券オプション取引における権利行使により成立する有価証券の売買に係る有価証券等清算取次ぎの委託に関し、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。）との間でクリアリング機構の業務方法書に規定する清算受託契約を締結しなければならない。

2 国債先物等非清算参加者は、本所の市場における国債証券先物取引及び国債証券先物オプション取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に関し、国債先物等他社清算参加者（国債先物等清算資格に係る他社清算資格を有する者をいう。以下同じ。）との間でクリアリング機構の業務方法書に規定する清算受託契約を締結しなければならない。

3 指数先物等非清算参加者は、本所の市場における指数先物取引、有価証券オプション取引及び指数オプション取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に関し、指数先物等他社清算参加者（指数先物等清算資格に係る他社清算資格を有する者をいう。以

行なったときは、当該注文を発注した取引参加者は、遅滞なく、当該注文に係る銘柄（指数先物取引については、限月取引）その他の本所が定める事項を公表しなければならない。

（非清算参加者の定義）

第24条 （略）

（新設）

2・3 （略）

4 この規程においては、現物非清算参加者、指数先物等非清算参加者及びF X非清算参加者を総称して、非清算参加者という。

（清算受託契約の締結）

第25条 現物非清算参加者は、本所の市場における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有価証券の売買に係る有価証券等清算取次ぎの委託に関し、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。）との間でクリアリング機構の業務方法書に規定する清算受託契約を締結しなければならない。

（新設）

2 指数先物等非清算参加者は、本所の市場における先物・オプション取引（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をいう。以下同じ。）に係る有価証券等清算取次ぎの委託に関し、指数先物等他社清算参加者（指数先物等清算資

下同じ。)との間でクリアリング機構の業務方法書に規定する清算受託契約を締結しなければならない。

4 (略)

5 第1項の規定にかかわらず、現物非清算参加者は、本所の承認を受けた場合は、有価証券の売買に係る有価証券等清算取次ぎの委託に関し清算受託契約を締結することを要しない。この場合においては、当該先物取引等取引参加者は、有価証券オプション取引（有価証券等清算取次ぎによるものを除く。）及び有価証券オプション取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託を行うことができない。

6 前項の規定は、国債先物等非清算参加者である先物取引等取引参加者について準用する。この場合において、「第1項」とあるのは「第2項」と、「有価証券の売買」とあるのは「国債証券先物取引及び国債証券先物オプション取引」と、「有価証券オプション取引(有価証券等清算取次ぎによるものを除く。)」及び「有価証券オプション取引」とあるのは「これらの取引」と読み替えるものとする。

(指定清算参加者の指定)

第27条 非清算参加者は、清算資格の種類ごとに、清算受託契約の相手方である他社清算参加者(現物他社清算参加者、国債先物等他社清算参加者、指数先物等他社清算参加者又はF X他社清算参加者をいう。以下同じ。)のうちから、当該清算資格の種類に係る取引につき常に有価証券等清算取次ぎの委託先とする一の者(以下「指定清算参加者」という。)を指定しなければならない。

2 第25条第5項の承認(同条第6項において準用する場合を含む。)を受けて清算受託契約を締結しない場合の当該清算資格の種類に係る取引については、前項の規定は適用しない。

3 (略)

(清算受託契約の解約の報告)

第29条 非清算参加者は、清算受託契約の解約については、次の各号に掲げる解約の区分に従い、当該各号に定めるところにより、その内容を本所に報告

格に係る他社清算資格を有する者をいう。以下同じ。)との間でクリアリング機構の業務方法書に規定する清算受託契約を締結しなければならない。

3 (略)

4 第1項の規定にかかわらず、現物非清算参加者は、本所の承認を受けた場合は、有価証券の売買に係る有価証券等清算取次ぎの委託に関し清算受託契約を締結することを要しない。この場合においては、当該先物取引等取引参加者は、個別証券オプション取引（有価証券等清算取次ぎによるものを除く。）及び個別証券オプション取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託を行うことができない。

(新設)

(指定清算参加者の指定)

第27条 非清算参加者は、清算資格の種類ごとに、清算受託契約の相手方である他社清算参加者(現物他社清算参加者、指数先物等他社清算参加者又はF X他社清算参加者をいう。以下同じ。)のうちから、当該清算資格の種類に係る取引につき常に有価証券等清算取次ぎの委託先とする一の者(以下「指定清算参加者」という。)を指定しなければならない。

2 第25条第4項の承認を受けて有価証券の売買に係る清算受託契約を締結しない場合の個別証券オプション取引については、前項の規定は適用しない。

3 (略)

(清算受託契約の解約の報告)

第29条 非清算参加者は、清算受託契約の解約については、次の各号に掲げる解約の区分に従い、当該各号に定めるところにより、その内容を本所に報告

しなければならない。

(1) 合意による解約

当該解約を行おうとする日の3日前（休業日（現物非清算参加者、国債先物等非清算参加者及び指数先物等非清算参加者にあつては業務規程第19条第1項に規定する休業日（同条第2項に規定する臨時休業日を含む。）をいい、FX非清算参加者にあつては取引所FX取引特例第6条第1項に規定する休業日（同条第2項に規定する臨時休業日を含む。）をいう。第4号及び第35条第1項において同じ。）を除外する。）の日までに報告を行う。

(2)～(5) (略)

(取引資格取得の承認)

第32条 本所は、次の各号に掲げる取引資格の区分に従い、当該各号に定める者であつて、第30条第2項に定めるところによる審査により適当であると認める者に対して、取引資格の取得の承認を行う。

(1) (略)

(2) 国債先物等取引資格

次のaからcまでのいずれかに該当する者

- a 金融商品取引業者
- b 取引所取引許可業者
- c 登録金融機関

(3) (略)

2～6 (略)

(取引参加者の処分)

第42条 本所は、定款第47条の規定に基づき、取引参加者が次の各号のいずれかに該当すると認められる場合には、当該取引参加者を審問のうえ、当該各号に掲げる処分を行うことができる。

(1)～(5) (略)

(6) 第17条の規定による検査を拒否し、妨げ若しくは忌避したとき、同条の規定による報告若しくは資料を提出せず又は虚偽の報告若しくは資料を提出したとき、又は第54条の規定による調査を拒否し、妨げ、若しくは忌避したときは、1億円以下の過怠金、戒告、6か月以内の本所の

しなければならない。

(1) 合意による解約

当該解約を行おうとする日の3日前（休業日（現物非清算参加者及び指数先物等非清算参加者にあつては業務規程第19条第1項に規定する休業日（同条第2項に規定する臨時休業日を含む。）をいい、FX非清算参加者にあつては取引所FX取引特例第6条第1項に規定する休業日（同条第2項に規定する臨時休業日を含む。）をいう。第4号及び第35条第1項において同じ。）の日までに報告を行う。

(2)～(5) (略)

(取引資格取得の承認)

第32条 本所は、次の各号に掲げる取引資格の区分に従い、当該各号に定める者であつて、第30条第2項に定めるところによる審査により適当であると認める者に対して、取引資格の取得の承認を行う。

(1) (略)

(新設)

(2) (略)

2～6 (略)

(取引参加者の処分)

第42条 本所は、定款第9条の規定に基づき、取引参加者が次の各号のいずれかに該当すると認められる場合には、当該取引参加者を審問のうえ、当該各号に掲げる処分を行うことができる。

(1)～(5) (略)

(6) 定款第10条の規定による検査を拒否し、妨げ若しくは忌避したとき、同条の規定による報告若しくは資料を提出せず又は虚偽の報告若しくは資料を提出したとき、又は第54条の規定による調査を拒否し、妨げ、若しくは忌避したときは、1億円以下の過怠金、戒告、6か月以内の本所

市場における市場デリバティブ取引若しくは有価証券等清算取次ぎの委託の停止又は取引資格の取消し

(7)～(9) (略)

2・3 (略)

(取引参加者に対する処置)

第43条 (略)

2 本所は、取引参加者が次の各号のいずれかに該当することとなった場合には、当該取引参加者を審問のうえ、その事由の消滅するまで、当該取引参加者の本所の市場における市場デリバティブ取引(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又は制限を行うことができる。

(1)～(5) (略)

(6) 取引所取引許可業者について、外国の金融商品取引所から有価証券の売買及び市場デリバティブ取引の停止の処分を受けたとき。

(指定清算参加者を指定していない場合の措置)

第49条 本所は、非清算参加者が指定清算参加者の指定をしていない場合(第27条第2項の規定に基づき指定清算参加者の指定をしていない場合及び指定清算参加者が非清算参加者との間における清算受託契約の特例解約により指定清算参加者でなくなった場合を除く。)においては、当該非清算参加者の当該指定をしていない清算資格の種類に係る有価証券等清算取次ぎの委託(当該指定をしていない清算資格が現物清算資格である場合は、有価証券オプション取引(有価証券等清算取次ぎによるものを除く。以下この条及び次条において同じ。))又は有価証券オプション取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託を含む。)を停止する。

2 前項の場合において、指定清算参加者が非清算参加者との間における清算受託契約の解約により指定清算参加者でなくなったときは、同項の規定にかかわらず、当該非清算参加者は、当該非清算参加者の有価証券オプション取引、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

の市場における市場デリバティブ取引若しくは有価証券等清算取次ぎの委託の停止又は取引資格の取消し

(7)～(9) (略)

2・3 (略)

(取引参加者に対する処置)

第43条 (略)

2 本所は、取引参加者が次の各号のいずれかに該当することとなった場合には、当該取引参加者を審問のうえ、その事由の消滅するまで、当該取引参加者の本所の市場における市場デリバティブ取引(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又は制限を行うことができる。

(1)～(5) (略)

(6) 取引所取引許可業者について、外国の金融商品取引所から市場デリバティブ取引の停止の処分を受けたとき。

(指定清算参加者を指定していない場合の措置)

第49条 本所は、非清算参加者が指定清算参加者の指定をしていない場合(第25条第4項の規定に基づき指定清算参加者の指定をしていない場合及び指定清算参加者が非清算参加者との間における清算受託契約の特例解約により指定清算参加者でなくなった場合を除く。)においては、当該非清算参加者の当該指定をしていない清算資格の種類に係る有価証券等清算取次ぎの委託(当該指定をしていない清算資格が現物清算資格である場合は、個別証券オプション取引(有価証券等清算取次ぎによるものを除く。以下この条及び次条において同じ。))又は個別証券オプション取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託を含む。)を停止する。

2 前項の場合において、指定清算参加者が非清算参加者との間における清算受託契約の解約により指定清算参加者でなくなったときは、同項の規定にかかわらず、当該非清算参加者は、当該非清算参加者の個別証券オプション取引、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

未決済のものを解消するために必要とする限度において、本所の承認を受けて、有価証券オプション取引又は有価証券等清算取次ぎの委託を行うことができる。

3 (略)

(特例解約が行われた場合の措置)

第49条の2 本所は、非清算参加者が指定清算参加者の指定をしていない場合(指定清算参加者が非清算参加者との間における清算受託契約の特例解約により指定清算参加者でなくなった場合に限る。)においては、当該非清算参加者の当該指定をしていない清算資格の種類に係る有価証券等清算取次ぎの委託(当該指定をしていない清算資格が現物清算資格である場合は、有価証券オプション取引又は有価証券オプション取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託を含む。)を停止する。

2 前項の規定にかかわらず、同項の非清算参加者は、当該非清算参加者の有価証券オプション取引、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解消するため必要とする限度において、本所の承認を受けて、有価証券オプション取引又は有価証券等清算取次ぎの委託を行うことができる。

3 (略)

(取引の信義則違反)

第51条 定款及びこの規程に規定する取引の信義則に反する行為とは、次に掲げる行為その他の本所が規則により定める行為で、本所の目的及び市場の運営にかんがみて、本所若しくは本所の取引参加者の信用を失墜し、又は本所若しくは本所の取引参加者に対する信義に反する行為をいう。

(1) (略)

(2) 有価証券の売買、市場デリバティブ取引、外国市場デリバティブ取引又はこれらと類似の取引に関し詐欺的な行為、不信若しくは不穏当な行為又は著しく不注意若しくは怠慢な事務処理を行うこと。

未決済のものを解消するために必要とする限度において、本所の承認を受けて、個別証券オプション取引又は有価証券等清算取次ぎの委託を行うことができる。

3 (略)

(特例解約が行われた場合の措置)

第49条の2 本所は、非清算参加者が指定清算参加者の指定をしていない場合(指定清算参加者が非清算参加者との間における清算受託契約の特例解約により指定清算参加者でなくなった場合に限る。)においては、当該非清算参加者の当該指定をしていない清算資格の種類に係る有価証券等清算取次ぎの委託(当該指定をしていない清算資格が現物清算資格である場合は、個別証券オプション取引又は個別証券オプション取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託を含む。)を停止する。

2 前項の規定にかかわらず、同項の非清算参加者は、当該非清算参加者の個別証券オプション取引、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解消するため必要とする限度において、本所の承認を受けて、個別証券オプション取引又は有価証券等清算取次ぎの委託を行うことができる。

3 (略)

(取引の信義則違反)

第51条 定款及びこの規程に規定する取引の信義則に反する行為とは、次に掲げる行為その他の本所が規則により定める行為で、本所の目的及び市場の運営にかんがみて、本所若しくは本所の取引参加者の信用を失墜し、又は本所若しくは本所の取引参加者に対する信義に反する行為をいう。

(1) (略)

(2) 市場デリバティブ取引、外国市場デリバティブ取引又はこれらと類似の取引に関し詐欺的な行為、不信若しくは不穏当な行為又は著しく不注意若しくは怠慢な事務処理を行うこと。

(新設)

(3) 株券を買い集め、その銘柄の株券の大量の所有者であることを利用して、その株券の発行会社の関係者に対し、その意に反して、当該株券を有利に売り付けること又はこれに類似する行為を目的とする者の計算による当該銘柄の株券の買付けの受託（有価証券等清算取次ぎの受託を除く。）を行い、又は当該銘柄の株券の発行会社の関係者に対し、売付けの受託（有価証券等清算取次ぎの受託を除く。）を行うこと。

付 則

- 1 この改正規定は、平成26年3月24日から施行する。
- 2 前項の規定にかかわらず、この改正規定は、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、平成26年3月24日に施行することが適当でないと本所が認める場合には、当該日以後の本所が定める日から施行する。
- 3 この改正規定施行の日（以下「施行日」という。）の前日において、株式会社東京証券取引所（以下「東京証券取引所」という。）の総合取引資格を有する者のうち、本所の取引参加者でない者は、施行日において、改正後の第2条第2項に定める先物取引等取引資格を取得しようとする場合には、平成26年1月31日までに、本所が定めるところにより当該取引資格の取得の申請を行うものとする。
- 4 施行日の前日において、東京証券取引所の国債先物等取引資格を有する者のうち、本所の取引参加者でない者は、施行日において、改正後の第2条第3項に定める国債先物等取引資格を取得しようとする場合には、平成26年1月31日までに、本所が定めるところにより当該取引資格の取得の申請を行うものとする。
- 5 本所は、第3項又は前項の申請を行った者が、施行日において、改正後の第43条第2項各号のいずれにも該当しないと見込まれる場合に、当該申請の種類に応じて、改正後の第2条第2項に定める先物取引等取引資格又は同条第3項に定める国債先物等取引資格の取得の承認を行うものとする。
- 6 本所は、前項の承認を受けた者が、第32条第2

項に規定する取引資格の取得手続(取引参加者参加金の納入を除く。)を履行した場合には、施行日において、当該承認の種類に応じて、改正後の第2条第2項に定める先物取引等取引資格又は同条第3項に定める国債先物等取引資格を付与する。

7 前項における取引資格の取得手続のうち、取得しようとする取引資格の種類に係る清算資格のうち現に有していないものの取得手続(当該清算資格を新たに取得しない場合にあつては、改正後の第25条及び第27条の規定により必要となる清算受託契約の締結及び指定清算参加者の指定)(以下「清算資格の取得手続等」という。)について、本所の承認を受けた者に対しては、当分の間、その履行を猶予するものとする。この場合において、清算資格の取得手続等の履行を猶予された者は、清算資格の取得手続等を履行するまでの間は、当該清算資格に係る市場デリバティブ取引及び有価証券等清算取次ぎの委託を行うことができない。

8 第6項における取引資格の取得手続のうち、国債先物等取引資格に係る第5項の承認を受けた者の信託金及び取引参加者保証金の預託については、東京証券取引所の取引参加者規程平成26年3月24日改正付則第6項の規定に基づき、東京証券取引所が本所に預託する信託金及び取引参加者保証金をもって、当該承認を受けた者が本所にそれらの預託を行っているものとみなす。

9 本所は、本所の市場の運営上必要があると認める場合は、東証取引資格保有者(本所の取引参加者のうち、施行日の前日において、東京証券取引所の総合取引資格又は国債先物等取引資格を有する者をいう。以下同じ。)に対し、東京証券取引所の取引資格を取得したときから施行日の前日までの間の当該東証取引資格保有者の業務又は財産に関して参考となるべき報告若しくは資料の提出を請求し、又は当該取引資格保有者の業務若しくは財産の状況又は帳簿、書類その他の物件を検査することができる。

10 東証取引資格保有者が施行日前に行った施行日の前日における東京証券取引所の取引参加者規程第34条第1項各号又は第2項に該当する行為(東京

証券取引所の市場における有価証券の売買に関するものを除く。)は、それぞれ、第42条第1項各号又は第2項に該当する行為とみなして、これらの規定を適用する。

11 東証取引資格保有者に対して、施行日前に、施行日の前日における東京証券取引所の取引参加者規程及び同規程に基づく諸規則によって東京証券取引所が行った行為及び当該東証取引資格保有者から東京証券取引所に対して行われた行為(東京証券取引所の市場における有価証券の売買に関するものを除く。)は、本所の取引参加者規程及び同規程に基づく諸規則の規定中の相当する規定によって本所が行ったもの及び本所に対して行われたものとみなす。

12 第6項の規定により先物取引等取引資格又は国債先物等取引資格の付与を受ける者が、東京証券取引所の取引資格を取得したときから施行日の前日までの間に東京証券取引所に提出した書類は、施行日に本所にも提出されたものとみなす。ただし、現に東京証券取引所の取引参加者規程第8条第1項の規定により届出されている取引参加者代表者及び第8条第2項の規定により届出されている日常業務代行者については、施行日において、当該取引参加者が本所の取引参加者規程第6条第1項及び第2項に基づき、本所に対して届出を行ったものとみなす。

13 施行日の前日において、東京証券取引所の総合取引資格を有する者のうち、現に本所の先物取引等取引資格を有する者が施行日の前日までに東京証券取引所の取引参加者規程第8条第2項の規定により届出を行った国債証券先物取引及び国債証券先物オプション取引に関する日常業務代行者については、施行日において、当該取引参加者が本所の取引参加者規程第6条第2項に基づき、本所に対して届出を行ったものとみなす。

14 第2項から前項までの規定のほか、施行日における取扱いその他必要な事項については、本所がその都度定める。

取引参加者規程の一部改正新・旧対照表

新	旧
(自主規制業務の委託) 第55条の2 本所は、法第84条第2項に規定する自主規制業務のうち、次の各号に掲げる業務について、<u>日本取引所自主規制法人</u>(以下「自主規制法人」という。)に委託することができる。 (1)～(4) (略) 2・3 (略) 付 則 この改正規定は、平成26年4月1日から施行する。	(自主規制業務の委託) 第55条の2 本所は、法第84条第2項に規定する自主規制業務のうち、次の各号に掲げる業務について、<u>東京証券取引所自主規制法人</u>(以下「自主規制法人」という。)に委託することができる。 (1)～(4) (略) 2・3 (略)

新	旧
(用語の意義) <u>第2条 この規程において使用する国債証券先物取引(国債証券の標準物に係る金融商品取引法(昭和23年法律第25号。以下「法」という。)</u>第2条第21項第1号に掲げる取引又は当該標準物の価格に係る同項第2号に掲げる取引をいう。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、業務規程並びにJ-NET市場に関する業務規程及び受託契約準則の特例(以下「J-NET市場特例」という。)において定めるところによるものとする。 <u>2</u> この規程において使用する指数先物取引(法第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、業務規程及びJ-NET市場特例において定めるところによるものとする。 <u>3</u> この規程において使用する有価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、業務規程及びJ-NET市場特例において定めるところによるものとする。 <u>4</u> この規程において使用する国債証券先物オプション取引(法第2条第21項第3号に掲げる取引のうち国債証券先物取引に係るものをいう。以下同じ。)に係る用語(国債証券先物取引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、業務規程及びJ-NET市場特例において定めるところによるものとする。 <u>5～7</u> (略) (清算参加者の決済)	(用語の意義) (新設) <u>第2条 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。)</u>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、業務規程並びにJ-NET市場に関する業務規程及び受託契約準則の特例(以下「J-NET市場特例」という。)において定めるところによるものとする。 <u>2</u> 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、業務規程及びJ-NET市場特例において定めるところによるものとする。 (新設) <u>3～5</u> (略) (清算参加者の決済)

第4条 本所の市場において成立した国債証券先物取引及び国債証券先物オプション取引の決済は、クリアリング機構の業務方法書の定めるところにより国債先物等清算参加者（国債先物等清算資格（クリアリング機構の業務方法書に規定する国債先物等清算資格をいう。以下同じ。）を有する者をいう。以下同じ。）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指数先物取引、有価証券オプション取引及び指数オプション取引の決済は、クリアリング機構の業務方法書の定めるところにより指数先物等清算参加者（指数先物等清算資格（クリアリング機構の業務方法書に規定する指数先物等清算資格をいう。以下同じ。）を有する者をいう。以下同じ。）とクリアリング機構との間で行う。

3 （略）

第3章 非清算参加者と清算参加者との間の決済

第1節 国債証券先物取引に係る決済

（転売又は買戻し）

第4条の2 国債先物等非清算参加者（取引参加者規程第24条第2項に規定する国債先物等非清算参加者をいう。以下同じ。）は、国債証券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、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クリアリング機構が定める時限までの指定国債先物等清算参加者（当該国債先物等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国債先物等他社清算参加者（国債先物等清算資格（クリアリング機構の業務方法書に規定する国債先物等清算資格をいう。）に係る他社清算資格を有する者をいう。）をいう。以下同じ。）が定める時限までに

（新設）

第4条 本所の市場において成立した先物・オプション取引（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をいう。以下同じ。）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指数先物等清算参加者（指数先物等清算資格（クリアリング機構の業務方法書に規定する指数先物等清算資格をいう。以下同じ。）を有する者をいう。以下同じ。）とクリアリング機構との間で行う。

2 （略）

第3章 非清算参加者と清算参加者との間の決済

（新設）

（新設）

当該指定国債先物等清算参加者に申告するものとする。ただし、クリアリング機構が定めるところにより国債先物等非清算参加者がクリアリング機構に対して当該申告を行った場合には、この限りではない。

- 2 国債先物等非清算参加者が前項に定める申告を行った場合には、本所は、クリアリング機構から当該申告に係る転売又は買戻しの内容の通知を受けるものとする。

(国債証券先物取引の清算値段)

第4条の3 国債証券先物取引の清算値段（Mini取引にあつては、清算数値。以下この節において同じ。）は、クリアリング機構が、国債証券先物取引の清算値段として定める値段（Mini取引にあつては、数値）とする。

(新設)

(約定値段と清算値段との差額の授受)

第4条の4 国債先物等非清算参加者は、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、約定値段（Mini取引にあつては、約定数値。以下この節において同じ。）と当該取引契約締結を行った取引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、指定国債先物等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、金銭を支払う国債先物等非清算参加者は、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国債先物等清算参加者が指定する日時までに、当該指定国債先物等清算参加者に交付しなければならない。

(新設)

(清算値段間の差額の授受)

第4条の5 国債先物等非清算参加者は、有価証券等清算取次ぎの委託に基づく国債証券先物取引について、当該取引日の清算値段と前取引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、指定国債先物等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、金銭を支払う国債先物等非清算参加者は、当該差額に相当す

(新設)

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国債先物等清算参加者が指定する日時までに、当該指定国債先物等清算参加者に交付しなければならない。

(経過利子の取扱い)

第4条の6 国債先物等非清算参加者がLarge取引において受渡決済を行う場合における経過利子(業務規程第34条の8に規定する経過利子をいう。以下この節において同じ。)の取扱いは、当該国債先物等非清算参加者から指定国債先物等清算参加者への申告に基づき、課税扱い又は非課税扱いにより取り扱うものとする。ただし、非課税扱いの申告をした国債先物等非清算参加者のうち、クリアリング機構が指定した国債先物等非清算参加者については、当該国債先物等非清算参加者の経過利子の全部又は一部を課税扱いとする。

(新設)

2 国債先物等非清算参加者は、本所の定めるところにより、前項に規定する経過利子の取扱いについて、指定国債先物等清算参加者がLarge取引における受渡決済を行うために必要と認めて指定する日時までに、当該指定国債先物等清算参加者に申告するものとする。

(受渡決済のために授受する国債証券及び金銭)

第4条の7 Large取引における受渡決済のために国債先物等非清算参加者が指定国債先物等清算参加者との間で授受する国債証券の数量及び金銭の額は、次の各号に定めるところによる。

(新設)

- (1) 国債証券の数量は、前条第1項の規定による経過利子の課税扱い又は非課税扱いごとの最終清算取次売建玉と最終清算取次買建玉の差引数量
- (2) 金銭の額は、前号に規定する国債証券の差引数量に係る受渡適格銘柄の受渡決済代金の額

(受渡決済の受渡時限)

第4条の8 国債先物等非清算参加者は、Large取引における受渡決済については、クリアリング機構が定める決済時限までの指定国債先物等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

(新設)

を指定国債先物等清算参加者に交付するものとする。

(決済物件の組合せ)

第4条の9 Large取引における受渡決済に係る決済物件は、渡方国債先物等非清算参加者の選択により、受渡適格銘柄ごとに売買単位の整数倍で組み合わせることができるものとする。

(新設)

(決済物件の申告)

第4条の10 渡方国債先物等非清算参加者は、Large取引における受渡決済に供する銘柄及び数量を、指定国債先物等清算参加者が受渡決済を行うために必要と認めて指定する日時までに指定国債先物等清算参加者に申告するものとする。

(新設)

(受渡決済に係る決済の繰延べ)

第4条の11 国債先物等非清算参加者は、Large取引における受渡決済について第4条の8に規定する受渡決済に係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、指定国債先物等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、当該受渡決済に係る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。

(新設)

(最終決済に伴う金銭の授受)

第4条の12 国債先物等非清算参加者は、Mini取引における最終決済において、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、国債先物等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、金銭を支払う国債先物等非清算参加者は、クリアリング機構が定める決済時限までの指定国債先物等清算参加者が指定する日時までに、当該指定国債先物等清算参加者に交付しなければならない。

(新設)

第1節の2 指数先物取引に係る決済
(転売又は買戻し)

第5条 指数先物等非清算参加者（取引参加者規程

第1節 指数先物取引に係る決済
(転売又は買戻し)

第5条 指数先物等非清算参加者（取引参加者規程

第24条第3項に規定する指数先物等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、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クリアリング機構が定める時限までの指定指数先物等清算参加者(当該指数先物等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指数先物等他社清算参加者(指数先物等清算資格(クリアリング機構の業務方法書に規定する指数先物等清算資格をいう。)に係る他社清算資格を有する者をいう。)をいう。以下同じ。)が定める時限までに指定指数先物等清算参加者に申告するものとする。ただし、クリアリング機構が定めるところにより指数先物取引等非清算参加者がクリアリング機構に対して当該申告を行った場合には、この限りではない。

2 (略)

(清算数値)

第6条 指数先物取引の清算数値は、クリアリング機構が指数先物取引の清算数値として定める数値とする。

第2節 有価証券オプション取引に係る決済 (転売又は買戻し)

第10条 指数先物等非清算参加者は、有価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、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クリアリング機構が定める時限までの指定指数先物等清算参加者の指定する時限までに当該指定指数先物等清算参加者に申告するものとする。ただし、クリアリング機構が定めるところにより指数先物等非清算参加者がクリアリン

第24条第2項に規定する指数先物等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クリアリング機構が定める時限までの指定指数先物等清算参加者(当該指数先物等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指数先物等他社清算参加者(指数先物等清算資格(クリアリング機構の業務方法書に規定する指数先物等清算資格をいう。)に係る他社清算資格を有する者をいう。)をいう。以下同じ。)が定める時限までに指定指数先物等清算参加者に申告するものとする。ただし、クリアリング機構が定めるところにより指数先物取引等非清算参加者がクリアリング機構に対して当該申告を行った場合には、この限りではない。

2 (略)

(清算数値)

第6条 指数先物取引の清算数値は、クリアリング機構が指数先物取引の清算指数として定める数値とする。

第2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10条 指数先物等非清算参加者は、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、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クリアリング機構が定める時限までの指定指数先物等清算参加者の指定する時限までに当該指定指数先物等清算参加者に申告するものとする。ただし、クリアリング機構が定めるところにより指数先物等非清算参加者がクリアリン

グ機構に対して当該申告を行った場合には、この限りではない。

2 (略)

(取引代金の授受)

第11条 指数先物等非清算参加者は、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、指定指数先物等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、金銭を支払う指数先物等非清算参加者は、クリアリング機構が定める決済時限までの指定指数先物等清算参加者が指定する日時までに、当該指数先物等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12条 有価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、指数先物等非清算参加者が、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クリアリング機構が定める時限までの指定指数先物等清算参加者が指定する時限までに指定指数先物等清算参加者に申告することにより行うものとする。ただし、クリアリング機構が定めるところにより指数先物等非清算参加者がクリアリング機構に対して当該申告を行った場合には、この限りではない。

2 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、当該日の前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ときであっても、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、指数先物等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) 有価証券プットオプションについては、権利行使価格がオプション清算値段（クリアリング機構の業務方法書に規定するオプション清算値段

グ機構に対して当該申告を行った場合には、この限りではない。

2 (略)

(取引代金の授受)

第11条 指数先物等非清算参加者は、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、指定指数先物等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、金銭を支払う指数先物等非清算参加者は、クリアリング機構が定める決済時限までの指定指数先物等清算参加者が指定する日時までに、当該指数先物等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12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、指数先物等非清算参加者が、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クリアリング機構が定める時限までの指定指数先物等清算参加者が指定する時限までに指定指数先物等清算参加者に申告することにより行うものとする。ただし、クリアリング機構が定めるところにより指数先物等非清算参加者がクリアリング機構に対して当該申告を行った場合には、この限りではない。

2 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、当該日の前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ときであっても、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、指数先物等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、権利行使価格がオプション清算値段（クリアリング機構の業務方法書に規定するオプション清算値段

をいう。以下同じ。)を上回っている場合

- (2) 有価証券コールオプションについては、権利行使価格がオプション清算値段を下回っている場合

3～5 (略)

(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14条 有価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。

(決済のために授受する金銭及び有価証券)

第17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) 有価証券オプション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

決済日を同一とする同一現物非清算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を授受するものとする。

- (2) 有価証券オプション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 (有価証券オプション

をいう。以下同じ。)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

3～5 (略)

(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14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。

(決済のために授受する金銭及び有価証券)

第17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

決済日を同一とする同一現物非清算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を授受するものとする。

- (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

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有価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 有価証券オプション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 有価証券オプション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有価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) 有価証券オプション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 (略)

b 有価証券オプション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有価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 (略)

第2節の2 国債証券先物オプション取引に係る決

済

(転売又は買戻し)

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 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 (略)

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 (略)

(新設)

第18条の2 国債先物等非清算参加者は、国債証券先物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クリアリング機構が定める時限までの指定国債先物等清算参加者が定める時限までに指定国債先物等清算参加者に申告するものとする。ただし、クリアリング機構が定めるところにより国債先物非清算参加者がクリアリング機構に対して当該申告を行った場合には、この限りではない。

(新設)

2 国債先物等非清算参加者が前項に定める申告を行った場合には、本所は、クリアリング機構から当該申告に係る転売又は買戻しの内容の通知を受けるものとする。

(権利行使の申告)

第18条の3 国債証券先物オプション取引（過誤訂正等のための取引を含む。以下同じ。）の清算取次買建玉についての権利行使は、国債先物等非清算参加者が、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クリアリング機構が定める時限までの指定国債先物等清算参加者が定める時限までに指定国債先物等清算参加者に申告することにより行うものとする。ただし、クリアリング機構が定めるところにより国債先物等非清算参加者がクリアリング機構に対して当該申告を行った場合には、この限りではない。

(新設)

2 権利行使期間満了の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、当該日の前項の時限までに権利行使の申告が行われないときであっても、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、国債先物等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) 国債証券先物プットオプションについては、権利行使価格が権利行使期間満了の日に終了する取引日における権利行使対象先物限月取引の清

算値段を上回っている場合

(2) 国債証券先物コールオプションについては、権利行使価格が権利行使期間満了の日に終了する取引日における権利行使対象先物限月取引の清算値段を下回っている場合

3 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、前項本文の規定により権利行使の申告が行われたものとみなすことが適当でないと本所が認めるときは、同項本文の規定は適用しないものとする。

4 国債先物等非清算参加者が第1項に定める権利行使の申告を行った場合(第2項の規定により権利行使の申告が行われたとみなされる場合を含む。)
には、本所は、クリアリング機構から当該申告に係る権利行使の内容の通知を受けるものとする。

(権利行使の割当てに関する通知)

第18条の4 清算取次売建玉につき、クリアリング機構が、クリアリング機構が定めるところにより権利行使の割当てを行った場合には、本所は、クリアリング機構から当該割当てに係る内容の通知を受けるものとする。

(新設)

(清算取次売建玉又は清算取次買建玉の権利行使による国債証券先物取引の取扱い)

第18条の5 国債証券先物オプション取引における権利行使により成立する国債証券先物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国債証券先物取引は、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。

(新設)

(取引代金の授受)

第18条の6 国債先物等非清算参加者は、有価証券等清算取次ぎの委託に基づく国債証券先物オプション取引が成立したときは、その取引代金を、指定国債先物等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、金銭を支払う国債先物等非清算参加者は、クリアリング機構が定める決済時限までの指定国債先物等清算参加者が指定する日時

(新設)

までに、当該指定国債先物等清算参加者に金銭を交付しなければならない。

(転売又は買戻し)

第19条 指数先物等非清算参加者は、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クリアリング機構が定める時限までの指定指数先物等清算参加者が定める時限までに指定指数先物等清算参加者に申告するものとする。ただし、クリアリング機構が定めるところにより指数先物等非清算参加者がクリアリング機構に対して当該申告を行った場合には、この限りではない。

2 (略)

(権利行使の申告)

第21条 (略)

2 指数先物等非清算参加者は、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、前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、権利行使価格がオプション清算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、権利行使価格がオプション清算数値以上である場合

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権利行使の申告が行われないときであっても、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、指数先物等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、権利行使価格がオプション清算数値を上回っている場合

(転売又は買戻し)

第19条 指数先物等非清算参加者は、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クリアリング機構が定める時限までの指定指数先物等清算参加者が定める時限までに指定指数先物等清算参加者に申告するものとする。ただし、クリアリング機構が定めるところにより指数先物等非清算参加者がクリアリング機構に対して当該申告を行った場合には、この限りではない。

2 (略)

(権利行使の申告)

第21条 (略)

2 指数先物等非清算参加者は、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、前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

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権利行使の申告が行われないときであっても、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、指数先物等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、権利行使価格がオプション清算数値を下回っている場合

4 (略)

(権利行使に係る決済のための金銭の授受)

第24条 指数先物等非清算参加者は、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、権利行使価格とオプション清算数値との差に相当する金銭を、指定指数先物等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、金銭を支払う指数先物等非清算参加者は、当該金銭を、クリアリング機構が定める決済時限までの指定指数先物等清算参加者が指定する日時までに、当該指定指数先物等清算参加者に交付しなければならない。

(建玉の申告)

第25条 F X非清算参加者（取引参加者規程第24条第4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、クリアリング機構が定める時限までの指定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（F X清算資格（クリアリング機構の業務方法書に規定するF X清算資格をいう。）に係る他社清算資格を有する者をいう。）をいう。以下同じ。）が定める時限までに指定F X清算参加者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。

(取引証拠金及び未決済約定の引継ぎ等)

第31条 国債証券先物取引、指数先物取引、有価証

(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

4 (略)

(権利行使に係る決済のための金銭の授受)

第24条 指数先物等非清算参加者は、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、指定指数先物等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、金銭を支払う指数先物等非清算参加者は、当該金銭を、クリアリング機構が定める決済時限までの指定指数先物等清算参加者が指定する日時までに、当該指定指数先物等清算参加者に交付しなければならない。

(建玉の申告)

第25条 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、クリアリング機構が定める時限までの指定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（F X清算資格（クリアリング機構の業務方法書に規定するF X清算資格をいう。）に係る他社清算資格を有する者をいう。）をいう。以下同じ。）が定める時限までに指定F X清算参加者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。

(取引証拠金及び未決済約定の引継ぎ等)

第31条 先物・オプション取引に係る取引証拠金及

券オプション取引、国債証券先物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。）に係る取引証拠金及び未決済約定の引継ぎ等に関する事項は、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をもって定める。

2 （略）

（清算資格取得の場合の未決済取引の取扱い）

第32条 非清算参加者（取引参加者規程第24条第5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（国債先物等清算資格、指数先物等清算資格又はF X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市場デリバティブ取引とする。

第2節 市場デリバティブ取引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

（国債先物等清算参加者、指数先物等清算参加者又は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39条 国債先物等清算参加者、指数先物等清算参加者又は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、クリアリング機構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、当該国債先物等清算参加者、指数先物等清算参加者又は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。

第40条・第41条 （略）

び未決済約定の引継ぎ等に関する事項は、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をもって定める。

2 （略）

（清算資格取得の場合の未決済取引の取扱い）

第32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（指数先物等清算資格又はF X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市場デリバティブ取引とする。

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

（指数先物等清算参加者又は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39条 指数先物等清算参加者又は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、クリアリング機構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、当該指数先物等清算参加者又は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。

第41条・第42条 （略）

(国債証券先物取引の決済物件の変更等)

(新設)

第42条 本所は、建玉の状況等から有価証券等清算
取次ぎの委託に基づくLarge取引に係る国債先物等
非清算参加者の受渡決済が困難であると認める場
合は、当該Large取引の決済物件の変更又は受渡決
済期日の変更に関する措置を行うことができる。

付 則

- 1 この改正規定は、平成26年3月24日から施行する。
- 2 前項の規定にかかわらず、この改正規定は、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、平成26年3月24日に施行することが適当でないと本所が認める場合には、当該日以後の本所が定める日から施行する。

受託契約準則の一部改正新・旧対照表

新	旧
(目 的) 第1条 <u>株式会社大阪取引所</u> (以下「取引所」という。) の開設する取引所金融商品市場における市場デリバティブ取引(有価証券等清算取次ぎを除く。) の受託に関する契約については, この準則の定めるところによる。ただし, 取引所外国為替証拠金取引(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。) については, この準則に定めるもののほか, 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をもって定める。 2 (略) (遵守義務) 第2条 顧客及び取引参加者(取引参加者規程第2条第2項に規定する先物取引等取引参加者及び同条第3項に規定する国債先物等取引参加者をいう。以下同じ。) は, この準則を熟読し, これを遵守すべきことに同意してすべての取引を処理するものとする。 (米国に居住する顧客の取引の受託) 第7条 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取引所所定の書面を交付しなければならない。 (1) <u>有価証券オプション取引</u> (2) 次のa又はbの指数オプションを対象とする指数オプション取引 a 日経平均オプション b <u>東証株価指数オプション</u> 2 (略)	(目 的) 第1条 <u>株式会社大阪証券取引所</u> (以下「取引所」という。) の開設する取引所金融商品市場における市場デリバティブ取引(有価証券等清算取次ぎを除く。) の受託に関する契約については, この準則の定めるところによる。ただし, 取引所外国為替証拠金取引(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。) については, この準則に定めるもののほか, 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をもって定める。 2 (略) (遵守義務) 第2条 顧客及び取引参加者(取引参加者規程第2条第2項に規定する先物取引等取引参加者をいう。以下同じ。) は, この準則を熟読し, これを遵守すべきことに同意してすべての取引を処理するものとする。 (米国に居住する顧客の取引の受託) 第7条 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取引所所定の書面を交付しなければならない。 (1) <u>個別証券オプション取引</u> (2) 次のa又はbの指数オプションを対象とする指数オプション取引 a 日経平均オプション b <u>日経300オプション</u> 2 (略)

(顧客の取引の制限)

第8条 顧客は、同一のオプション対象証券に係る有価証券オプションを対象とする有価証券オプション取引を取引参加者(当該顧客が他の取引参加者に先物・オプション取引口座を設定している場合には、当該他の取引参加者を含む。)に委託する場合には、次の各号に掲げる数量が、第4項に規定する制限数量を超えることとなる新規の売付け若しくは新規の買付け又は転売若しくは買戻しの委託を行ってはならない。この場合において、当該オプション対象証券に係る有価証券オプションが、国内の他の金融商品取引所が開設する取引所金融商品市場における有価証券オプション取引の対象であるときは、当該有価証券オプション取引における建玉の数量を、次の各号に掲げる数量に含めるものとする。

- (1) 有価証券プットオプションに係る総売建玉と総買建玉の差引数量
- (2) 有価証券コールオプションに係る総売建玉と総買建玉の差引数量
- (3) (略)

2 (略)

3 第1項の規定は、顧客が日本証券業協会に所属する金融商品取引業者又は外国において金融商品取引業に類似する業を行う外国法人である場合であって、当該顧客に係る有価証券オプション取引の委託が2以上の者の計算によるものであることを当該顧客が取引参加者を通じて取引所に申告し、これを取引所が認めた場合には適用しない。この場合において、当該顧客は、自己の計算による第1項各号に掲げる数量(前項に該当する場合には、同項に定める数量を減じた数量。以下この項において同じ。)又は一の当該顧客以外の者の委託に基づく第1項各号に掲げる数量が、次項に規定する制限数量を超えることとなる新規の売付け若しくは新規の買付け又は転売若しくは買戻しを取引参加者に委託してはならない。

4・5 (略)

(委託の際の指示事項)

第9条 顧客は、市場デリバティブ取引を委託する

(顧客の取引の制限)

第8条 顧客は、同一のオプション対象証券に係る個別証券オプションを対象とする個別証券オプション取引を取引参加者(当該顧客が他の取引参加者に先物・オプション取引口座を設定している場合には、当該他の取引参加者を含む。)に委託する場合には、次の各号に掲げる数量が、第4項に規定する制限数量を超えることとなる新規の売付け若しくは新規の買付け又は転売若しくは買戻しの委託を行ってはならない。この場合において、当該オプション対象証券に係る個別証券オプションが、国内の他の金融商品取引所が開設する取引所金融商品市場における個別証券オプション取引の対象であるときは、当該個別証券オプション取引における建玉の数量を、次の各号に掲げる数量に含めるものとする。

- (1) 個別証券プットオプションに係る総売建玉と総買建玉の差引数量
- (2) 個別証券コールオプションに係る総売建玉と総買建玉の差引数量
- (3) (略)

2 (略)

3 第1項の規定は、顧客が日本証券業協会に所属する金融商品取引業者又は外国において金融商品取引業に類似する業を行う外国法人である場合であって、当該顧客に係る個別証券オプション取引の委託が2以上の者の計算によるものであることを当該顧客が取引参加者を通じて取引所に申告し、これを取引所が認めた場合には適用しない。この場合において、当該顧客は、自己の計算による第1項各号に掲げる数量(前項に該当する場合には、同項に定める数量を減じた数量。以下この項において同じ。)又は一の当該顧客以外の者の委託に基づく第1項各号に掲げる数量が、次項に規定する制限数量を超えることとなる新規の売付け若しくは新規の買付け又は転売若しくは買戻しを取引参加者に委託してはならない。

4・5 (略)

(委託の際の指示事項)

第9条 顧客は、市場デリバティブ取引を委託する

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市場デリバティブ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2号に掲げる事項の指示があったものとみなす。

(1) 次のaからeまでの市場デリバティブ取引の区分に従い、当該区分に定める事項

a 国債証券先物取引

(a) 銘柄

(b) 限月取引

b 指数先物取引

(a) (略)

(b) 日経平均及び東証株価指数を対象とする指数先物取引については、Large取引又はMini取引の別

(c) (略)

c 有価証券オプション取引

(a) (略)

(b) 有価証券オプション1単位のオプション対象証券の数量

(c) 有価証券プットオプション又は有価証券コールオプションの別

(d)・(e) (略)

d 国債証券先物オプション取引

(a) 権利行使により成立する国債証券先物取引の対象銘柄

(b) 国債証券プットオプション又は国債証券コールオプションの別

(c) 限月取引

(d) 権利行使価格

e (略)

(2)～(9) (略)

2・3 (略)

(権利行使により成立する国債証券先物取引に係る委託の際の指示事項等)

第11条の2 顧客が国債証券先物オプション取引における権利行使を委託した場合又はその割当てを受けた場合には、その都度、当該権利行使により成立する国債証券先物取引の限月取引ごとに、第9条

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市場デリバティブ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2号に掲げる事項の指示があったものとみなす。

(1) 次のaからcまでの市場デリバティブ取引の区分に従い、当該区分に定める事項

(新設)

a 指数先物取引

(a) (略)

(b) 日経平均を対象とする指数先物取引については、Large取引又はMini取引の別

(c) (略)

b 個別証券オプション取引

(a) (略)

(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

(c) 個別証券プットオプション又は個別証券コールオプションの別

(d)・(e) (略)

(新設)

c (略)

(2)～(9) (略)

2・3 (略)

(新設)

第1項第2号に掲げる事項を、取引参加者に指示するものとする。

2 第9条第1項ただし書きの規定は、権利行使により成立する国債証券先物取引に係る同条第1項第2号に掲げる事項の指示について準用する。

3 第1項の規定にかかわらず、顧客は、取引参加者とあらかじめ合意することにより、権利行使により成立する国債証券先物取引に係る第9条第1項第2号に掲げる事項の指示を取引が成立した取引日の終了する日の翌日の午前8時20分までの取引参加者の指定する時限までに行うことができる。この場合において、顧客が当該時限までに当該事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を行ったものとみなす。

(移管取引により成立する市場デリバティブ取引に係る委託の際の指示事項等)

第11条の3 第9条の規定にかかわらず、移管取引により成立する市場デリバティブ取引においては、顧客は、市場デリバティブ取引の限月取引ごとに、移管取引が成立した取引日の終了する日の午後4時30分までの取引参加者の指定する時限までに、市場デリバティブ取引の売付け又は買付けに係る同条第1項第2号に掲げる事項のみを指示するものとする。この場合において、顧客が当該時限までに当該事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を行ったものとみなす。

(新設)

2 第9条第1項ただし書きの規定は、移管取引により成立する市場デリバティブ取引に係る前項に規定する指示について準用する。

3 第10条及び前2項の規定にかかわらず、移管取引により成立した市場デリバティブ取引についてギブアップを行おうとする場合は、注文執行取引参加者に対し、同条第1項各号に掲げる事項について、ギブアップに係る取引が成立した取引日の終了する日の午後4時までの当該注文執行取引参加者の指定する時限までに指示するものとする。

4 第10条第3項及び第4項の規定は、移管取引により成立した市場デリバティブ取引についてギブアップを行った清算執行取引参加者の顧客の第9条第1項第2号に掲げる事項の指示について準用

する。

(有価証券オプションの権利行使の指示)

第13条 顧客は、有価証券オプションの権利行使を委託する場合には、銘柄ごとに権利行使に係る数量を、権利行使日の午後4時まで取引参加者に指示するものとする。ただし、権利行使日にギブアップに係る有価証券オプション取引として成立したものについては、午後4時45分までに取引参加者に指示するものとする。

2 (略)

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、前2項に規定する時限までに同項の指示が行われないときであっても、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) 有価証券プットオプションについては、権利行使価格がオプション清算値段（クリアリング機構の業務方法書に定めるオプション清算値段をいう。以下同じ。）を上回っている場合

(2) 有価証券コールオプションについては、権利行使価格がオプション清算値段を下回っている場合

4 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、前項本文の規定により権利行使の申告が行われたものとみなすことが適当でないと本所が認めるときは、同項本文の規定は適用しないものとする。

(国債証券先物オプションの権利行使の指示)

第13条の2 顧客は、国債証券先物オプションの権利行使を委託する場合には、銘柄ごとに権利行使に係る数量を、権利行使を行う日の午後4時まで取引参加者に指示するものとする。

2 権利行使期間満了の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、当該日の前項に規定する時限までに同項の指示が行われないときであっても、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

(個別証券オプションの権利行使の指示)

第13条 顧客は、個別証券オプションの権利行使を委託する場合には、銘柄ごとに権利行使に係る数量を、権利行使日の午後4時まで取引参加者に指示するものとする。ただし、権利行使日にギブアップに係る個別証券オプション取引として成立したものについては、午後4時45分までに取引参加者に指示するものとする。

2 (略)

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、前2項に規定する時限までに同項の指示が行われないときであっても、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) 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

(新設)

(新設)

限りでない。

(1) 国債証券先物プットオプションについては、権利行使価格が権利行使期間満了の日に終了する取引日における権利行使対象先物限月取引の清算値段（クリアリング機構が国債証券先物取引の清算値段として定める値段をいう。以下同じ。）を上回っている場合

(2) 国債証券先物コールオプションについては、権利行使価格が権利行使期間満了の日に終了する取引日における権利行使対象先物限月取引の清算値段を下回っている場合

3 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、前項本文の規定により権利行使の申告が行われたものとみなすことが適当でないと本所が認めるときは、同項本文の規定は適用しないものとする。

(指数オプションの権利行使の指示)

第14条 顧客は、指数オプションの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、権利行使価格がオプション清算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、権利行使価格がオプション清算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ときであっても、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、権利行使価格がオプション清算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、権利行使価格がオプション清算数値を下回っている場合

(指数オプションの権利行使の指示)

第14条 顧客は、指数オプションの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ときであっても、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5章 顧客の決済等

第1節 国債証券先物取引に係る顧客の決済等

(決済のために授受する金銭)

第14条の2 顧客と取引参加者との間でLarge取引の決済のために授受する金銭(当該顧客が受渡決済を行う場合における第14条の7の規定に基づき算出する受渡決済代金を除く。)は、当該顧客が転売又は買戻しにより決済を行う場合には当該転売又は買戻しに該当する当該顧客の委託に基づく未決済約定に係る約定値段と当該転売又は買戻しに係る約定値段の差に1億円の100分の1を乗じて得た額の合計額とし、当該顧客が受渡決済を行う場合には当該顧客の委託に基づく未決済約定に係る約定値段と受渡決済値段(受渡決済において授受する受渡決済代金を算出するための基準とする値段をいう。以下同じ。)との差に1億円の100分の1を乗じて得た額の合計額とする。

2 顧客と取引参加者との間でMini取引の決済のために授受する金銭は、当該顧客が転売又は買戻しによりMini取引の決済を行う場合には当該転売又は買戻しに該当する当該顧客の委託に基づく未決済約定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とし、当該顧客の委託に基づく未決済約定が最終決済により決済される場合には当該顧客の委託に基づく未決済約定に係る約定数値と最終清算数値との差に相当する金銭とする。

3 顧客が国債証券先物取引の決済を行う場合において、損失が生じているときは、当該顧客は当該損失に相当する金銭を、転売又は買戻しにより決済を行う場合には当該決済に係る転売又は買戻しが成立した取引日の終了する日の翌日(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。以下この章において同じ。))である場合は、当該取引日の終了する日から起算して3日目(休業日を除外する。以下日数計算について同じ。))の日)までの取引参加者が指定する日時までに、Large取

第5章 顧客の決済等

(新設)

(新設)

引において受渡決済を行う場合には当該限月取引の取引最終日の終了する日の翌日(当該顧客が非居住者である場合は、当該取引最終日の終了する日から起算して3日目の日)までの取引参加者が指定する日時までに、Mini取引において最終決済を行う場合には当該限月取引の最終決済期日(当該顧客が非居住者である場合は、その翌日)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金銭への充当)

第14条の3 取引参加者は、顧客が前条第3項の規定により当該取引参加者に差し入れるべき金銭については、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。

(新設)

(受渡適格銘柄)

第14条の4 顧客と取引参加者との間のLarge取引における受渡決済においては、次の各号に掲げる国債証券を決済物件として取り扱うものとする。

(新設)

(1) 中期国債標準物については、発行日及び受渡決済期日に4年以上5年3か月未満の残存期間を有する利付国債証券のうち、発行日の属する月が受渡決済期日の属する月の3か月前の月以前のもの

(2) 長期国債標準物については、発行日及び受渡決済期日に7年以上11年未満の残存期間を有する利付国債証券のうち、発行日の属する月が受渡決済期日の属する月の3か月前の月以前のもの

(3) 超長期国債標準物については、発行日及び受渡決済期日に18年以上21年未満の残存期間を有する利付国債証券のうち、発行日の属する月が受渡決済期日の属する月の3か月前の月以前のもの

(標準物と受渡適格銘柄との交換比率の算定)

第14条の5 Large取引について、顧客が受渡決済を行う場合の標準物と受渡適格銘柄との交換比率は、

(新設)

業務規程の別表「標準物と受渡適格銘柄との交換比率の算定に関する表」により算定するものとする。

(受渡決済に伴う経過利子の取扱い)

第14条の6 顧客がLarge取引において受渡決済を行う場合における経過利子の取扱いは、顧客からの申告に基づき、課税扱い又は非課税扱いにより取り扱うものとする。ただし、非課税扱いの申告をした顧客のうち、クリアリング機構が指定した顧客については、当該顧客の経過利子の全部又は一部を課税扱いとする。

(新設)

2 顧客は、前項に規定する経過利子の取扱いについて、取引参加者が当該Large取引の受渡決済を行うために必要と認めて指定する日時までに、取引参加者に申告するものとする。

(受渡決済代金の算出方法)

第14条の7 顧客と取引参加者との間でLarge取引の受渡決済のために授受する受渡決済代金は、当該限月取引の受渡決済値段に売付けを委託した顧客（以下「売付顧客」という。）が指定した受渡適格銘柄又は買付けを委託した顧客（以下「買付顧客」という。）ごとに取引参加者が指定した受渡適格銘柄について第14条の5の規定に基づき算定した交換比率を乗じて得た額に、当該受渡適格銘柄の額面総額の100分の1を乗じて算出するものとする。

(新設)

2 受渡決済において授受する経過利子は、前項の規定に基づき算出した受渡決済代金に加算するものとする。

(決済物件の組合せ)

第14条の8 決済物件は、売付顧客の選択により、受渡適格銘柄ごとに取引単位の整数倍で組み合わせることができるものとする。

(新設)

(決済物件の申告)

第14条の9 売付顧客がLarge取引において受渡決済を行う場合には、当該売付顧客は、取引参加者が受渡決済を行うために必要と認めて指定する日時までに、受渡決済に供する銘柄及び数量を取引参加者に申告するものとする。

(新設)

(顧客の受渡時限)

第14条の10 顧客は、Large取引の受渡決済については、取引参加者が当該Large取引の受渡決済を行うために必要と認めて指定する日時までに、売付国債証券又は買付代金を取引参加者に交付するものとする。

(新設)

(口座振替による受渡し)

第14条の11 取引参加者は、顧客との間でLarge取引の受渡決済を行うときは、その顧客のために社債、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。）に基づく口座を設定し、売付け又は買付けに係る国債証券の受渡しは、その口座の振替（クリアリング機構の業務方法書の規定により経過利子について非課税扱いと定められた場合の受渡決済にあつては、非課税口座の振替。以下この条において同じ。）により行うものとする。ただし、日本銀行における口座の振替により国債証券の受渡しを行う場合は、この限りでない。

(新設)

(日本銀行国債振替決済業務規程の適用)

第14条の12 Large取引の受渡決済については、この準則に定めるもののほか、日本銀行が定める日本銀行国債振替決済業務規程に基づき取引参加者と顧客との間で締結された契約によるものとする。

(新設)

第1節の2 指数先物取引に係る顧客の決済

第1節 指数先物取引に係る顧客の決済

(指数先物取引に係る決済のために授受する金銭)

(指数先物取引に係る決済のために授受する金銭)

第15条 (略)

第15条 (略)

2 顧客が指数先物取引の決済を行う場合において、損失が生じているときは、当該顧客は当該損失に相当する金銭を、転売又は買戻しにより決済を行う場合には当該決済に係る転売又は買戻しが成立した取引日の終了する日の翌日（当該顧客が非居住者である場合は、当該成立した取引日の終了する日から起算して3日目の日）までの取引参加者が指定する日時までに、最終決済により決済される場合には当該限月取引の最終決済期日（当該顧客が非居住

2 顧客が指数先物取引の決済を行う場合において、損失が生じているときは、当該顧客は当該損失に相当する金銭を、転売又は買戻しにより決済を行う場合には当該決済に係る転売又は買戻しが成立した取引日の終了する日の翌日（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。以下この章において同じ。）である場合は、当該成立した取引日の終了する日から起算して3日

者である場合は、当該最終決済期日の翌日)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。

第2節 有価証券オプション取引に係る顧客の決済等

(取引代金の差入れ)

第17条 顧客は、有価証券オプション取引の買付けの委託については、当該買付けに係る取引代金を、取引成立の日の翌日(当該顧客が非居住者である場合は、当該取引成立の日から起算して3日目の日)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。

(顧客の権利行使に係る決済時限等)

第19条 顧客が第13条第1項及び第2項に規定する指示を行った場合及び有価証券オプションの権利行使の割当てを受けた場合に成立するオプション対象証券の売買に係る決済は、権利行使日から起算して5日目の日の午前9時までに、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に係る次条に規定する金銭又は有価証券を、取引参加者に差し入れるものとする。ただし、オプション対象証券の売買に係る配当落等の期日(指定取引所が定める配当落等の期日であって、普通取引に係るものに限る。以下同じ。)又は株式併合後の株券の売買開始の期日(指定取引所が定める株式併合後の株券の売買開始の期日であって、普通取引に係るものに限る。以下同じ。)の前日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。以下同じ。)に行われた権利行使により成立する当該オプション対象証券の売買に係る決済の場合は、当該権利行使日から起算して4日目の日の午前9時までに差し入れるものとする。

2 (略)

目(休業日を除外する。以下日数計算について同じ。)の日までの取引参加者が指定する日時までに、最終決済により決済される場合には当該限月取引の最終決済期日(当該顧客が非居住者である場合は、当該最終決済期日の翌日)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。

第2節 個別証券オプション取引に係る顧客の決済等

(取引代金の差入れ)

第17条 顧客は、個別証券オプション取引の買付けの委託については、当該買付けに係る取引代金(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、取引成立の日の翌日(当該顧客が非居住者である場合は、当該取引成立の日から起算して3日目の日)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。

(顧客の権利行使に係る決済時限等)

第19条 顧客が第13条第1項及び第2項に規定する指示を行った場合及び個別証券オプションの権利行使の割当てを受けた場合に成立するオプション対象証券の売買に係る決済は、権利行使日から起算して5日目の日の午前9時までに、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に係る次条に規定する金銭又は有価証券を、取引参加者に差し入れるものとする。ただし、オプション対象証券の売買に係る配当落等の期日(指定取引所が定める配当落等の期日であって、普通取引に係るものに限る。以下同じ。)又は株式併合後の株券の売買開始の期日(指定取引所が定める株式併合後の株券の売買開始の期日であって、普通取引に係るものに限る。以下同じ。)の前日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。以下同じ。)に行われた権利行使により成立する当該オプション対象証券の売買に係る決済の場合は、当該権利行使日から起算して4日目の日の午前9時までに差し入れるものとする。

2 (略)

(DVP決済を利用する場合の顧客の受渡し)

第20条 顧客が第13条第1項に規定する指示を行った場合及び有価証券オプション取引の権利行使の割当てを受けた場合に成立するオプション対象証券の売買について、顧客と取引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DVP決済を利用する場合には、顧客は、前条第1項に定める日の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、合意に際して取引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 (略)

(決済のために交付する金銭及び有価証券)

第21条 顧客が、有価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買に係る決済のために、取引参加者に交付する金銭又は有価証券の数量は、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) 有価証券オプション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である場合

a 当該顧客が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売付顧客であるとき

有価証券オプション1単位のオプション対象証券の数量に当該権利行使に係る有価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

b 当該顧客が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顧客であるとき

買付代金（有価証券オプション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て得た額（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有価証券オプションの数量を乗じて算出した額とする。以下同じ。）

(DVP決済を利用する場合の顧客の受渡し)

第20条 顧客が第13条第1項に規定する指示を行った場合及び個別証券オプション取引の権利行使の割当てを受けた場合に成立するオプション対象証券の売買について、顧客と取引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DVP決済を利用する場合には、顧客は、前条第1項に定める日の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、合意に際して取引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 (略)

(決済のために交付する金銭及び有価証券)

第21条 顧客が、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買に係る決済のために、取引参加者に交付する金銭又は有価証券の数量は、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である場合

a 当該顧客が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売付顧客であるとき

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

b 当該顧客が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顧客であるとき

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て得た額（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とする。以下同じ。）

(2) 有価証券オプション 1 単位 of 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を上回る場合

a 当該顧客が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売付顧客であるとき

(a) 売買単位未満数量にオプション清算値段を乗じて得た額（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有価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

(b) 有価証券オプション 1 単位 of 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有価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

b (略)

(3) 有価証券オプション 1 単位 of 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

a・b (略)

2 (略)

(有価証券引渡票の交付を受けた場合の措置)

第22条 取引参加者は、有価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買付けに係る決済に際し、買付オプション対象証券に代えて有価証券引渡票の交付を受けた場合において、買付顧客の承諾を受けたときは、当該買付オプション対象証券の顧客への引渡しを延期することができる。

(顧客の決済物件の制限等)

第23条 有価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買の決済に伴う有価証券の授受について、旧有価証券と新有価証券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後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) 個別証券オプション 1 単位 of 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を上回る場合

a 当該顧客が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売付顧客であるとき

(a) 売買単位未満数量にオプション清算値段を乗じて得た額（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に相当する金銭

(b) 個別証券オプション 1 単位 of 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

b (略)

(3) 個別証券オプション 1 単位 of 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

a・b (略)

2 (略)

(有価証券引渡票の交付を受けた場合の措置)

第22条 取引参加者は、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買付けに係る決済に際し、買付オプション対象証券に代えて有価証券引渡票の交付を受けた場合において、買付顧客の承諾を受けたときは、当該買付オプション対象証券の顧客への引渡しを延期することができる。

(顧客の決済物件の制限等)

第23条 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買の決済に伴う有価証券の授受について、旧有価証券と新有価証券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後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。

(保管振替機構等の規則の適用)

第24条 有価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買の受託に関する契約については、この準則に定めるもののほか、株式会社証券保管振替機構（以下「保管振替機構」という。）が定める株式等の振替に関する業務規程に基づき取引参加者と顧客との間で締結される契約によるものとする。

(口座振替による受渡し)

第25条 取引参加者は、顧客から有価証券オプション取引の委託を受けたときは、当該顧客のために振替法に基づく口座を設定し、有価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付け又は買付けに係る有価証券の受渡しを、その口座との間の振替により行うものとする。ただし、振替法に基づく顧客の他の口座との間の振替により有価証券の受渡しを行う場合は、この限りでない。

(顧客の権利行使に対する取引参加者の信用供与)

第26条 顧客は、有価証券オプションの権利行使の委託の指示を行った場合又は権利行使の割当てを受けた場合に成立するオプション対象証券の売買の決済(第21条第1項第2号に規定する有価証券オプションを対象とする有価証券オプション取引における権利行使である場合には、同号a(b)に規定する数量の有価証券に係るものに限る。)のため、取引参加者から信用の供与を受ける場合には、あらかじめ信用取引口座を設定しなければならない。

2 信用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、取引所が定める様式による信用取引口座設定約諾書に所定事項を記載し、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 第5条第4項及び第5項の規定は、前項の規定による約諾書の差入れについて準用する。この場合

(保管振替機構等の規則の適用)

第24条 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買の受託に関する契約については、この準則に定めるもののほか、株式会社証券保管振替機構（以下「保管振替機構」という。）が定める株式等の振替に関する業務規程に基づき取引参加者と顧客との間で締結される契約によるものとする。

(口座振替による受渡し)

第25条 取引参加者は、顧客から個別証券オプション取引の委託を受けたときは、当該顧客のために社債、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。）に基づく口座を設定し、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付け又は買付けに係る有価証券の受渡しを、その口座との間の振替により行うものとする。ただし、振替法に基づく顧客の他の口座との間の振替により有価証券の受渡しを行う場合は、この限りでない。

(顧客の権利行使に対する取引参加者の信用供与)

第26条 顧客は、個別証券オプションの権利行使の委託の指示を行った場合又は権利行使の割当てを受けた場合に成立するオプション対象証券の売買の決済(第21条第1項第2号に規定する個別証券オプションを対象とする個別証券オプション取引における権利行使である場合には、同号a(b)に規定する数量の有価証券に係るものに限る。)のため、取引参加者から信用の供与を受ける場合には、あらかじめ信用取引口座を設定しなければならない。

(新設)

(新設)

(新設)

において、同条第4項中「第2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。）」とあるのは、「前項の規定」と読み替えるものとする。

5 第1項の信用の供与については、東京証券取引所の受託契約準則第4章を準用するものとする。この場合において、「取引参加者」とあるのは「株式会社大阪取引所の先物取引等取引参加者」と、同第39条中「売買成立の日」とあるのは「権利行使日の翌日」と、同第43条中「信用取引による売付け又は買付けが成立した日」とあるのは「権利行使日の翌日」と、同第48条中「その損失計算が生じた日」とあるのは「その損失計算が生じた日又は権利行使日の翌日」と読み替えるものとする。

6・7 (略)

8 第5項の場合において、顧客が、当該信用取引を、当該オプション対象証券と同一銘柄の対当する数量の反対売買（当該反対売買に係る取引所の定める決済日が当該信用取引によるオプション対象証券の売付け又は買付けに係る取引所の定める決済日と同一日であるものに限る。）により決済する場合には、同項の規定において準用する東京証券取引所の受託契約準則第39条の規定は適用しない。

第2節の2 国債証券先物オプション取引に係る顧客の決済等

(顧客の決済時限)

第26条の2 顧客は、国債証券先物オプション取引の買付けの委託については、当該買付けに係る取引代金を、取引が成立した取引日の終了する日の翌日（当該顧客が非居住者である場合は、当該取引日の終了する日から起算して3日目の日）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。

(証拠金の取引代金への充当)

第26条の3 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については、当該顧客が当該差入れをすべき日において

2 前項の信用の供与については、東京証券取引所の受託契約準則第4章を準用するものとする。この場合において、「取引参加者」とあるのは「株式会社大阪証券取引所の先物取引等取引参加者」と、同第39条中「売買成立の日」とあるのは「権利行使日の翌日」と、同第43条中「信用取引による売付け又は買付けが成立した日」とあるのは「権利行使日の翌日」と、同第48条中「その損失計算が生じた日」とあるのは「その損失計算が生じた日又は権利行使日の翌日」と読み替えるものとする。

3・4 (略)

5 第2項の場合において、顧客が、当該信用取引を、当該オプション対象証券と同一銘柄の対当する数量の反対売買（当該反対売買に係る取引所の定める決済日が当該信用取引によるオプション対象証券の売付け又は買付けに係る取引所の定める決済日と同一日であるものに限る。）により決済する場合には、第2項の規定において準用する東京証券取引所の受託契約準則第39条の規定は適用しない。

(新設)

(新設)

(新設)

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。

(指数オプション取引の決済のために授受する金銭)

第27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オプション清算数値との差に相当する金銭とする。

(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31条 清算参加者（国債先物等清算参加者（清算・決済規程第4条第1項に規定する国債先物等清算参加者をいう。以下同じ。）又は指数先物等清算参加者（同第4条第2項に規定する指数先物等清算参加者をいう。以下同じ。）をいう。以下同じ。）である取引参加者が改善指示（クリアリング機構の業務方法書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。）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市場デリバティブ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市場デリバティブ取引に係る取引証拠金についてクリアリング機構の業務方法書第29条の2第2項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市場デリバティブ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（先物取引に係る転売若しくは買戻し又は

(指数オプション取引の決済のために授受する金銭)

第27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。

(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31条 指数先物等清算参加者（清算・決済規程第4条第1項に規定する指数先物等清算参加者をいう。以下同じ。）である取引参加者が改善指示（クリアリング機構の業務方法書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。）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市場デリバティブ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市場デリバティブ取引に係る取引証拠金についてクリアリング機構の業務方法書第29条の2第2項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指数先物等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、当該指数先物等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市場デリバティブ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（指数先物取引に係る転売若しくは

オプション取引に係る転売、買戻し若しくは権利行使（これらの委託を含む。）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、非清算参加者（取引参加者規程第24条第2項に規定する国債先物等非清算参加者又は同第24条第3項に規定する指数先物等非清算参加者をいう。以下同じ。）に係る指定清算参加者（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他社清算参加者（国債先物等清算資格（クリアリング機構の業務方法書に規定する国債先物等清算資格をいう。））又は指数先物等清算資格（クリアリング機構の業務方法書に規定する指数先物等清算資格をいう。）に係る他社清算資格を有する者をいう。）をいう。以下同じ）が改善指示を受けた場合であって、当該指定清算参加者が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市場デリバティブ取引に係る未決済約定の決済又は他の清算参加者への引継ぎの指示を当該非清算参加者に対して行ったときについて準用する。

（外貨による金銭の授受）

第32条 顧客と取引参加者との間における市場デリバティブ取引（有価証券オプションの権利行使により成立する有価証券の売買を含む。）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。

（顧客の決済不履行の場合の処置）

第33条 顧客が、所定の時限（国債証券先物取引に係るLarge取引にあつては、第14条の10に規定する取引参加者が必要と認めて指定する日時を含む。）までに、市場デリバティブ取引に関し取引参加者に

は買戻し又はオプション取引に係る転売、買戻し若しくは権利行使（これらの委託を含む。）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、当該指数先物等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項に規定する指数先物等非清算参加者に係る指定指数先物等清算参加者（当該指数先物等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指数先物等他社清算参加者（指数先物等清算資格（クリアリング機構の業務方法書に規定する指数先物等清算資格をいう。）に係る他社清算資格を有する者をいう。）をいう。以下同じ）が改善指示を受けた場合であって、当該指定指数先物等清算参加者が当該指数先物等非清算参加者の有価証券等清算取次ぎの委託に基づく市場デリバティブ取引に係る未決済約定の決済又は他の指数先物等清算参加者への引継ぎの指示を当該指数先物等非清算参加者に対して行ったときについて準用する。

（外貨による金銭の授受）

第32条 顧客と取引参加者との間における市場デリバティブ取引（個別証券オプションの権利行使により成立する有価証券の売買を含む。）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。

（顧客の決済不履行の場合の処置）

第33条 顧客が、所定の時限までに、市場デリバティブ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、支払うべき金銭若しくは買付けに係

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、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又は受渡決済に係る売付国債証券若しくは買付代金若しくは権利行使に係る決済代金若しくは引渡有価証券を取引参加者に交付しない場合には、当該取引参加者は、任意に、当該市場デリバティブ取引を決済するために、当該顧客の計算において、先物取引に係る転売若しくは買戻し又は受渡決済若しくは最終決済、オプション取引に係る転売若しくは買戻し、権利行使又は有価証券の売付契約若しくは買付契約の締結（これらの委託を含む。）を行うことができる。

付 則

- 1 この改正規定は、平成26年3月24日から施行する。
- 2 前項の規定にかかわらず、この改正規定は、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、平成26年3月24日に施行することが適当でないと本所が認める場合には、当該日以後の本所が定める日から施行する。
- 3 この改正規定施行の日（以下「施行日」という。）の前日における東京証券取引所の開設する取引所金融商品市場における市場デリバティブ取引に係る未決済約定については、顧客は、施行日以降、本所の市場において、本所の取引参加者に転売又は買戻しの委託を行うことができる。

る取引代金を支払わない場合又は権利行使に係る決済代金若しくは引渡有価証券を取引参加者に交付しない場合には、当該取引参加者は、任意に、当該市場デリバティブ取引を決済するために、当該顧客の計算において、指数先物取引に係る転売若しくは買戻し又は最終決済、オプション取引に係る転売若しくは買戻し、権利行使又は有価証券の売付契約若しくは買付契約の締結（これらの委託を含む。）を行うことができる。

J－N E T市場に関する業務規程及び受託契約準則の特例の一部改正新・旧対照表

新	旧
(用語の意義) 第2条 この特例において使用する用語の意義については、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)・(2) (略) (3) J－N E Tコンボ取引とは、この特例に定めるところに従って本所が定める数の銘柄（先物取引にあっては限月取引をいう。以下同じ。）に係る売付け及び買付けを同時に行う市場デリバティブ取引をいう。 (4) (略) (J－N E T取引の呼値) 第3条 取引参加者（取引参加者規程第2条第2項に規定する先物取引等取引参加者又は同条第3項に規定する<u>国債先物等取引参加者</u>をいう。以下同じ。）は、J－N E T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その他本所が必要と認める事項を、本所に対し明らかにしなければならない。 2～6 (略) (J－N E T取引の取引時間) 第4条 J－N E T取引の取引時間は、次の各号に掲げる市場デリバティブ取引の区分ごとに、当該各号に定める時間とする。 (1) <u>国債証券先物取引及び国債証券先物オプション取引</u> <u>午前8時20分から午後3時15分まで及び午後3時25分から翌日の午前3時まで</u> (2) <u>指数先物取引</u>（日経平均ボラティリティー・インデックスを対象とする指数先物取引（以下「日経平均V I 先物取引」という。）を除く。）及び指数オプション取引	(用語の意義) 第2条 この特例において使用する用語の意義については、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)・(2) (略) (3) J－N E Tコンボ取引とは、この特例に定めるところに従って本所が定める数の銘柄（<u>指数先物取引</u>にあっては限月取引をいう。以下同じ。）に係る売付け及び買付けを同時に行う市場デリバティブ取引をいう。 (4) (略) (J－N E T取引の呼値) 第3条 取引参加者（取引参加者規程第2条第2項に規定する先物取引等取引参加者をいう。以下同じ。）は、J－N E T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その他本所が必要と認める事項を、本所に対し明らかにしなければならない。 2～6 (略) (J－N E T取引の取引時間) 第4条 J－N E T取引の取引時間は、次の各号に掲げる市場デリバティブ取引の区分ごとに、当該各号に定める時間とする。 (新設) (1) <u>指数先物取引</u>（日経平均ボラティリティー・インデックスを対象とする指数先物取引（以下「日経平均V I 先物取引」という。）を除く。）及び指数オプション取引

午前 8 時20分から午後 4 時まで及び午後 4 時15分から翌日の午前 3 時まで

(3) 日経平均 V I 先物取引及び有価証券オプション取引

午前 8 時20分から午後 4 時まで

2 (略)

(J－NET取引の一時中断)

第 7 条 本所は、次の各号に掲げる場合には、当該各号に定める銘柄について立会による取引を一時中断している間、当該各号に定める銘柄に係る J－NET取引を一時中断する。

(1) 業務規程第33条第 1 項の規定により先物取引の全部又は一部の銘柄に係る立会による取引の一時中断が行われた場合（同条第 3 項の規定により取引の一時中断が行われた場合を含む。）

当該取引の一時中断が行われた銘柄

(2) 業務規程第33条第 4 項の規定により国債証券先物オプション取引又は指数オプション取引の全部又は一部の銘柄について立会による取引の一時中断が行われた場合

当該取引の一時中断が行われた銘柄

(J－NET取引の停止)

第 8 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、J－NET取引（第 1 号にあつては国債証券先物取引、第 2 号にあつては指数先物取引、第 3 号から第 5 号までにあつては有価証券オプション取引、第 6 号にあつては国債証券先物オプション取引、第 7 号にあつては指数オプション取引に限る。）を停止することができる。

(1) 業務規程第32条の規定により、立会による国債証券先物取引の停止が行われた場合

(2) (略)

(3) 業務規程第32条の規定により、立会による有価証券オプション取引の停止が行われた場合

(4)・(5) (略)

(6) 業務規程第32条の規定により、立会による国債証券先物オプション取引の停止が行われた場合

(7)～(9) (略)

午前 8 時20分から午後 4 時まで及び午後 4 時30分から翌日の午前 3 時まで

(2) 日経平均 V I 先物取引及び個別証券オプション取引

午前 8 時20分から午後 4 時まで

2 (略)

(J－NET取引の一時中断)

第 7 条 本所は、次の各号に掲げる場合には、当該各号に定める銘柄について立会による取引を一時中断している間、当該各号に定める銘柄に係る J－NET取引を一時中断する。

(1) 業務規程第33条第 1 項の規定により指数先物取引の全部又は一部の銘柄に係る立会による取引の一時中断が行われた場合

当該取引の一時中断が行われた銘柄

(2) 業務規程第33条第 3 項の規定により指数オプション取引の全部又は一部の銘柄について立会による取引の一時中断が行われた場合

当該取引の一時中断が行われた銘柄

(J－NET取引の停止)

第 8 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、J－NET取引（第 1 号にあつては指数先物取引、第 2 号から第 4 号までにあつては個別証券オプション取引、第 5 号にあつては指数オプション取引に限る。）を停止することができる。

(新設)

(1) (略)

(2) 業務規程第32条の規定により、立会による個別証券オプション取引の停止が行われた場合

(3)・(4) (略)

(新設)

(5)～(7) (略)

(委託の際の指示事項等)

第11条 顧客が J－N E T取引の委託をする場合には、その都度、次の各号に掲げる事項を取引参加者に指示又は通知するものとする。ただし、顧客があらかじめ指定した方法に従い J－N E T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3号に掲げる事項の指示があったものとみなす。

(1) (略)

(2) 次の a から e までの市場デリバティブ取引の区分に従い、当該区分に定める事項

a 国債証券先物取引

(a) 銘柄

(b) 限月取引

b 指数先物取引

(a) (略)

(b) 日経平均及び東証株価指数を対象とする指数先物取引については、Large取引又はMini取引の別

(c) (略)

c 有価証券オプション取引

(a) (略)

(b) 有価証券オプション1単位のオプション対象証券の数量

(c) 有価証券プットオプション又は有価証券コールオプションの別

(d)・(e) (略)

d 国債証券先物オプション取引

(a) 権利行使により成立する国債証券先物取引の対象銘柄

(b) 国債証券先物プットオプション又は国債証券先物コールオプションの別

(c) 限月取引

(d) 権利行使価格

e (略)

(3)～(7) (略)

2・3 (略)

(委託の際の指示事項等)

第11条 顧客が J－N E T取引の委託をする場合には、その都度、次の各号に掲げる事項を取引参加者に指示又は通知するものとする。ただし、顧客があらかじめ指定した方法に従い J－N E T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3号に掲げる事項の指示があったものとみなす。

(1) (略)

(2) 次の a から c までの市場デリバティブ取引の区分に従い、当該区分に定める事項

(新設)

a 指数先物取引

(a) (略)

(b) 日経平均を対象とする指数先物取引については、Large取引又はMini取引の別

(c) (略)

b 個別証券オプション取引

(a) (略)

(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

(c) 個別証券プットオプション又は個別証券コールオプションの別

(d)・(e) (略)

(新設)

c (略)

(3)～(7) (略)

2・3 (略)

付 則

- 1 この改正規定は、平成26年 3 月24日から施行する。
- 2 前項の規定にかかわらず、この改正規定は、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、平成26年 3 月24日に施行することが適当でないと本所が認める場合には、当該日以後の本所が定める日から施行する。

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の一部改正新・旧対照表

新	旧
(呼 値) 第16条 (略) 2～8 (略) <u>9 F X取引参加者は、非マーケットメイカー呼値を自己の計算により行おうとするときは、新規の売付け若しくは新規の買付け又は転売若しくは買戻しの別を明らかにすることを要しない。</u> <u>10</u> (略) (本所の市場における取引所F X取引の方法等) 第31条 (略) <u>2 F X取引参加者は、F X取引参加者端末装置と売買システムの接続においては、接続仕様その他の本所が定める事項を遵守しなければならない。</u> <u>3 F X取引参加者は、本所が定めるところによりF X取引参加者端末装置に関する事項について本所に報告するとともに、売買システムが安定的に稼働するよう協力するものとする。</u> <u>4・5</u> (略) (ポジション保有状況の改善指示を受けたF X取引参加者が行う措置等) 第41条 F X清算参加者(清算・決済規程第4条第<u>3項</u>に規定するF X清算参加者をいう。以下同じ。)であるF X取引参加者が改善指示(クリアリング機構の業務方法書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。)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取引所F X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F X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取引所F X取引に係る取引証拠金についてクリアリング機構の業務方法書第29条の2第2項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F X	(呼 値) 第16条 (略) 2～8 (略) (新設) <u>9</u> (略) (本所の市場における取引所F X取引の方法等) 第31条 (略) (新設) (新設) <u>2・3</u> (略) (ポジション保有状況の改善指示を受けたF X取引参加者が行う措置等) 第41条 F X清算参加者(清算・決済規程第4条第<u>2項</u>に規定するF X清算参加者をいう。以下同じ。)であるF X取引参加者が改善指示(クリアリング機構の業務方法書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。)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取引所F X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F X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取引所F X取引に係る取引証拠金についてクリアリング機構の業務方法書第29条の2第2項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F X

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 (略)

3 前2項の規定は、取引参加者規程第24条第4項に規定するF X非清算参加者に係る指定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(F X清算資格(クリアリング機構の業務方法書に規定するF X清算資格をいう。)に係る他社清算資格を有する者をいう。)をいう。以下同じ。)が改善指示を受けた場合であって、当該指定F X清算参加者が当該F X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F X取引に係る未決済約定の決済又は他のF X清算参加者への引継ぎの指示を当該F X非清算参加者に対して行ったときについて準用する。

(受託契約準則の読替え)

第43条 取引所F X取引に係る受託契約準則第2条の規定の適用については、同条中「取引参加者(取引参加者規程第2条第2項に規定する先物取引等取引参加者をいう。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4項に規定するF X取引参加者をいう。)」とする。

付 則

- 1 この改正規定は、平成26年3月24日から施行する。
- 2 前項の規定にかかわらず、この改正規定は、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、平成26年3月24日に施行することが適当でないと本所が認める場合には、当該日以後の本所が定める日から施行する。

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 (略)

3 前2項の規定は、取引参加者規程第24条第3項に規定するF X非清算参加者に係る指定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(F X清算資格(クリアリング機構の業務方法書に規定するF X清算資格をいう。)に係る他社清算資格を有する者をいう。)をいう。以下同じ。)が改善指示を受けた場合であって、当該指定F X清算参加者が当該F X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F X取引に係る未決済約定の決済又は他のF X清算参加者への引継ぎの指示を当該F X非清算参加者に対して行ったときについて準用する。

(受託契約準則の読替え)

第43条 取引所F X取引に係る受託契約準則第2条の規定の適用については、同条中「取引参加者(取引参加者規程第2条第2項に規定する先物取引等取引参加者をいう。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3項に規定するF X取引参加者をいう。)」とする。

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一部改正新・旧対照表

新	旧
(目 的) 第1条 この規則は、清算・決済規程第31条第1項及び受託契約準則第12条の規定に基づき、<u>国債証券先物取引</u>、<u>指数先物取引</u>、<u>有価証券オプション取引</u>、<u>国債証券先物オプション取引</u>及び<u>指数オプション取引</u>（以下「先物・オプション取引」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 (略) (定 義) 第2条 この規則において「先物取引」とは、本所が開設する取引所金融商品市場における<u>国債証券先物取引</u>又は<u>指数先物取引</u>をいう。 2 この規則において「オプション取引」とは、本所が開設する取引所金融商品市場における<u>有価証券オプション取引</u>、<u>国債証券先物オプション取引</u>又は<u>指数オプション取引</u>をいう。 3 この規則において「取引参加者」とは、取引参加者規程第2条第2項に規定する先物取引等取引参加者又は同条第3項に規定する<u>国債先物等取引参加者</u>をいう。 4 この規則において「先物・オプション取引に係る債務」とは、先物・オプション取引の決済に係る金銭の支払債務、<u>国債証券先物取引</u>における<u>受渡決済</u>及び<u>有価証券オプション取引</u>における権利行使による決済に係る有価証券の引渡債務並びにその他の先物・オプション取引に関して負担すべき債務をいう。 5～8 (略) 9 この規則において「非清算参加者」とは、取引参加者規程第24条第2項に規定する<u>国債先物等非清算参加者</u>及び同条第3項に規定する<u>指数先物等非清算参加者</u>をいう。 10 この規則において「指定清算参加者」とは、取引参加者規程第27条第1項に規定する指定清算参	(目 的) 第1条 この規則は、清算・決済規程第31条第1項及び受託契約準則第12条の規定に基づき、<u>指数先物取引</u>、<u>個別証券オプション取引</u>及び<u>指数オプション取引</u>（以下「先物・オプション取引」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 (略) (定 義) 第2条 この規則において「先物取引」とは、本所が開設する取引所金融商品市場における<u>指数先物取引</u>をいう。 2 この規則において「オプション取引」とは、本所が開設する取引所金融商品市場における<u>個別証券オプション取引</u>又は<u>指数オプション取引</u>をいう。 3 この規則において「取引参加者」とは、取引参加者規程第2条第2項に規定する先物取引等取引参加者をいう。 4 この規則において「先物・オプション取引に係る債務」とは、先物・オプション取引の決済に係る金銭の支払債務及び<u>個別証券オプション取引</u>における権利行使による決済に係る有価証券の引渡債務並びにその他の先物・オプション取引に関して負担すべき債務をいう。 5～8 (略) 9 この規則において「非清算参加者」とは、取引参加者規程第24条第2項に規定する<u>非清算参加者</u>をいう。 10 この規則において「指定清算参加者」とは、取引参加者規程第27条第1項に規定する指定清算参

加者のうち、国債先物等非清算参加者又は指数先物等非清算参加者が先物・オプション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。

11～19 (略)

(取引証拠金所要額の申告)

第12条 非清算参加者は、取引日ごとに(有価証券オプション取引にあつては、毎日)、その指定清算参加者に対し、非清算参加者自己分の取引証拠金所要額及び非清算参加者委託分の取引証拠金所要額の合計額を、当該指定清算参加者が指定する時限までに当該指定清算参加者に申告するものとする。

(建玉の移管の成立)

第17条 (略)

2 先物取引に係る建玉の移管は、本所が定める約定値段又は約定数値をもって行われるものとする。

(支払不能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20条 (略)

2 (略)

3 先物取引に係る第1項の売買停止等時の建玉の移管は、当該売買停止等時の建玉の移管を行う日の前日に終了する取引日における各限月取引の清算値段又は清算数値(当該売買停止等時の建玉の移管を行う日に終了する取引日に係る夜間立会において成立した取引にあつては、その約定値段又は約定数値)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。

(受入証拠金の総額等の計算方法)

第33条 (略)

2 顧客の現金授受予定額は、一の日における次項に規定する計算上の損益額に、顧客の委託に基づく先物取引の決済損益額(国債証券先物取引については、受託契約準則第14条の2第1項又は第2項に規定する国債証券先物取引の決済のために授受する金銭の額をいうものとする。)のうち当該顧客との

加者のうち、指数先物等非清算参加者が先物・オプション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。

11～19 (略)

(取引証拠金所要額の申告)

第12条 非清算参加者は、取引日ごとに(個別証券オプション取引にあつては、毎日)、その指定清算参加者に対し、非清算参加者自己分の取引証拠金所要額及び非清算参加者委託分の取引証拠金所要額の合計額を、当該指定清算参加者が指定する時限までに当該指定清算参加者に申告するものとする。

(建玉の移管の成立)

第17条 (略)

2 先物取引に係る建玉の移管は、本所が定める約定数値をもって行われるものとする。

(支払不能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20条 (略)

2 (略)

3 先物取引に係る第1項の売買停止等時の建玉の移管は、当該売買停止等時の建玉の移管を行う日の前日に終了する取引日における各限月取引の清算数値(当該売買停止等時の建玉の移管を行う日に終了する取引日に係る夜間立会において成立した取引にあつては、その約定数値)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。

(受入証拠金の総額等の計算方法)

第33条 (略)

2 顧客の現金授受予定額は、一の日における次項に規定する計算上の損益額に、顧客の委託に基づく先物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及びオプション取引の取引代金(指数オプション取引については、受託契約準則第23条に規定する決済のために授受する金銭

間で授受を終了していないもの及びオプション取引の取引代金（指数オプション取引については、受託契約準則第27条に規定する決済のために授受する金銭の額をいうものとする。）のうち当該顧客との間で授受を終了していないものの合計額を加減した額から当該顧客の負担すべき額で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。

- 3 計算上の損益額は、顧客の委託に基づく国債証券先物取引の相場の変動に基づく利益に相当する額（当該顧客の委託に基づく未決済約定（取引最終日における取引が終了した限月取引に係る未決済約定を除く。以下同じ。）について、当該未決済約定に係る約定値段（Mini取引にあっては、約定数値。以下同じ。）と計算する日の清算値段（Mini取引にあっては、清算数値。以下同じ。）との差益に1億円の100分の1（Mini取引にあっては10万円）を乗じて得た額をいう。）と顧客の委託に基づく指数先物取引の相場の変動に基づく利益に相当する額（当該顧客の未決済約定について、当該未決済約定に係る約定数値と計算する日に終了する取引日の清算数値との差益に東証株価指数に係るLarge取引、RNP指数、東証銀行業株価指数、日経平均V I、TOPIX配当指数及びTOPIX Core30配当指数に係るものにあっては1万円、日経平均に係るLarge取引、東証株価指数に係るMini取引、TOPIX Core30、東証REIT指数及び日経平均・配当指数に係るものにあっては1,000円、日経平均に係るMini取引、NYダウ及びCNX Niftyに係るものにあっては100円を乗じて得た額をいう。）の合計額から、当該顧客の委託に基づく国債証券先物取引の相場の変動に基づく損失に相当する額（当該顧客の委託に基づく未決済約定について、当該未決済約定に係る約定値段と計算する日の清算値段との差損に1億円の100分の1（Mini取引にあっては10万円）を乗じて得た額をいう。）と当該顧客の委託に基づく指数先物取引の相場の変動に基づく損失に相当する額（当該顧客の未決済約定について、当該未決済約定に係る約定数値と計算する日に終了する取引日の清算数値との差損に東証株価指数に係るLarge取引、RNP指数、東証

の額をいうものとする。）のうち当該顧客との間で授受を終了していないものの合計額を加減した額から当該顧客の負担すべき額で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。

- 3 計算上の損益額は、顧客の委託に基づく先物取引の相場の変動に基づく利益に相当する額（当該顧客の未決済約定（取引最終日における取引が終了した限月取引に係る未決済約定を除く。以下同じ。）について、当該未決済約定に係る約定数値と計算する日に終了する取引日の清算数値との差益に日経300、MSCI JAPAN、RNP指数及び日経平均V Iに係るものにあっては1万円、Large取引及び業種別指数に係るものにあっては1,000円、Mini取引及びNYダウに係るものにあっては100円を乗じて得た額をいう。）の合計額から、当該顧客の委託に基づく先物取引の相場の変動に基づく損失に相当する額（当該顧客の未決済約定について、当該未決済約定に係る約定数値と計算する日に終了する取引日の清算数値との差損に日経300、MSCI JAPAN、RNP指数及び日経平均V Iに係るものにあっては1万円、Large取引及び業種別指数に係るものにあっては1,000円、Mini取引及びNYダウに係るものにあっては100円を乗じて得た額をいう。）の合計額及び第36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。

銀行業株価指数、日経平均V I、TOPIX配当指数及びTOPIX Core30配当指数に係るものにあつては1万円、日経平均に係るLarge取引、東証株価指数に係るMini取引、TOPIX Core30、東証REIT指数及び日経平均・配当指数に係るものにあつては1,000円、日経平均に係るMini取引、NYダウ及びCNX Niftyに係るものにあつては100円を乗じて得た額をいう。)の合計額及び第36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。

(証拠金の引出しの制限)

第35条 (略)

2 前項の規定にかかわらず、取引参加者は、次の各号のいずれかに該当する場合は、当該各号に定める金銭又は有価証券を引き出させることができる。

(1) 顧客が有価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買に係る決済を当該顧客から証拠金として差し入れられ又は預託されている金銭の交付により行おうとする場合であつて、当該顧客の受入証拠金の総額(当該交付に係る金銭の額を除く。)が証拠金所要額(当該権利行使に係る額を除く。)を上回り、かつ、当該交付に係る金銭を引き出してもなお現金超過額があるとき

当該交付に係る金銭

(2) 顧客が有価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買に係る決済を当該顧客から証拠金として差し入れられ又は預託されている当該オプション対象証券の交付により行おうとする場合であつて、当該顧客の受入証拠金の総額(当該交付に係る対象有価証券に相当する額を除く。)が証拠金所要額(当該権利行使に係る額を除く。)を上回っているとき

当該交付に係るオプション対象証券

(計算上の利益額の払出し)

第36条 (略)

2 前項の払出しは、当該顧客の受入証拠金の総額

(証拠金の引出しの制限)

第35条 (略)

2 前項の規定にかかわらず、取引参加者は、次の各号のいずれかに該当する場合は、当該各号に定める金銭又は有価証券を引き出させることができる。

(1) 顧客が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買に係る決済を当該顧客から証拠金として差し入れられ又は預託されている金銭の交付により行おうとする場合であつて、当該顧客の受入証拠金の総額(当該交付に係る金銭の額を除く。)が証拠金所要額(当該権利行使に係る額を除く。)を上回り、かつ、当該交付に係る金銭を引き出してもなお現金超過額があるとき

当該交付に係る金銭

(2) 顧客が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買に係る決済を当該顧客から証拠金として差し入れられ又は預託されている当該オプション対象証券の交付により行おうとする場合であつて、当該顧客の受入証拠金の総額(当該交付に係る対象有価証券に相当する額を除く。)が証拠金所要額(当該権利行使に係る額を除く。)を上回っているとき

当該交付に係るオプション対象証券

(計算上の利益額の払出し)

第36条 (略)

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。ただし、次の各号に掲げる場合は、この限りでない。

(1) (略)

(2) 顧客が有価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買に係る決済を当該払い出した金銭の交付により行おうとする場合であって、当該顧客の受入証拠金の総額（当該交付に係る金銭を除く。）が証拠金所要額（当該権利行使に係る額を除く。）を上回っているとき

付 則

- 1 この改正規定は、平成26年3月24日から施行する。
- 2 前項の規定にかかわらず、この改正規定は、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、平成26年3月24日に施行することが適当でないと本所が認める場合には、当該日以後の本所が定める日から施行する。

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。ただし、次の各号に掲げる場合は、この限りでない。

(1) (略)

(2) 顧客が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買に係る決済を当該払い出した金銭の交付により行おうとする場合であって、当該顧客の受入証拠金の総額（当該交付に係る金銭を除く。）が証拠金所要額（当該権利行使に係る額を除く。）を上回っているとき

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の一部改正新・旧対照表

新	旧
(定 義) 第2条 この規則において「F X取引参加者」とは、取引参加者規程第2条第4項に規定する外国為替証拠金取引参加者をいう。 2～6 (略) 7 この規則において「F X非清算参加者」とは、取引参加者規程第24条第4項に規定するF X非清算参加者をいう。 8～17 (略) 付 則 1 この改正規定は、平成26年3月24日から施行する。 2 前項の規定にかかわらず、この改正規定は、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、平成26年3月24日に施行することが適当でないと本所が認める場合には、当該日以後の本所が定める日から施行する。	(定 義) 第2条 この規則において「F X取引参加者」とは、取引参加者規程第2条第3項に規定する外国為替証拠金取引参加者をいう。 2～6 (略) 7 この規則において「F X非清算参加者」とは、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。 8～17 (略)

定款等の読点を変更する規則

第1条 次の各号に掲げる規則中の読点を「，」から「、」に変更する。

- (1) 定款
- (2) 業務規程
- (3) 取引参加者規程
- (4) 清算・決済規程
- (5) 受託契約準則
- (6) 先物・オプション取引口座設定約諾書
- (7) 信用取引口座設定約諾書
- (8) J-NET 市場に関する業務規程及び受託契約準則の特例
- (9) 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
- (10) 取引所 FX 取引口座設定約諾書
- (11) 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
- (12) 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

付 則

- 1 この規則は、平成26年3月24日から施行する。
- 2 前項の規定にかかわらず、この規則は、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、平成26年3月24日に施行することが適当でないと本所が認める場合には、当該日以後の本所が定める日から施行する。