先物・オプション取引に係る取引証拠金等に関する規則

第1章　総則

（目的）

第1条　この規則は、業務方法書第73条の43第1項の規定に基づき、先物・オプション取引に係る取引証拠金及び支払不能等による債務引受停止の場合における未決済約定の取扱い等について、必要な事項を定める。

（定義）

第2条　この規則において「先物取引」とは、国債証券先物取引、金利先物取引、指数先物取引又は商品先物取引をいう。

2　この規則において「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、指数オプション取引又は商品先物オプション取引をいう。

3　この規則において「指定市場開設者」とは、業務方法書第3条第2項第2号から第6号の3までの指定金融商品市場を開設する指定市場開設者をいう。

4　この規則において「取引参加者」とは、指定市場開設者が開設する金融商品市場において先物取引又はオプション取引に係る取引資格を有する者をいう。

5　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、国債証券先物取引における受渡決済、商品先物取引における受渡決済及び有価証券オプション取引における権利行使による決済に係る有価証券、倉荷証券（受渡決済のために授受する倉荷証券以外の書類を含む。）又は商品（金融商品取引法（昭和23年法律第25号。以下同じ。）第2条第24項第3号の3に規定する商品をいう。以下同じ。）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。

6　この規則において「取次者」とは、取引参加者に先物・オプション取引の委託をした顧客が、金融商品取引業者又は登録金融機関である場合であって、当該委託が取引参加者に対する先物・オプション取引の委託の取次ぎによるものであるときの当該顧客をいう。

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

8　この規則において「清算参加者」とは、業務方法書第5条第1項に規定する清算参加者のうち国債先物等清算資格、指数先物等清算資格、貴金属先物等清算資格、ゴム先物等清算資格、農産物先物等清算資格又は原油先物等清算資格を有する者をいう。

9　この規則において「非清算参加者」とは、業務方法書第73条の2第2項に規定する指数先物等非清算参加者、同第73条の6第2項に規定する国債先物等非清算参加者、同第73条の20第2項に規定する指数先物等非清算参加者及び原油先物等非清算参加者、

同第73条の26第2項に規定する指数先物等非清算参加者並びに同第73条の31の2第2項に規定する商品先物等非清算参加者をいう。

10　この規則において「指定清算参加者」とは、業務方法書第6条第1項に規定する指定清算参加者のうち非清算参加者が先物取引及び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　この規則において「支払不能等による債務引受停止」とは、業務方法書第29条第1項の規定に基づく債務の引受けの停止(同第29条の3の規定に基づくポジション保有状況の改善指示に違反したことによるものに限る。)又は同第76条第5項の規定に基づく債務の引受けの停止の措置をいう。

12　この規則において「支払不能等による売買停止等」とは、指定市場開設者による有価証券の売買等(有価証券等清算取次ぎによるものを除く。)若しくは有価証券等清算取次ぎの委託の停止の処置(指定市場開設者が取引参加者を支払不能又は支払不能となるおそれがあると認めたことによるものに限る。)又は業務方法書第29条第1項の規定に基づく債務の引受けの停止(同第29条の3の規定に基づくポジション保有状況の改善指示に違反したことによるものに限る。)若しくは同第76条第5項の規定に基づく債務の引受けの停止が行われた場合の指定市場開設者による有価証券の売買等(有価証券等清算取次ぎによるものを除く。)若しくは有価証券等清算取次ぎの委託の停止の措置をいう。

13　この規則において「取引日」とは、先物・オプション取引について、指定市場開設者が定める取引日をいう。

14　この規則において「外国国債証券」とは、金融商品取引法第2条第1項第17号に掲げる有価証券のうち同項第1号に掲げる有価証券の性質を有するものをいう。

第2章　取引証拠金

第1節　通則

(取引証拠金の目的)

第3条　取引証拠金は、この規則で定めるところにより、清算参加者が当社に対して支払い若しくは引き渡すべき先物・オプション取引に係る債務、非清算参加者が清算参加者に対して支払い若しくは引き渡すべき先物・オプション取引に係る債務又は顧客が取引参加者に対して負担する先物・オプション取引に係る債務(顧客が取次者である場合は、申込者が顧客に対して負担する先物・オプション取引に係る債務を含む。)の履行を確保するためのものとする。

2　当社、清算参加者、非清算参加者又は取次者である顧客は、前項に規定する債務につき不履行が発生した場合には、取引証拠金に対する権利を行使し、当該債務の弁済に充当することができる。

(取引参加者の自己分の取引証拠金所要額)

第4条　自己分の取引証拠金所要額は、先物・オプション取引に係る清算資格の種類ごとに自己分の想定損失相当額から自己分のネット・オプション価値の総額を差し引いて

得た額の合計額に自己分の取引受渡証拠金を加えて得た額(第6条の2第1項及び第6条の3第1項の規定に基づき自己分の取引証拠金所要額の引上げが行われた場合においては、当該引上げ額を加算する。)とする。この場合において、これらの用語の意義は、次の各号に定めるところによる。

(1)　自己分の想定損失相当額

先物・オプション取引に係る取引参加者の自己の計算による建玉（その取引日にクロスマージンの申請の対象となった建玉を除く。）について想定される損失相当額として、当社が定める方法により計算した額をいう。

(2)　自己分のネット・オプション価値の総額

次のaに掲げる自己分の買オプション価値の総額からbに掲げる自己分の売オプション価値の総額を差し引いて得た額をいう。

a　自己分の買オプション価値の総額は、取引参加者の自己の計算による買建玉が売建玉を上回るオプション取引の銘柄のそれぞれについて、次の(a)から(d)までに定めるところにより算出した額の合計額とする。

(a)　有価証券オプション取引については、取引参加者の自己の計算による買超数量(買建玉が売建玉を上回るときの買建玉と売建玉の差引数量をいう。以下同じ。)にその日(指定市場開設者が定めるフレックス限月取引にあっては、その取引日)の当該銘柄の清算価格(第7条に規定する清算価格をいう。以下この条において同じ。)を乗じて得た額に、当該銘柄の対象有価証券の売買単位(指定市場開設者が対象有価証券の売買について権利落の期日を定めた場合において、当該権利落の期日以降の日における有価証券オプション取引の対象となる有価証券オプションに係る銘柄であるときは、対象有価証券の売買単位に指定市場開設者の定める数値を乗じて算出した数量。以下同じ。)を乗じて算出した額

(b)　国債証券先物オプション取引については、取引参加者の自己の計算による買超数量にその取引日の当該銘柄の清算価格を乗じて得た額に、国債証券先物オプション1単位の権利行使により成立する国債証券先物取引の額面金額の100分の1を乗じて算出した額

(c)　指数オプション取引については、取引参加者の自己の計算による買超数量にその取引日の当該銘柄の清算価格を乗じて得た額に、当該銘柄に係る取引基準額(指数オプション取引において、権利行使に伴い授受する金銭の額を算出するため権利行使価格と現実の指数との差に乗ずべき額として指定市場開設者の定める取引基準額又は取引換算額をいう。以下同じ。)を乗じて算出した額

(d)　商品先物オプション取引については、取引参加者の自己の計算による買超数量にその取引日の当該銘柄の清算価格を乗じて得た額に、当該銘柄の売買単位を乗じて算出した額

b　自己分の売オプション価値の総額は、取引参加者の自己の計算による売建玉が買建玉を上回るオプション取引の銘柄のそれぞれについて、次の(a)から(d)までに定めるところにより算出した額の合計額とする。

(a)　有価証券オプション取引については、取引参加者の自己の計算による売超数量(売建玉が買建玉を上回るときの売建玉と買建玉の差引数量をいう。以下同じ。)にその日(指定市場開設者が定めるフレックス限月取引にあっては、その取引日)の当該銘柄の清算価格を乗じて得た額に、当該銘柄の対象有価証券の売買単位を乗じて算出した額

(b)　国債証券先物オプション取引については、取引参加者の自己の計算による売超数量にその取引日の当該銘柄の清算価格を乗じて得た額に、国債証券先物オプション1単位の権利行使により成立する国債証券先物取引の額面金額の100分の1を乗じて算出した額

(c)　指数オプション取引については、取引参加者の自己の計算による売超数量にその取引日の当該銘柄の清算価格を乗じて得た額に、当該銘柄に係る取引基準額を乗じて算出した額

(d)　商品先物オプション取引については、取引参加者の自己の計算による売超数量にその取引日の当該銘柄の清算価格を乗じて得た額に、当該銘柄の売買単位を乗じて算出した額

(3)　自己分の取引受渡証拠金

受渡しにより決済を行う場合に必要となる証拠金額として、別表3「取引受渡証拠金所要額の算出に関する表」により算出される額をいう。

(顧客の証拠金所要額)

第5条　前条の規定は、次項に定める場合を除き、顧客(顧客が取次者である場合は、申込者をいう。以下同じ。)の証拠金所要額（第9条の2第4項の規定により顧客が事前割増額の預託を行う場合においては、当該事前割増額のうち当該顧客に係る額を加算する。以下同じ。）について準用する。この場合において、「自己分の取引証拠金所要額」とあるのは「顧客の証拠金所要額」と、「自己分の想定損失相当額」とあるのは「顧客の想定損失相当額」と、「自己分のネット・オプション価値の総額」とあるのは「顧客のネット・オプション価値の総額」と、「第6条の2第1項及び第6条の3第1項」とあるのは「第6条の2第2項」と、「取引参加者の自己の計算による」とあるのは「当該顧客の委託に基づく」と、「自己分の買オプション価値の総額」とあるのは「顧客の買オプション価値の総額」と、「自己分の売オプション価値の総額」とあるのは「顧客の売オプション価値の総額」と、「自己分の取引受渡証拠金」とあるのは「顧客の取引受渡証拠金」と読み替えるものとする。

2　前条の規定は、顧客を任意に細分化した場合における当該細分化した単位(以下「任意に細分化した単位」という。)の証拠金所要額について準用する。この場合において、

「自己分の取引証拠金所要額」とあるのは「任意に細分化した単位の証拠金所要額」と、「自己分の想定損失相当額」とあるのは「任意に細分化した単位の想定損失相当額」と、「自己分のネット・オプション価値の総額」とあるのは「任意に細分化した単位のネット・オプション価値の総額」と、「第6条の2第1項及び第6条の3」とあるのは「第6条の2第3項」と、「取引参加者の自己の計算による」とあるのは「顧客の委託に基づく当該任意に細分化した単位の」と、「自己分の買オプション価値の総額」とあるのは「任意に細分化した単位の買オプション価値の総額」と、「自己分の売オプション価値の総額」とあるのは「任意に細分化した単位の売オプション価値の総額」と、「自己分の取引受渡証拠金」とあるのは「任意に細分化した単位の取引受渡証拠金」と読み替えるものとする。

(区分口座の取引証拠金所要額)

第5条の2　当社は、業務方法書第46条の3及び第46条の4に規定する区分口座の取引証拠金所要額について、次の各号に掲げる区分口座ごとに、当該各号に定める方法によって算出する。

(1)　業務方法書第46条の3第1号及び第46条の4第1号に規定する区分口座

第4条に基づき計算した取引証拠金所要額

(2)　業務方法書第46条の3第2号a、第3号a及び第46条の4第2号aに規定する区分口座

第25条の規定に基づき申告された顧客の情報について前条第1項の規定に基づき計算した証拠金所要額及び第25条の規定に基づき申告された任意に細分化した単位の情報について前条第2項の規定に基づき計算した証拠金所要額を当該区分口座ごとに合計した額

(3)　業務方法書第46条の3及び第46条の4に規定する区分口座のうち前2号に掲げる区分口座を除く区分口座

当該区分口座における顧客について前条第1項の規定に基づき計算した証拠金所要額又は当該区分口座における任意に細分化した単位について同条第2項の規定に基づき計算した証拠金所要額

2　前項第2号の規定にかかわらず、業務方法書第46条の3第2号a、同条第3号a及び第46条の4第2号aに規定する区分口座の取引証拠金所要額は、清算参加者が第25条に規定する申告を行わなかった場合又は当該申告を行うことが不可能若しくは困難であると当社が認める場合は、当社が定めるところによる。

第6条　削除

(リスク量に応じた取引証拠金所要額の引上げ)

第6条の2　当社は、先物・オプション取引に係る一の取引参加者の自己の計算による建玉が負っているものと想定されるリスク量として当社が定める数量が当社が定める判

定基準数量を上回った場合には、当社が定めるところにより、当該取引参加者の自己分の取引証拠金所要額に対する引上げを行うことができる。

2　前項の規定は、顧客の証拠金所要額について準用する。この場合において、「自己の計算による」とあるのは「顧客の委託に基づく」と、「自己分の取引証拠金所要額」とあるのは「顧客の証拠金所要額」と読み替えるものとする。

3　前項の規定にかかわらず、第１項の規定は、任意に細分化した単位の証拠金所要額について準用する。この場合において、「自己の計算による」とあるのは「顧客の委託に基づく任意に細分化した単位の」と、「自己分の取引証拠金所要額」とあるのは「任意に細分化した単位の証拠金所要額」と読み替えるものとする。

4　前３項に規定するリスク量は、取引日ごとに算出を行い、当該リスク量の算出結果に基づき、当社は、取引証拠金所要額の引上げの判定を行う。

(破綻処理単位期間における破綻時証拠金による取引証拠金所要額の引上げ)

第６条の３　当社は、業務方法書第 76 条の２第１項に定める破綻処理単位期間において、一の清算参加者が負っているものと想定される破綻時証拠金(当社が規則で定める額をいう。以下同じ。)が当社が定める所要額引上げ基準に該当した場合には、当該清算参加者の自己分の取引証拠金所要額の引上げを行うことができる。

2　前項に規定する取引証拠金所要額の引上げの判定は、取引日ごとに算出を行い、当該算出結果に基づき行う。

3　当社は、第１項に規定する清算参加者の自己分の取引証拠金所要額の引上げを行った場合において、当該清算参加者が当社に預託している自己分の取引証拠金の額が、当該引上げ後の当該清算参加者の自己分の取引証拠金所要額に満たないときは、当該清算参加者に対して、その旨を速やかに通知する。

4　前項の通知を受けた清算参加者は、不足額以上の額を、自己分の取引証拠金として、当該通知を受領した日の午後２時までに当社に預託しなければならない。この場合において、当該取引証拠金は、有価証券及び倉荷証券(以下「有価証券等」という。)をもって代用預託することができる。

(オプション取引に係る清算価格)

第７条　当社は、オプション取引の各銘柄について、指定市場開設者が定める当該各銘柄の取引開始日から権利行使日(国債証券先物オプション取引にあっては、権利行使期間満了の日)の前日までの間、取引日ごとに(有価証券オプション取引(指定市場開設者が定めるフレックス限月取引を除く。)にあっては、毎日)、当社の定めるところにより、清算価格を定める。

(通貨の種類)

第７条の２　取引証拠金、委託証拠金及び取次証拠金は、当社が指定する通貨に限り預託することができる。

(代用有価証券等)

第８条　取引証拠金、委託証拠金及び取次証拠金として代用預託することができる有価証券等(以下「代用有価証券等」という。)に関する事項は、別表１に定める。

2　前項の規定にかかわらず、清算参加者が、当該有価証券等の預託に際し、当社が指定する外国振替機関(外国の法令に準拠して外国において振替業又は債券の保管及び振替に関する業務を行う者をいう。)を利用する場合には、当該清算参加者、当社及び当該外国振替機関の間の契約により定められた額とする。

3　前２項の規定のほか、取引証拠金、委託証拠金及び取次証拠金の代用有価証券等に関する事項については、当社が定める。

第２節　清算参加者の取引証拠金

(自己分の取引証拠金の預託)

第９条　清算参加者は、自己の計算による先物取引の売付け若しくは買付けが成立した場合、オプション取引の売付けが成立した場合又は商品先物取引について受渡しにより決済を行う場合は、第４条に規定する取引参加者の自己分の取引証拠金所要額（業務方法書第19条第５項に規定する届出を行った清算参加者にあっては当該取引証拠金所要額に次条に規定する取引証拠金の事前割増額を加えた額）以上の額の取引証拠金を、当社が定めるところにより、当社に預託しなければならない。この場合において、当該取引証拠金は、有価証券等をもって代用預託することができる。

(取引証拠金の事前割増額)

第９条の２　取引証拠金の事前割増額は、指定市場開設者が休業日において立会を行う日として定める日（以下「祝日取引実施日」という。）から起算して３日前（祝日取引実施日でない休業日を除く。ただし、祝日取引実施日が連続する休業日に設定される場合（当該連続する休業日の間に取引を行わない休業日がある場合を含む。以下「連続する祝日取引実施日」という。）には、当該連続する祝日取引実施日の初日から起算するものとする。）における清算参加者の区分口座で管理される建玉のうち、指定市場開設者が休業日において立会を行う先物・オプション取引に係る建玉について想定される損失相当額として、当社が定める方法により計算した額に当社が定める割合を乗じて得た額を、当該清算参加者のすべての区分口座について合計した額をいう。

2　前項の規定にかかわらず、業務方法書第19条第５項に定める届出を行った清算参加者が同第46条の３第２号、第３号又は第46条の４第２号に規定する一の区分口座で管理する建玉に係る顧客について、当社が定めるところにより当該顧客が祝日取引実施日における取引を行わないことを理由に当該顧客を管理する区分口座を取引証拠金の事前割額の計算の適用外とすることを希望する旨の申請を行った場合において、当社が当該申請を承認したときは、当社は当該区分口座を前項の事前割増額の算出から除外することができる。

3　第1項の規定にかかわらず、清算参加者は、事前割増額の起因となった一の顧客との間で、事前割増額のうち当該顧客に起因する額として当社が定める額に限り、当該顧客の金銭をもって預託することを合意することができる。

4　清算参加者は、前項の規定により、顧客との間で合意した場合において、当社が定めるところによりその旨の申請を行い、当社が当該申請を承認した場合には、当該顧客に係る区分口座に係る事前割増額について、当該顧客の取引証拠金として、当社が定めるところにより、当社に預託することができる。この場合において、当該取引証拠金は、有価証券等をもって代用預託することができる。

(委託分及び有価証券等清算取次ぎ分の取引証拠金の預託)

第10条　清算参加者は、顧客の委託又は非清算参加者の有価証券等清算取次ぎの委託に基づく先物取引の売付け若しくは買付けが成立した場合、オプション取引の売付けが成立した場合又は商品先物取引について受渡しにより決済を行う場合は、第24条の2第2項に規定する委託分及び有価証券等清算取次ぎ分の取引証拠金所要額以上の額の取引証拠金を、当社に預託しなければならない。

2　清算参加者は、第6条の2の規定に基づき非清算参加者の自己分の取引証拠金所要額、顧客の証拠金所要額又は任意に細分化した単位の証拠金所要額の引上げが行われた場合において、引上げの起因となった顧客又は非清算参加者との間で当該清算参加者の自己の金銭をもって、預託することを合意することができる。

3　清算参加者は、前項の規定により、顧客又は非清算参加者との間で合意ができた場合には、当該証拠金所要額に対して引上げを行う額のうち当社が定める額に対して、当該清算参加者の自己の金銭をもって、当該清算参加者の自己分の取引証拠金として、当社が定めるところにより、当社に預託することができる。この場合において、当該取引証拠金は、有価証券等をもって代用預託することができる。

(委託分の取引証拠金の預託)

第11条　清算参加者は、顧客が差し入れた取引証拠金の全部を、当該顧客の代理人として、当社が定めるところにより、当社に預託しなければならない。

2　前項の規定にかかわらず、清算参加者は、顧客が取引証拠金を差し入れた日から起算して4日目(休業日を除外する。以下日数計算において同じ。)の日までの間においては、当該顧客が取引証拠金として差し入れた金銭の額(外国通貨にて金銭を差し入れた場合には、取引証拠金の預託を行う日の前々日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。以下同じ。)における東京外国為替市場の対顧客直物電信買相場の当該通貨1単位当たりの円貨額により円貨に換算して評価した額をいう。次項、第13条第2項及び第3項において同じ。)及び有価証券等の時価評価額(取引証拠金の預託を行う日の前々日における時価(別表1第2項に規定する時価をいう。以下同じ。)により評価した額(当該有価証券等が外国国債証券である場合には、その時価を取引証拠金の預託を行う日の前々日における東京外国為替市場の対顧客直物電信買相場の各外国国債証券の評価に

用いる通貨1単位当たりの円貨額により円貨に換算した額)をいう。次項、第13条第2項及び第3項において同じ。)の合計額に相当する額以上の自己の金銭をもって、取引証拠金として、当社が定めるところにより、当社に預託することができる。この場合において、当該取引証拠金は、有価証券等をもって代用預託することができる。

3　清算参加者は、顧客が委託証拠金を預託した場合においては、当該顧客が委託証拠金として預託した金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額に相当する額以上の自己の金銭をもって、取引証拠金として、当社が定めるところにより、当社に預託しなければならない。この場合において、当該取引証拠金は、有価証券等をもって代用預託することができる。

4　前3項の場合において、清算参加者は、各顧客が清算参加者に取引証拠金として差し入れた又は委託証拠金として預託した金銭の額(当該金銭が外国通貨である場合には、取引証拠金の預託を行う日の前々日における東京外国為替市場の対顧客直物電信買相場の当該通貨1単位当たりの円貨額により円貨に換算して評価した額に当社が定める率を乗じた額をいう。第13条第4項において同じ。)及び有価証券等を代用価格(取引証拠金の預託を行う日の前々日における時価に別表1第2項に定める率を乗じた額(当該有価証券等が外国国債証券である場合は、その時価に同項に定める率を乗じた額を取引証拠金の預託を行う日の前々日における東京外国為替市場の対顧客直物電信買相場の各外国国債証券の評価に用いる通貨1単位当たりの円貨額により円貨に換算した額)をいう。第13条第4項において同じ。)により評価した額の合計額が当該顧客の証拠金所要額(第5条の規定により読み替えて適用される第4条に規定する当該顧客の証拠金所要額をいう。以下同じ。)に満たないときは、当該証拠金所要額から当該顧客が差し入れた取引証拠金又は預託した委託証拠金を差し引いた額以上の自己の金銭をもって、取引証拠金として、当社が定めるところにより、当社に預託しなければならない。この場合において、当該取引証拠金は、有価証券等をもって代用預託することができる。

(取次者に係る取引証拠金の預託に関する特則)

第12条　前条第1項の規定にかかわらず、清算参加者は、顧客が清算参加者に差し入れた取引証拠金が申込者の代理人として差し入れたものである場合は、その全部を、当該申込者の代理人として当社に預託しなければならない。

(有価証券等清算取次ぎ分の取引証拠金の預託)

第13条　清算参加者は、非清算参加者が差し入れた取引証拠金の全部を、当該非清算参加者又は当該非清算参加者の顧客の代理人として、当社が定めるところにより、当社に預託しなければならない。

2　前項の規定にかかわらず、清算参加者は、非清算参加者が自己分の取引証拠金を差し入れた日の翌日(休業日に当たる場合は順次繰り下げる。以下同じ。)までの間においては、当該非清算参加者が取引証拠金として差し入れた金銭の額及び有価証券等の時価

評価額の合計額に相当する額以上の自己の金銭をもって、取引証拠金として、当社が定めるところにより、当社に預託することができる。この場合において、当該取引証拠金は、有価証券等をもって代用預託することができる。

3　清算参加者は、非清算参加者が非清算参加者証拠金(取引証拠金のうち指定市場開設者の定める非清算参加者証拠金であるものをいう。以下同じ。)を預託した場合においては、当該非清算参加者が非清算参加者証拠金として預託した金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額に相当する額以上の自己の金銭をもって、取引証拠金として、当社が定めるところにより、当社に預託するものとする。この場合において、当該取引証拠金は、有価証券等をもって代用預託することができる。

4　前3項の場合において、清算参加者は、各非清算参加者が清算参加者に取引証拠金として差し入れた又は非清算参加者証拠金として預託した金銭の額及び有価証券等を代用価格により評価した額の合計額が清算参加者が非清算参加者に対して当該非清算参加者に係る有価証券等清算取次ぎ分の取引証拠金所要額として通知した額に満たないときは、当該額から当該非清算参加者が差し入れた取引証拠金又は預託した非清算参加者証拠金を差し引いた額以上の自己の金銭をもって、取引証拠金として、当社が定めるところにより、当社に預託しなければならない。この場合において、当該取引証拠金は、有価証券等をもって代用預託することができる。

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

第14条　前条第1項の規定にかかわらず、清算参加者は、非清算参加者が清算参加者に差し入れた取引証拠金が申込者の代理人として差し入れたものである場合は、その全部を、当該申込者の代理人として当社に預託しなければならない。

(取引証拠金の預託時限)

第15条　第9条から前条までの規定による取引証拠金の預託は、先物取引の売付け若しくは買付け又はオプション取引の売付けが成立した取引日の終了する日(有価証券オプション取引(指定市場開設者が定めるフレックス限月取引を除く。)にあっては、売付けが成立した日)の翌日又は商品先物取引に係る受渡決済の対象となる建玉が確定した日の翌日の午前11時までに行うものとする。

(自己分の取引証拠金の維持)

第16条　清算参加者は、自己分の取引証拠金として当社に預託されている金銭の額(当該金銭が外国通貨である場合は、計算する日の前日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。以下同じ。)における東京外国為替市場の対顧客直物電信買相場の当該通貨1単位当たりの円貨額により円貨に換算して評価した額に当社が定める率を乗じた額をいう。次条、第18条第2項及び第19条第3項において同じ。)及び有価証券等を代用価格(計算する日の前日における時価に別表1第2項に定める率を乗じた額(当該有価証券等が外国国債証券である場合は、その時価に同項に定める率を乗じた額を計算する日

の前日における東京外国為替市場の対顧客直物電信買相場の各外国国債証券の評価に用いる通貨1単位当たりの円貨額により円貨に換算した額)をいう。次条、第18条第2項及び第19条第3項において同じ。)により評価した額の合計額が自己分の取引証拠金所要額に満たない場合は、その不足額以上の額を、自己分の取引証拠金として、不足額が生じた日の翌日の午前11時までに、当社が定めるところにより、当社に追加預託しなければならない。この場合において、当該取引証拠金は、有価証券等をもって代用預託することができる。

(委託分及び有価証券等清算取次ぎ分の取引証拠金の維持)

第17条　清算参加者は、委託分及び有価証券等清算取次ぎ分の取引証拠金として当社に預託している金銭の額及び有価証券等を代用価格により評価した額の合計額が第24条の2第2項に規定する区分口座ごとの委託分及び有価証券等清算取次ぎ分の取引証拠金所要額(第6条の2第2項又は第3項の規定に基づき委託分及び有価証券等清算取次ぎ分の取引証拠金所要額の引上げが行われた場合においては、当該引上げ額を加算する。)に満たない場合は、その不足額以上の額を、委託分及び有価証券等清算取次ぎ分の取引証拠金として、不足額が生じた日の翌日の午前11時までに、当社が定めるところにより、当社に追加預託しなければならない。この場合において、当該取引証拠金は、有価証券等をもって代用預託することができる。

(委託分の取引証拠金の維持)

第18条　清算参加者は、第11条第1項から第3項まで又は第12条の規定により顧客に係る取引証拠金として当社に預託している金銭の額(当該金銭が外国通貨である場合は、計算する日の前日における東京外国為替市場の対顧客直物電信買相場の当該通貨1単位当たりの円貨額により円貨に換算して評価した額をいう。以下この項、次条第1項において準用する第13条第2項及び第3項、次条第2項、第24条及び第30条において同じ。)及び有価証券等の時価評価額(計算する日の前日における時価により評価した額(当該有価証券等が外国国債証券である場合は、その時価を計算する日の前日における東京外国為替市場の対顧客直物電信買相場の各外国国債証券の評価に用いる通貨1単位当たりの円貨額により円貨に換算した額)をいう。以下この項、次条第1項において準用する第13条第2項及び第3項、次条第2項及び第24条において同じ。)の合計額が、当該顧客が取引証拠金として差し入れた又は委託証拠金として預託した金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額に満たない場合には、その不足額以上の額を、委託分の取引証拠金として、不足額が生じた日の翌日の午前11時までに、第11条第1項から第3項まで又は第12条に準じて当社に追加預託しなければならない。

2　清算参加者は、各顧客が取引証拠金として差し入れ又は委託証拠金として預託した金銭の額及び有価証券等を代用価格により評価した額の合計額が当該顧客の証拠金所要額に満たないときは、その不足額以上の額を、委託分の取引証拠金として、不足額が

生じた日の翌日の午前11時までに、第11条第4項に準じて当社に追加預託しなければならない。

(有価証券等清算取次ぎ分の取引証拠金の維持)

第19条　清算参加者は、指定市場開設者の定めるところにより非清算参加者が当該清算参加者に差し入れるべき取引証拠金に不足額が生じた場合において、当該非清算参加者が当該不足額以上の額の取引証拠金を追加差入れしたときは、当該取引証拠金の全部を、不足額が生じた日の翌日の午前11時までに、第13条第1項から第3項まで又は第14条に準じて当社に追加預託しなければならない。

2　清算参加者は、第13条第2項(前項において準用する場合を含む。)及び同条第3項(前項において準用する場合を含む。)の規定により非清算参加者に係る取引証拠金として当社に預託している金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額が、当該非清算参加者が自己分の取引証拠金として差し入れた又は非清算参加者証拠金として預託した金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額に満たない場合には、その不足額以上の額を、非清算参加者の自己分又は非清算参加者の委託分の取引証拠金として、不足額が生じた日の翌日の午前11時までに、前項において準用する第13条第2項又は第3項に準じて当社に追加預託しなければならない。

3　清算参加者は、各非清算参加者が取引証拠金として差し入れた又は非清算参加者証拠金として預託した金銭の額及び有価証券等を代用価格により評価した額の合計額が清算参加者が非清算参加者に対して当該非清算参加者に係る有価証券等等清算取次ぎ分の取引証拠金所要額として通知した額に満たないときは、その不足額以上の額を、取引証拠金として、不足額が生じた日の翌日の午前11時までに、第13条第4項に準じて当社に追加預託しなければならない。

(取引証拠金の区分及び管理方法)

第20条　第9条から第14条まで及び第16条から前条までの取引証拠金の預託は、次の各号に掲げる取引証拠金に区分して行うものとする。

(1)　清算参加者が自己の計算による先物・オプション取引につき当社に預託する取引証拠金(以下「清算参加者自己分の取引証拠金」という。)(次号に定める取引証拠金を除く。)

(2)　清算参加者自己分の取引証拠金のうち、第10条第3項の規定により、顧客の委託又は非清算参加者の有価証券等清算取次ぎの委託に基づく先物・オプション取引につき当社に預託する取引証拠金

(3)　清算参加者が顧客の委託に基づく先物・オプション取引につき当社に預託する取引証拠金(以下「清算参加者委託分の取引証拠金」という。)のうち、顧客から当該清算参加者に取引証拠金として差し入れられたもの(次号に定める取引証拠金を除く。以下「清算参加者委託分の取引証拠金(直接預託分)」という。)

(4)　清算参加者委託分の取引証拠金のうち、申込者が顧客に取次証拠金を預託した場合において、当該顧客から清算参加者に当該取次証拠金に相当する取引証拠金として差し入れられたもの(以下「清算参加者委託分の取引証拠金(取次者差換預託分)」という。)

(5)　清算参加者委託分の取引証拠金のうち、前2号に定めるもの以外のもの(以下「清算参加者委託分の取引証拠金(差換預託分)」という。)

(6)　指定清算参加者が、非清算参加者の自己の計算による先物・オプション取引につき当社に預託する取引証拠金(以下「非清算参加者自己分の取引証拠金」という。)のうち、当該非清算参加者から当該指定清算参加者に取引証拠金として差し入れられたもの(以下「非清算参加者自己分の取引証拠金(直接預託分)」という。)

(7)　非清算参加者自己分の取引証拠金のうち、前号に定めるもの以外のもの(以下「非清算参加者自己分の取引証拠金(差換預託分)」という。)

(8)　指定清算参加者が、非清算参加者の顧客の委託に基づく先物・オプション取引につき当社に預託する取引証拠金(以下「非清算参加者委託分の取引証拠金」という。)のうち、当該顧客から当該非清算参加者に取引証拠金として差し入れられたもの(次号に定める取引証拠金を除く。以下「非清算参加者委託分の取引証拠金(直接預託分)」という。)

(9)　非清算参加者委託分の取引証拠金のうち、申込者が顧客に取次証拠金を預託した場合において、当該顧客から非清算参加者に当該取次証拠金に相当する取引証拠金として差し入れられたもの(以下「非清算参加者委託分の取引証拠金(取次者差換預託分)」という。)

(10)　非清算参加者委託分の取引証拠金のうち前2号に定めるもの以外のもの(以下「非清算参加者委託分の取引証拠金(差換預託分)」という。)

2　当社は、第9条から第14条まで及び第16条から前条までの規定により当社に預託される取引証拠金について、前項各号に規定する区分により管理を行うものとする。

(日中取引証拠金の預託)

第20条の2　清算参加者は、自己分の取引証拠金として当社に預託している金銭の額(当該金銭が外国通貨である場合には、取引証拠金の預託を行う日の前々日における東京外国為替市場の対顧客直物電信買相場の当該通貨1単位当たりの円貨額により円貨に換算して評価した額に当社が定める率を乗じた額をいう。第21条において同じ。)及び有価証券等を代用価格(取引証拠金の預託を行う日の前々日における時価に別表1第2項に定める率を乗じた額により評価した額(当該有価証券等が外国国債証券である場合は、その時価に同項に定める率を乗じた額を計算する日の前日における東京外国為替市場の対顧客直物電信買相場の各外国国債証券の評価に用いる通貨1単位当たりの円貨額により円貨に換算した額)をいう。第21条において同じ。)により評価した額の合計額が次条に規定する日中取引証拠金所要額に満たないときは、その不足額以上の額

を、自己分の取引証拠金として、その日の午後2時までに当社に追加預託しなければならない。この場合において、当該取引証拠金は、有価証券等をもって代用預託することができる。

2　当社は、前項の規定により取引証拠金の預託を行わせる場合には、その旨を速やかに清算参加者に通知する。

3　第1項の規定にかかわらず、日中取引証拠金所要額から当該所要額を算出する時点で適用した自己分の取引証拠金所要額を控除した額が1,000万円以下となる清算参加者については、自己分の取引証拠金の追加預託の義務を負わないものとする。

4　前条第2項の規定は、第1項の取引証拠金について準用する。

（日中取引証拠金所要額）

第20条の3　日中取引証拠金所要額は、日中リスク再計算額に日中先物取引差金相当額及び日中オプション取引代金相当額を、当該額が支払いとなる場合は加え、受領となる場合は減じて得た額に、業務方法書第46条の3及び第46条の4に規定する区分口座（第46条の3第1項第1号に規定する区分口座を除く。以下この条、第22条、第23条の2、第23条の3及び第24条の2において同じ。）ごとの担保超過リスク額を合計した額及び第9条の2第1項に定める事前割増額を加えた額とする。この場合において、これらの用語の意義は、次の各号に定めるところによる。

(1)　日中リスク再計算額

第4条の規定中「先物・オプション取引に係る取引参加者の自己の計算による」とあるのは「国債証券先物取引、国債証券先物オプション取引及び金利先物取引についてはその取引日の終了する日の午前立会終了時点、有価証券オプション取引、指数先物取引及び指数オプション取引についてはその日（有価証券オプション取引（指定市場開設者が定めるフレックス限月取引に限る。）、指数先物取引又は指数オプション取引にあっては、その取引日）の午前11時時点、商品先物取引及び商品先物オプション取引についてはその取引日の午前11時時点における取引参加者の自己の計算による」と、「その取引日にクロスマージンの申請の対象となった建玉」とあるのは「その前取引日にクロスマージンの申請の対象となった建玉」と、「自己分の買オプション価値の総額は、取引参加者の自己の計算による」とあるのは「自己分の買オプション価値の総額は、国債証券先物オプション取引についてはその取引日の終了する日の午前立会終了時点、有価証券オプション取引及び指数オプション取引についてはその日（有価証券オプション取引（指定市場開設者が定めるフレックス限月取引に限る。）又は指数オプション取引にあっては、その取引日）の午前11時時点、商品先物オプション取引についてはその取引日の午前11時時点における取引参加者の自己の計算による」と、「有価証券オプション取引については、取引参加者の自己の計算による」とあるのは「有価証券オプション取引についてはその日（有価証券オプション取引（指定市場開設者が定めるフレックス限月取引に限る。）に

ついてはその取引日)の午前 11 時時点における取引参加者の自己の計算による」と、「清算価格」とあるのは「日中清算価格」と、「第7条に規定する清算価格をいう。」とあるのは「次条に規定する日中清算価格をいう。」と、「国債証券先物オプション取引については、取引参加者の自己の計算による」とあるのは「国債証券先物オプション取引についてはその取引日の終了する日の午前立会終了時点における取引参加者の自己の計算による」と、「指数オプション取引については、取引参加者の自己の計算による」とあるのは「指数オプション取引については、その取引日の午前11時時点における取引参加者の自己の計算による」と、「商品先物オプション取引については、取引参加者の自己の計算による」とあるのは「商品先物オプション取引については、その取引日の午前11時時点における取引参加者の自己の計算による」と、「自己分の売オプション価値の総額は、取引参加者の自己の計算による」とあるのは「自己分の売オプション価値の総額は、国債証券先物オプション取引についてはその取引日の終了する日の午前立会終了時点、有価証券オプション取引及び指数オプション取引についてはその日(有価証券オプション取引(指定市場開設者が定めるフレックス限月取引に限る。)又は指数オプション取引にあっては、その取引日)の午前11時時点、商品先物オプション取引についてはその取引日の午前11時時点における取引参加者の自己の計算による」と読み替えて同条の規定により計算した自己分の取引証拠金所要額に相当する額

(2) 日中先物取引差金相当額

先物取引について、次のａ及びｂに定める額を合計した額とする。

ａ 次の(ａ)から (d) までに定める額を合計した額

(a) 国債証券先物取引について、その取引日の夜間立会及び午前立会の終了までに行われた自己の計算による取引(当該取引日の午前立会の終了までに行われたJ－NET取引(指定市場開設者が定めるJ－NET取引をいう。以下同じ。)を含む。)について、その約定値段(国債証券先物取引に係る現金決済先物取引にあっては、約定数値)と日中清算値段(国債証券先物取引に係る現金決済先物取引にあっては、日中清算数値)との差に相当する額

(b) 金利先物取引について、その取引日の夜間立会及び午前立会の終了までに行われた自己の計算による取引 (当該取引日の午前立会の終了までに行われたJ-NET取引を含む。) について、その約定数値と日中清算数値との差に相当する額

(c) 指数先物取引について、その取引日の夜間立会及び日中立会のうち午前11時までに行われた自己の計算による指数先物取引(当該取引日の午前11時までに行われたJ－NET取引を含む。)について、その約定数値と日中清算数値との差に相当する額

(d) 商品先物取引について、その取引日の夜間立会及び日中立会のうち午前11時までに行われた自己の計算による商品先物取引(当該取引日の午前11時まで

に行われたJ－NET取引を含む。)について、その約定値段と日中清算値段との差に相当する額

b　前取引日の自己の計算による建玉について、前取引日の清算値段(国債証券先物取引に係る現金決済先物取引、金利先物取引及び指数先物取引にあっては、清算数値)と日中清算値段(国債証券先物取引に係る現金決済先物取引、金利先物取引及び指数先物取引にあっては、日中清算数値)との差に相当する額

(3)　日中オプション取引代金相当額

次のaからcまでに定める額を合計した額とする。

a　国債証券先物オプション取引について、その取引日の終了する日の午前立会終了までに行われた自己の計算によるオプション取引(当該取引日の終了する日の午前11時までに行われたJ－NET取引を含む。)に係る取引代金に相当する額

b　有価証券オプション取引及び指数オプション取引について、その日の午前立会における午前11時まで(有価証券オプション取引(指定市場開設者が定めるフレックス限月取引に限る。)及び指数オプション取引にあっては、その取引日の日中立会における午前１１時まで)に行われた自己の計算によるオプション取引(当該日又は当該取引日の午前11時までに行われたJ－NET取引を含む。)に係る取引代金に相当する額

c　商品先物オプション取引について、その取引日の夜間立会及び日中立会における午前11時までに行われた自己の計算によるオプション取引(当該取引日の午前11時までに行われたJ－NET取引を含む。)に係る取引代金に相当する額

(4)　業務方法書第46条の3及び第46条の4に規定する区分口座ごとの担保超過リスク額を合計した額

別表2により業務方法書第46条の3及び第46条の4に規定する区分口座ごとに算出される額を合計した額とする。

(日中清算値段、日中清算数値及び日中清算価格)

第20条の4　当社は、第20条の2第1項の規定により取引証拠金を預託させることとした場合は、当社が定めるところにより、日中清算値段、日中清算数値及び日中清算価格を定める。

(緊急取引証拠金の預託)

第21条　清算参加者は、国債証券先物取引、指数先物取引、貴金属先物取引又は石油先物取引(商品先物取引法(昭和25年法律第239号。)第2条第3項第1号又は第2号に掲げる取引のうち石油に係るものをいう。以下同じ。)の相場が次の各号に該当する場合その他当社が必要と認めたときにおいて、自己分の取引証拠金として当社に預託している金銭の額及び有価証券等を代用価格により評価した額の合計額が次条に規定する緊急取引証拠金所要額に満たないときは、その不足額以上の額を、自己分の取引証拠

金として、その日の午後4時までに当社に追加預託しなければならない。この場合において、当該取引証拠金は、有価証券等をもって代用預託することができる。

(1)　国債証券先物取引の相場が午後立会において当社が定める基準を超えて変動した場合

(2)　指数先物取引の相場が日中立会において当社が定める基準を超えて変動した場合

(3)　貴金属先物取引の相場が日中立会において当社が定める基準を超えて変動した場合

(4)　石油先物取引の相場が日中立会において当社が定める基準を超えて変動した場合

2　当社は、前項の規定により取引証拠金の預託を行わせる場合には、その旨を速やかに清算参加者に通知する。

3　第1項の規定にかかわらず、緊急取引証拠金所要額から当該所要額を算出する時点で適用した自己分の取引証拠金所要額を控除した額が1,000万円以下となる清算参加者については、第1項の規定による自己分の取引証拠金の追加預託の義務を負わないものとする。

4　第20条第2項の規定は、第1項の取引証拠金について準用する。

(緊急取引証拠金所要額)

第22条　緊急取引証拠金所要額は、リスク再計算額に先物取引差金相当額及びオプション取引代金相当額を、当該額が支払いとなる場合は加え、受領となる場合は減じて得た額に、業務方法書第46条の3及び第46条の4に規定する区分口座ごとの担保超過リスク額を合計した額及び第9条の2第1項に定める事前割増額を加えた額とする。この場合において、これらの用語の意義は、次の各号に定めるところによる。

(1)　リスク再計算額

第4条の規定中「先物・オプション取引に係る取引参加者の自己の計算による」とあるのは「国債証券先物取引、国債証券先物オプション取引及び金利先物取引についてはその取引日の終了する日の午後1時時点、有価証券オプション取引、指数先物取引及び指数オプション取引についてはその日(有価証券オプション取引(指定市場開設者が定めるフレックス限月取引に限る。)、指数先物取引又は指数オプション取引にあっては、その取引日)の午後1時時点、商品先物取引及び商品先物オプション取引についてはその取引日の午後1時時点における取引参加者の自己の計算による」と、「その取引日にクロスマージンの申請の対象となった建玉」とあるのは「その前取引日にクロスマージンの申請の対象となった建玉」と、「自己分の買オプション価値の総額は、取引参加者の自己の計算による」とあるのは「自己分の買オプション価値の総額は、国債証券先物オプション取引についてはその取引日の終了する日の午後1時時点、有価証券オプション取引及び指数オプション取引についてはその日(有価証券オプション取引(指定市場開設者が定めるフレックス限月取引に限る。)又は指数オプション取引にあっては、その取引日)の午後1時時点、商品

先物オプション取引についてはその取引日の午後１時時点における取引参加者の自己の計算による」と、「有価証券オプション取引については、取引参加者の自己の計算による」とあるのは「有価証券オプション取引についてはその日（有価証券オプション取引（指定市場開設者が定めるフレックス限月取引に限る。）についてはその取引日）の午後１時時点における取引参加者の自己の計算による」と、「清算価格」とあるのは「緊急清算価格」と、「第７条に規定する清算価格をいう。」とあるのは「次条に規定する緊急清算価格をいう。」と、「国債証券先物オプション取引については、取引参加者の自己の計算による」とあるのは「国債証券先物オプション取引についてはその取引日の終了する日の午後１時時点における取引参加者の自己の計算による」と、「指数オプション取引については、取引参加者の自己の計算による」とあるのは「指数オプション取引についてはその取引日の午後１時時点における取引参加者の自己の計算による」と、「商品先物オプション取引については、取引参加者の自己の計算による」とあるのは「商品先物オプション取引については、その取引日の午後１時時点における取引参加者の自己の計算による」と、「自己分の売オプション価値の総額は、取引参加者の自己の計算による」とあるのは「自己分の売オプション価値の総額は、国債証券先物オプション取引についてはその取引日の終了する日の午後１時時点、有価証券オプション取引及び指数オプション取引についてはその日（有価証券オプション取引（指定市場開設者が定めるフレックス限月取引に限る。）又は指数オプション取引にあっては、その取引日）の午後 1 時時点、商品先物オプション取引についてはその取引日の午後１時時点における取引参加者の自己の計算による」と読み替えて同条の規定により計算した自己分の取引証拠金所要額に相当する額

(2)　先物取引差金相当額

先物取引について、次のａ及びｂに定める額を合計した額とする。

ａ　次の(a)から（d）までに定める額を合計した額

(a)　国債証券先物取引について、その取引日の夜間立会、午前立会及び午後立会のうち午後１時までに行われた自己の計算による取引（当該取引日の午後１時までに行われたＪ－NET 取引を含む。）について、その約定値段（国債証券先物取引に係る現金決済先物取引にあっては、約定数値）と緊急清算値段（国債証券先物取引に係る現金決済先物取引にあっては、緊急清算数値）との差に相当する額

(b)　金利先物取引について、その取引日の夜間立会、午前立会及び午後立会のうち午後１時までに行われた自己の計算による取引（当該取引日の午後１時までに行われた J-NET 取引を含む。）について、その約定数値と緊急清算数値との差に相当する額

(c)　指数先物取引について、その取引日の夜間立会及び日中立会のうち午後１時までに行われた自己の計算による指数先物取引（当該取引日の午後１時までに行

われたJ－NET取引を含む。)について、その約定数値と緊急清算数値との差に相当する額

(d)　商品先物取引について、その取引日の夜間立会及び日中立会のうち午後1時までに行われた自己の計算による商品先物取引(当該取引日の午後1時までに行われたJ－NET取引を含む。)について、その約定値段と緊急清算値段との差に相当する額

b　前取引日の自己の計算による建玉について、前取引日の清算値段(国債証券先物取引に係る現金決済先物取引、金利先物取引及び指数先物取引にあっては、清算数値)と緊急清算値段(国債証券先物取引に係る現金決済先物取引、金利先物取引及び指数先物取引にあっては、緊急清算数値)との差に相当する額

(3)　オプション取引代金相当額

次のaからcまでに定める額を合計した額とする。

a　国債証券先物オプション取引について、その取引日の終了する日の午後1時までに行われた自己の計算によるオプション取引(当該取引日の終了する日の午後1時までに行われたJ－NET取引を含む。)に係る取引代金に相当する額

b　有価証券オプション取引及び指数オプション取引について、その日の午後立会における午後1時まで(有価証券オプション取引(フレックス限月取引に限る。)及び指数オプション取引にあっては、その取引日の日中立会における午後1時まで)に行われた自己の計算によるオプション取引(当該日又は当該取引日の午後1時までに行われたJ－NET取引を含む。)に係る取引代金に相当する額

c　商品先物オプション取引について、その取引日の夜間立会及び日中立会における午後1時までに行われた自己の計算によるオプション取引(当該取引日の午後1時までに行われたJ－NET取引を含む。)に係る取引代金に相当する額

(4)　業務方法書第46条の3及び第46条の4に規定する区分口座ごとの担保超過リスク額を合計した額

別表2により業務方法書第46条の3及び第46条の4に規定する区分口座ごとに算出された額を合計した額とする。

(緊急清算値段、緊急清算数値及び緊急清算価格)

第23条　当社は、第21条第1項の規定により取引証拠金を預託させることとした場合は、当社の定めるところにより、緊急清算値段、緊急清算数値及び緊急清算価格を定める。

(特定先緊急取引証拠金の預託)

第23条の2　当社は、次の各号に定める基準に該当した清算参加者に対して、取引証拠金所要額を引き上げることができる。

(1)　当該清算参加者のいずれかの業務方法書第46条の3及び第46条の4に規定する区分口座において、次条第1項に規定する業務方法書第46条の3及び第46条の4に規定する区分口座ごとの通常市場環境下リスク相当額を当該区分口座に係る取引証

拠金見込み額(取引証拠金として預託される見込みの額として、当社が定めるところにより計算した額。次号において同じ。)で除して得た比率が、当社が定める数値を超えるとき

(2)　当該清算参加者の次条第2項に規定する当該清算参加者の通常市場環境下リスク相当額通算額を自己分の取引証拠金見込み額で除して得た数値が、当該清算参加者の純財産額(金融商品取引業者以外の者にあっては、純資産額をいう。)又は現金等の財産の状況に応じて当社が定める数値を超えるとき

2　当社は、前項各号のいずれかに該当した清算参加者に対して、その旨及びその不足額を速やかに通知する。

3　前項の通知を受けた清算参加者は、当該不足額以上の額を、自己分の取引証拠金として、当該通知時間の3時間後までに当社に追加預託しなければならない。この場合において、当該取引証拠金は、有価証券等をもって代用預託することができる。

4　前項の規定にかかわらず、当社は、資金決済インフラの稼働時間その他の預託実務等の事情を勘案して、当社が特に認めたときは、当該追加預託の期限及び当該額を変更することができる。

5　第20条第2項の規定は、第3項の取引証拠金について準用する。

(通常市場環境下リスク相当額等)

第23条の3　業務方法書第46条の3及び第46条の4に規定する区分口座ごとの通常市場環境下リスク相当額は、当該区分口座について、別表2のリスク再計算額に先物取引差金相当額及びオプション取引代金相当額を、当該額が支払いとなる場合は加え、受領となる場合は減じて得た額とする。

2　通常市場環境下リスク相当額通算額は、業務方法書第46条の3及び第46条の4に規定する区分口座について、前項の規定により計算した額から当該区分口座の取引証拠金預託見込額を減じた額(正の額に限る。)に業務方法書第46条の3第1項に規定する区分口座について前項の規定により計算した額を通算した額とする。

3　当社は、第23条の2第3項の規定により取引証拠金を預託させることとした場合は、当社の定めるところにより、特定先緊急清算値段、特定先緊急清算数値及び特定先緊急清算価格を定める。

(取引証拠金に係る返還請求権)

第24条　当社に預託された清算参加者の各顧客に係る清算参加者委託分の取引証拠金に対する返還請求権は、清算参加者委託分の取引証拠金(直接預託分)として当社に預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額並びに清算参加者委託分の取引証拠金(差換預託分)として当社に預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額のうち当該顧客により委託証拠金として預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額(当該顧客が差し入れた取引証拠金が当社に預託されるまでの間における当該取引証拠金に係る金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額

を含む。以下この項において「清算参加者顧客分現預託合計額」という。)を限度として、次の各号に掲げる者が、当該各号に定める額に相当する部分について有するものとする。

(1) 当該顧客

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

(2) 清算参加者

清算参加者顧客分現預託合計額から、前号に定める額及び当該清算参加者が当社に対して支払い又は引き渡すべき当該顧客の委託に基づく先物・オプション取引に係る債務のうち未履行部分に相当する額を控除した額

2 前項の規定にかかわらず、清算参加者の顧客が取次者である場合において当社に預託された各申込者に係る清算参加者委託分の取引証拠金に対する返還請求権は、当該申込者により清算参加者委託分の取引証拠金(直接預託分)として当社に預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額、清算参加者委託分の取引証拠金(取次者差換預託分)として当社に預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額のうち当該申込者により取次証拠金として預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額並びに清算参加者委託分の取引証拠金(差換預託分)として当社に預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額のうち当該申込者により取次証拠金又は委託証拠金として預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額(当該顧客が差し入れた取引証拠金が当社に預託されるまでの間における当該取引証拠金に係る金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額を含む。以下この項において「清算参加者申込者分現預託合計額」という。)を限度として、次の各号に掲げる者が、当該各号に定める額に相当する部分について有するものとする。

(1) 当該申込者

清算参加者申込者分現預託合計額から、当該申込者が当該顧客に対して負担する先物・オプション取引に係る債務のうち未履行部分に相当する額を控除した額

(2) 当該顧客

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

(3) 清算参加者

清算参加者申込者分現預託合計額から、前2号に定める額及び当該清算参加者が当社に対して支払い又は引き渡すべき当該申込者の委託に基づく先物・オプション取引に係る債務のうち未履行部分に相当する額を控除した額

3 第1項の規定にかかわらず、清算参加者の顧客が取次者である場合において当社に預託された各取次者に係る清算参加者委託分の取引証拠金に対する返還請求権は、清算

参加者委託分の取引証拠金(取次者差換預託分)として当社に預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額のうち当該申込者により取次証拠金として預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額を超えて当社に預託された額並びに清算参加者委託分の取引証拠金(差換預託分)として当社に預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額のうち当該申込者により取次証拠金として預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額を超えて委託証拠金として清算参加者に預託された額(当該顧客が差し入れた取引証拠金が当社に預託されるまでの間における当該取引証拠金に係る金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額を含む。以下この項において「清算参加者取次者分現預託合計額」という。)を限度として、次の各号に掲げる者が、当該各号に定める額に相当する部分について有するものとする。

(1)　当該顧客

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

(2)　清算参加者

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

4　当社に預託された非清算参加者の各顧客に係る非清算参加者委託分の取引証拠金に対する返還請求権は、非清算参加者委託分の取引証拠金(直接預託分)として当社に預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額並びに非清算参加者委託分の取引証拠金(差換預託分)として当社に預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額のうち当該顧客により委託証拠金として預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額(当該顧客が差し入れた取引証拠金が当社に預託されるまでの間における当該取引証拠金に係る金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額を含む。以下この項において「非清算参加者顧客分現預託合計額」という。)を限度として、次の各号に掲げる者が、当該各号に定める額に相当する部分について有するものとする。

(1)　当該顧客

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

(2)　非清算参加者

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

(3)　指定清算参加者

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

5　前項の規定にかかわらず、非清算参加者の顧客が取次者である場合において当社に預託された各申込者に係る非清算参加者委託分の取引証拠金に対する返還請求権は、当該申込者により非清算参加者委託分の取引証拠金(直接預託分)として当社に預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額、非清算参加者委託分の取引証拠金(取次者差換預託分)として当社に預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額のうち当該申込者により取次証拠金として預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額並びに非清算参加者委託分の取引証拠金(差換預託分)として当社に預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額のうち当該申込者により取次証拠金又は委託証拠金として預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額(当該顧客が差し入れた取引証拠金が当社に預託されるまでの間における当該取引証拠金に係る金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額を含む。以下この項において「非清算参加者申込者分現預託合計額」という。)を限度として、次の各号に掲げる者が、当該各号に定める額に相当する部分について有するものとする。

(1)　当該申込者

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

(2)　当該顧客

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

(3)　非清算参加者

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

(4)　指定清算参加者

非清算参加者申込者分現預託合計額から、前3号に定める額及び当該指定清算参加者が当社に対して支払い又は引き渡すべき当該申込者の委託に基づく先物・オプション取引に係る債務のうち未履行部分に相当する額を控除した額

6　第4項の規定にかかわらず、非清算参加者の顧客が取次者である場合において当社に預託された各取次者に係る非清算参加者委託分の取引証拠金に対する返還請求権は、非清算参加者委託分の取引証拠金(取次者差換預託分)として当社に預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額のうち当該申込者により取次証拠金として預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額を超えて当社に預託された額並びに非清算参加者委託分の取引証拠金(差換預託分)として当社に預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額のうち当該申込者により取次証拠金として預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額を超えて委託証拠金として非清算参加者に預託された額(当該顧客が差し入れた取引証拠金が当社に預託されるまでの間における当該取引証拠金に係る金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額を含む。以下この項において「非清算参加者取次者分現預託合計額」という。)を限度として、次の各号に掲げる者が、当該各号に定める額に相当する部分について有するものとする。

(1)　当該顧客

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

(2)　非清算参加者

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

(3)　指定清算参加者

非清算参加者取次者分現預託合計額から、前2号に定める額及び当該指定清算参加者が当社に対して支払い又は引き渡すべき当該顧客の委託に基づく先物・オプション取引に係る債務のうち未履行部分に相当する額(前項第4号の規定により控除された額を除く。)を控除した額

7　当社に預託された各非清算参加者に係る非清算参加者自己分の取引証拠金及び非清算参加者委託分の取引証拠金に対する返還請求権は、非清算参加者自己分の取引証拠金(直接預託分)として当社に預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額、非清算参加者自己分の取引証拠金(差換預託分)として当社に預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額のうち当該非清算参加者により取引証拠金として清算参加者に差し入れられている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額、非清算参加者委託分の取引証拠金(差換預託分)として当社に預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額のうち非清算参加者に委託証拠金として預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額(当該顧客が差し入れた取引証拠

金が当社に預託されるまでの間における当該取引証拠金に係る金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額を含む。)を超えて当社に預託された額並びに非清算参加者委託分の取引証拠金(差換預託分)として当社に預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額のうち非清算参加者に委託証拠金として預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額(当該顧客が差し入れた取引証拠金が当社に預託されるまでの間における当該取引証拠金に係る金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額を含む。)を超えて非清算参加者証拠金として清算参加者に預託された額(以下この項において「非清算参加者分現預託合計額」という。)を限度として、次の各号に掲げる者が、当該各号に定める額に相当する部分について有するものとする。

(1) 当該非清算参加者

非清算参加者分現預託合計額から、当該非清算参加者が指定清算参加者に対して支払い又は引き渡すべきすべての先物・オプション取引に係る債務のうち未履行部分に相当する額(第4項第2号、第5項第3号及び前項第2号の規定により控除された額を除く。)を控除した額

(2) 指定清算参加者

非清算参加者分現預託合計額から、前号に定める額及び指定清算参加者が当社に対して支払い又は引き渡すべき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先物・オプション取引に係る債務のうち未履行部分に相当する額(第4項第3号、第5項第4号及び前項第3号の規定により控除された額を除く。)を控除した額

8 当社に預託された各清算参加者に係る清算参加者自己分の取引証拠金及び清算参加者委託分の取引証拠金に対する返還請求権は、清算参加者自己分の取引証拠金として当社に預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額、清算参加者委託分の取引証拠金(差換預託分)として当社に預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額のうち清算参加者に委託証拠金として預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額(当該顧客が差し入れた取引証拠金が当社に預託されるまでの間における当該取引証拠金に係る金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額を含む。)を超えて当社に預託された額、非清算参加者自己分の取引証拠金(差換預託分)として当社に預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額のうち当該非清算参加者により取引証拠金として清算参加者に差し入れられている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額を超えて当社に預託された額並びに非清算参加者委託分の取引証拠金(差換預託分)として当社に預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額のうち当該非清算参加者により非清算参加者証拠金として清算参加者に預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額を超えて当社に預託された額(以下この項において「清算参加者分現預託合計額」という。)を限度として、清算参加者が、清算参加者分現預託合計額から当該清算参加者が当社に対して支払い又は引き渡すべきすべての先物・オプション取引に係る債務のうち未履行

部分に相当する額(第1項第2号、第2項第3号、第3項第2号、第4項第3号、第5項第4号、第6項第3号及び前項第2号の規定により控除された額を除く。)を控除した額に相当する部分について有するものとする。

9　取引証拠金の返還請求権の行使は、次の各号に定める方法によるものとする。

(1)　清算参加者の有する返還請求権は、当該清算参加者が当該返還請求権の行使である旨を当社に通告し、これを行使するものとする。

(2)　非清算参加者の有する返還請求権は、指定清算参加者が当該非清算参加者の代理人としてこれを行使するものとする。

(3)　取引参加者の顧客の有する返還請求権は、当該取引参加者(当該取引参加者が非清算参加者である場合には、当該非清算参加者及びその指定清算参加者)が当該顧客の代理人としてこれを行使するものとする。

(4)　申込者の有する返還請求権は、当該申込者の委託に基づく先物・オプション取引を顧客から受託した取引参加者(当該取引参加者が非清算参加者である場合には、当該非清算参加者及びその指定清算参加者)が当該申込者の代理人としてこれを行使するものとする。

(取引証拠金所要額の通知)

第24条の2　当社は、取引日ごとに(有価証券オプション取引(指定市場開設者が定めるフレックス限月取引を除く。)にあっては、毎日)、建玉確定処理(業務方法書第73条の2、第73条の6、第73条の16、第73条の20、第73条の26、第73条の31の2及び第73条の31の63の規定による申告数量を決済に係るものとして減じる処理並びに同第73条の19の規定によるオプションの権利行使及び割当てに伴う建玉の加減の処理をいう。以下この条において同じ。)の後に、その取引日(有価証券オプション取引(指定市場開設者が定めるフレックス限月取引を除く。)にあっては、その日)の自己分の取引証拠金所要額を清算参加者に通知するものとする。

2　当社は、取引日ごとに(有価証券オプション取引(指定市場開設者が定めるフレックス限月取引を除く。)にあっては、毎日)、その取引日(有価証券オプション取引(指定市場開設者が定めるフレックス限月取引を除く。)にあっては、その日をいう。以下この項において同じ。)の建玉確定処理後に、業務方法書第46条の3及び第46条の4に規定する区分口座ごとに第5条の2で規定する取引証拠金所要額を、当該区分口座におけるその取引日の委託分及び有価証券等清算取次ぎ分の取引証拠金所要額として、清算参加者に対し、通知するものとする。

(委託分及び有価証券等清算取次ぎ分のポジション申告)

第25条　清算参加者は、取引日ごとに(有価証券オプション取引(指定市場開設者が定めるフレックス限月取引を除く。)にあっては、毎日)、各銘柄について、業務方法書第46条の3第2号a、同条第3号a及び第46条の4第2号aに規定する区分口座ごとに、当該銘柄に係る各顧客又は任意に細分化した単位の売建玉及び買建玉に係る情報を当

社が定める時限までに当社に申告するものとする。この場合において、当該清算参加者は、当該売建玉及び買建玉のうち、有価証券等清算取次ぎの委託に基づく売建玉及び買建玉に係る情報に限り、自らの申告に代えて、非清算参加者をして申告を行わせることができる。

(顧客の委託及び非清算参加者の有価証券等清算取次ぎの委託に基づく先物・オプション取引に関する事項の報告義務)

第26条　清算参加者は、顧客の委託に基づく建玉の数量その他顧客の委託に基づく先物・オプション取引に関する事項及び有価証券等清算取次ぎの委託に基づく建玉の数量その他有価証券等清算取次ぎの委託に基づく先物・オプション取引に関する事項で当社が必要と認める事項について当社から報告を求められたときは、直ちに当該事項を記載した書面を当社に提出しなければならない。

第2章の2　受渡代金等

(自己分の受渡代金等の預託)

第26条の2　清算参加者は、自己の計算による商品先物取引について受渡しにより決済する場合であって、当該決済が金銭又は倉荷証券その他の物をもって行われるときは、受渡しの決済のための金銭又は倉荷証券その他の物(以下「受渡代金等」という。)を、当社が定めるところにより、当社に預託することができる。

(委託分の受渡代金等の預託)

第26条の3　清算参加者は、顧客が受渡代金等を差し入れた場合にあっては、当該受渡代金等を、当該顧客の代理人として、当社が定めるところにより、当社に預託することができる。

(取次者に係る受渡代金等の預託に関する特則)

第26条の4　前条の規定にかかわらず、清算参加者は、顧客が清算参加者に差し入れた受渡代金等が申込者の代理人として差し入れたものである場合は、当該受渡代金等を、当該申込者の代理人として、当社が定めるところにより、当社に預託することができる。

(有価証券等清算取次ぎ分の受渡代金等の預託に関する特則)

第26条の5　清算参加者は、非清算参加者が差し入れた受渡代金等を、当該非清算参加者又は当該非清算参加者の顧客の代理人として、当社が定めるところにより、当社に預託することができる。

2　前項の規定にかかわらず、清算参加者は、非清算参加者が清算参加者に差し入れた受渡代金等が申込者の代理人として差し入れたものである場合は、当該受渡代金等を、当該申込者の代理人として当社に預託することができる。

(受渡代金等に係る返還請求権)

第26条の6　当社に預託された各清算参加者に係る受渡代金等に対する返還請求権は、清算参加者が有するものとする。

2　当社に預託された各非清算参加者に係る非清算参加者自己分の受渡代金等に対する返還請求権は、当該各非清算参加者が有するものとする。

3　当社に預託された清算参加者の各顧客に係る清算参加者委託分の受渡代金等に対する返還請求権は、当該顧客が有するものとする。

4　清算参加者の顧客が取次者である場合において当社に預託された各申込者に係る清算参加者委託分の受渡代金等に対する返還請求権は、当該申込者が有するものとする。

5　当社に預託された非清算参加者の各顧客に係る非清算参加者委託分の受渡代金等に対する返還請求権は、当該顧客が有するものとする。

6　非清算参加者の顧客が取次者である場合において当社に預託された各申込者に係る非清算参加者委託分の受渡代金等に対する返還請求権は、当該申込者が有するものとする。

7　受渡代金等の返還請求権の行使は、次の各号に定める方法によるものとする。

(1)　清算参加者の有する返還請求権は、当該清算参加者が当該返還請求権の行使である旨を当社に通告し、これを行使するものとする。

(2)　非清算参加者の有する返還請求権は、指定清算参加者が当該非清算参加者の代理人としてこれを行使するものとする。

(3)　清算参加者の顧客の有する返還請求権は、当該清算参加者が当該顧客の代理人としてこれを行使するものとする。

(4)　清算参加者の顧客が取次者である場合において、申込者の有する返還請求権は、当該申込者の委託に基づく商品先物取引を取次者から受託した清算参加者が当該申込者の代理人としてこれを行使するものとする。

(5)　非清算参加者の顧客の有する返還請求権は、当該非清算参加者及びその指定清算参加者が当該顧客の代理人としてこれを行使するものとする。

(6)　非清算参加者の顧客が取次者である場合において、申込者の有する返還請求権は、当該申込者の委託に基づく商品先物取引を取次者から受託した非清算参加者及びその指定清算参加者が当該申込者の代理人としてこれを行使するものとする。

第3章　支払不能等による債務引受停止の場合における未決済約定の取扱い等

第1節　未決済約定の取扱い

(清算参加者の自己の計算による未決済約定の取扱い)

第27条　当社は、支払不能等による債務引受停止を行った場合は、支払不能等による債務引受停止を受けた清算参加者の自己の計算による未決済約定(取引最終日が到来した限月取引の取引最終日後における当該限月取引の未決済約定を除く。以下この章において同じ。)について、当社が指定する他の清算参加者をして転売若しくは買戻し又は権利行使を行わせることができるものとする。

2　前項の場合においては、当社が指定した他の清算参加者と支払不能等による債務引受停止を受けた清算参加者との間に委任契約が成立していたものとする。

(清算参加者の顧客の委託に基づく未決済約定の取扱い)

第28条　当社は、清算参加者が指定市場開設者から支払不能等による売買停止等を受けた場合は、当該指定市場開設者が行う措置の内容に応じて、当社と支払不能等による売買停止等を受けた清算参加者(以下「支払不能等清算参加者」という。)との間の未決済約定のうち当該清算参加者の顧客の委託に基づくものについて、他の清算参加者への引継ぎその他必要な整理を行わせるものとする。

(有価証券等清算取次ぎの委託に基づく未決済約定の取扱い)

第29条　当社は、非清算参加者が指定市場開設者から支払不能等による売買停止等を受けた場合は、当該指定市場開設者が行う措置の内容に応じて、当社と支払不能等による売買停止等を受けた非清算参加者の指定清算参加者との間の未決済約定のうち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ものについて、他の清算参加者への引継ぎその他必要な整理を行わせるものとする。

2　指定清算参加者が支払不能等による債務引受停止を受けたことにより指定市場開設者から有価証券等清算取次ぎの委託の停止を受けた非清算参加者に対する措置として、当社と当該指定清算参加者との間の未決済約定のうち当該非清算参加者の未決済約定について、他の清算参加者への引継ぎ又は必要な整理を行わせる場合には、第24条第9項第2号の指定清算参加者の代理権は消滅するものとする。

第2節　清算参加者の委託分の取引証拠金の取扱い

(委託分の取引証拠金の取扱い)

第30条　当社は、第28条の規定により支払不能等清算参加者の顧客の委託に基づく未決済約定の他の清算参加者への引継ぎ(以下「支払不能による売買停止時の建玉の移管」という。)を行った場合(移管を受けた当該他の清算参加者を以下「支払不能時の移管先清算参加者」という。)には、支払不能等清算参加者が当社に預託していた当該顧客に係る委託分の取引証拠金(第24条の規定により当該顧客又はその申込者が返還請求権を有する部分に限る。次項において同じ。)について、当該支払不能による売買停止時の建玉の移管が行われた日に当該支払不能時の移管先清算参加者(指定市場開設者が定めた支払不能時の移管先取引参加者が非清算参加者である場合には、当該支払不能時の移管先取引参加者及びその指定清算参加者である支払不能時の移管先清算参加者)を代理人として、当社に預託したものとみなす。

2　前項の規定により当社に預託したものとみなされる当該顧客に係る委託分の取引証拠金のうち、清算参加者委託分の取引証拠金(差換預託分)として預託されているものの額は、次の各号に掲げる額のうちいずれか小さい額とする。

(1)　顧客が支払不能等清算参加者に委託証拠金として預託した金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額に相当する額

(2)　支払不能等清算参加者が当社に預託していた清算参加者委託分の取引証拠金(差換預託分)から、当該支払不能等清算参加者が清算参加者委託分の取引証拠金(差換預

託分)として預託している外国通貨をもって円貨を取得し、又は代用預託していた有価証券等を次条の規定により当社が換金したときの当該換金に要した費用を差し引いた額を、各顧客が支払不能等清算参加者に委託証拠金として預託した金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額に相当する額に応じて按分した額

(差換預託分の取引証拠金等の換金)

第31条　指定市場開設者が支払不能等清算参加者の顧客の委託に基づく未決済約定について転売若しくは買戻し若しくは権利行使を行わせることとした場合又は支払不能等清算参加者の顧客の委託に基づく支払不能による売買停止時の建玉の移管を行わせることとした場合には、当社は、清算参加者委託分の取引証拠金(差換預託分)として預託されている外国通貨の全部若しくは一部をもって当社が適当と認める方法により円貨を取得し、又は代用預託されている有価証券等の全部又は一部を当社が適当と認める方法により換金することができる。この場合において、支払不能等清算参加者及びその顧客と当社との間に委任契約が成立していたものとする。

2　前項の場合において、顧客が取次者であり、かつ、指定市場開設者が支払不能等清算参加者に対する先物・オプション取引に係る債務について期限の利益を喪失している顧客又は支払不能による売買停止時の建玉の移管を行うことが適当でないと認める顧客として定める者であるときは、当社は、清算参加者委託分の取引証拠金(取次者差換預託分)として預託されている外国通貨の全部若しくは一部をもって当社が適当と認める方法により円貨を取得し、又は代用預託されている有価証券等の全部又は一部を当社が適当と認める方法により換金することができる。この場合において、支払不能等清算参加者、顧客及びその申込者と当社との間に委任契約が成立していたものとする。

(差換預託分の取引証拠金等の取扱いの特例)

第32条　前条第1項の規定により当社が外国通貨をもって円貨を取得し、又は有価証券等を換金した場合は、清算参加者委託分の取引証拠金(差換預託分)は、支払不能等清算参加者が清算参加者委託分の取引証拠金(差換預託分)として当社に預託している当該取得に係る外国通貨以外の金銭及び当該換金に係る有価証券等以外の有価証券等並びに当該取得後の金銭の額から当該取得に要した費用を差し引いた額の金銭及び当該換金後の金銭の額から当該換金に要した費用を差し引いた額の金銭とする。

2　前条第2項の規定により当社が外国通貨をもって円貨を取得し、又は有価証券等を換金した場合は、清算参加者委託分の取引証拠金(取次者差換預託分)は、支払不能等清算参加者が清算参加者委託分の取引証拠金(取次者差換預託分)として当社に預託している当該取得に係る外国通貨以外の金銭及び当該換金に係る有価証券等以外の有価証券等並びに当該取得後の金銭の額から当該取得に要した費用を差し引いた額の金銭及び当該換金後の金銭の額から当該換金に要した費用を差し引いた額の金銭とする。

(委託分の取引証拠金に係る返還請求権の特例)

第33条　第30条第1項の規定により当社に預託したものとみなされる委託分の取引証拠金に係る顧客の返還請求権は、同項に規定する支払不能時の移管先清算参加者が代理人としてこれを行使するものとする。

2　指定市場開設者が支払不能等清算参加者の顧客の委託に基づく未決済約定について転売若しくは買戻し若しくは権利行使を行わせることとした場合又は支払不能等清算参加者の顧客の委託に基づく支払不能による売買停止時の建玉の移管を行わせることとした場合には、支払不能等清算参加者の顧客(支払不能による売買停止時の建玉の移管を行った顧客を除く。)に係る委託分の取引証拠金の返還請求権は、当社に対し直接行使することができるものとする。この場合において、当該顧客に係る委託分の取引証拠金が清算参加者委託分の取引証拠金(差換預託分)として預託されているときは、第30条第2項各号に掲げる額のうちいずれか小さい額を限度とするものとする。

3　当社は、前項の規定により、支払不能等清算参加者の顧客が委託分の取引証拠金の返還請求権を当社に対し直接行使する場合は、次の各号に掲げる取引の区分に従い、当該各号に定める日以後において、当社が必要と認める事項を当社に申告させるものとする。

(1)　国債証券先物取引

当該顧客の委託に基づく未決済約定について、転売若しくは買戻し、最終決済又は受渡決済が行われた日

(2)　金利先物取引

当該顧客の委託に基づく未決済約定について、転売若しくは買戻し又は最終決済が行われた日

(3)　指数先物取引

当該顧客の委託に基づく未決済約定について、転売若しくは買戻し又は最終決済が行われた日

(4)　有価証券オプション取引及び指数オプション取引

当該顧客の委託に基づく未決済約定について、買戻しが行われた日又は権利行使日

(5)　国債証券先物オプション取引

当該顧客の委託に基づく未決済約定について、買戻しが行われた日又は権利行使の割当てを受けた日若しくは権利行使期間満了の日

(6)　商品先物取引

当該顧客の委託に基づく未決済約定について、転売若しくは買戻し、最終決済又は受渡決済が行われた日

(7)　商品先物オプション取引

当該顧客の委託に基づく未決済約定について、買戻しが行われた日又は権利行使日

4　前項の場合において、当該顧客に係る清算参加者委託分の取引証拠金(差換預託分)として預託されているものの返還請求を受けたときは、当社は金銭により返還するものとする。

(取次者に係る委託分の取引証拠金に係る返還請求権の特例)

第34条　指定市場開設者が支払不能等清算参加者の顧客の申込者の委託の取次ぎに基づく未決済約定について転売若しくは買戻し若しくは権利行使を行わせることとした場合において、取次者が指定市場開設者が支払不能等清算参加者に対する先物・オプション取引に係る債務について期限の利益を喪失している顧客又は支払不能による売買停止時の建玉の移管を行うことが適当でないと認める顧客として定める者であるときは、当該取次者の申込者は、前条第3項各号に定める日以後に、当該取次者が指定市場開設者が支払不能等清算参加者に対する先物・オプション取引に係る債務について期限の利益を喪失している顧客又は支払不能による売買停止時の建玉の移管を行うことが適当でないと認める顧客として定める者である旨及び当該申込者が有する返還請求権の額を当社に通告し、当社に対し委託分の取引証拠金の返還請求権の直接行使に関する承諾を求めることができるものとする。

2　前項の場合において、当社は、支払不能等清算参加者に対し当社が必要と認める書面の提出を求めることにより、当該通告事項の内容を確認するものとする。

3　当社は、前項の確認を行った場合は、当該返還請求権の直接行使に関する承諾を行うものとする。

4　第1項の場合において、当該申込者に係る委託分の取引証拠金(当該申込者からの直接預託分の取引証拠金として当社に預託されているものを除く。)に対する返還請求権は、次の各号に掲げる額のうちいずれか小さい額を限度とするものとする。

(1)　顧客の申込者が顧客に取次証拠金として又は支払不能等清算参加者に委託証拠金として預託した金銭の額(当該金銭が外国通貨である場合には、その時価を当該支払不能等による売買停止等を行った日の前日における東京外国為替市場の対顧客直物電信買相場の各外国国債証券の評価に用いる通貨1単位当たりの円貨額により円貨に換算した額をいう。)及び有価証券等の時価評価額(指定市場開設者が支払不能等による売買停止等を行った日の前日における時価により評価した額(当該有価証券等が外国国債証券である場合には、その時価を当該支払不能等による売買停止等を行った日の前日における東京外国為替市場の対顧客直物電信買相場の各外国国債証券の評価に用いる通貨1単位当たりの円貨額により円貨に換算した額)をいう。)の合計額に相当する額

(2)　次のａ及びｂに掲げる額の合計額を、当該顧客の各申込者が当該顧客に取次証拠金として預託した又は委託証拠金として差し入れた金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額に相当する額に応じて按分した額

a　第32条第1項に規定する清算参加者委託分の取引証拠金(差換預託分)の額を、各顧客が支払不能等清算参加者に委託証拠金として預託した金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額に相当する額(当該支払不能等清算参加者が顧客から差し入れられた取引証拠金を当社に預託するまでの間における当該取引証拠金として差し入れられた金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額を含む。)に応じて按分した額

b　第32条第2項に規定する清算参加者委託分の取引証拠金(取次者差換預託分)の額

5　当社は、前項の返還請求を受けた場合は、直接預託分の取引証拠金に係るものを除き、金銭により返還するものとする。

(支払不能時に移管された建玉に係る取引証拠金の返戻等)

第35条　支払不能時の移管先清算参加者は、第30条第1項の規定により当社に預託したものとみなされた取引証拠金の返戻を受けようとする場合は、当社が必要と認める事項を当社に申告しなければならない。

第3節　非清算参加者の委託分の取引証拠金の取扱い

(委託分の取引証拠金の取扱い)

第36条　第30条から前条までの規定は、非清算参加者が指定市場開設者から支払不能等による売買停止等を受けた場合の当該非清算参加者の委託分の取引証拠金の取扱いについて準用する。この場合において、「第28条」とあるのは、「第29条」と、「支払不能等清算参加者」とあるのは、「支払不能等による売買停止等を受けた非清算参加者」と、「清算参加者委託分の取引証拠金(差換預託分)」とあるのは、「非清算参加者委託分の取引証拠金(差換預託分)」と、「転売若しくは買戻し若しくは権利行使」とあるのは、「転売、買戻し若しくは権利行使の委託」と、「及びその顧客」とあるのは、「の指定清算参加者、支払不能による売買停止等による売買停止等を受けた非清算参加者及びその顧客」と、「顧客が取次者であり、かつ、指定市場開設者が支払不能等清算参加者に対する先物・オプション取引に係る債務について期限の利益を喪失している顧客又は支払不能時の建玉の移管を行うことが適当でないと認める顧客」とあるのは、「顧客が取次者であり、かつ、指定市場開設者が支払不能等清算参加者に対する先物・オプション取引に係る債務について期限の利益を喪失している顧客」と、「清算参加者委託分の取引証拠金(取次者差換預託分)」とあるのは、「非清算参加者委託分の取引証拠金(取次者差換預託分)」と、「、顧客及びその申込者」とあるのは、「の指定清算参加者、支払不能等による売買停止等を受けた非清算参加者、顧客及びその申込者」と読み替えるものとする。

第3節の2　顧客分の受渡代金等の取扱い

(受渡代金等に係る返還請求権の特例)

第36条の2　清算参加者が当社から支払不能による債務引受停止を受けた場合又は非清算参加者が指定市場開設者から支払不能等による売買停止等を受けた場合には、当該

清算参加者の顧客(顧客が取次者である場合は、申込者をいう。)及び当該非清算参加者の顧客(顧客が取次者である場合は、申込者をいう。)(以下この条において「顧客等」という。)に係る顧客分の受渡代金等の返還請求権は、当社に対し直接行使することができるものとする。

2　当社は、前項の規定により、顧客等が顧客分の受渡代金等の返還請求権を当社に対し直接行使する場合は、当社が必要と認める事項を当社に申告させるものとし、当該申告を適当と認めたときは、当社の本店所在地においてその支払いを行うものとする。なお、当該返還請求権の行使は、当該顧客等に係る未決済約定がすべて決済された日以後においてできるものとする。

第4節　雑則

(支払不能による売買停止時の建玉の移管等に伴うその他の取扱い)

第37条　第27条から前条までに定めるもののほか、支払不能による売買停止時の建玉の移管等に必要な事項は、当社がその都度定める。

第4章　雑則

(有価証券等清算取次ぎに対する適用)

第38条　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の取次ぎについては、有価証券等清算取次ぎを委託した取引参加者を当該先物・オプション取引の取次ぎを行う者とみなして、第2章及び第3章の規定を適用する。

(取引証拠金及び未決済約定の取扱い等に関する必要事項の決定)

第39条　当社は、この規則に定める事項のほか、先物・オプション取引に係る取引証拠金及び支払不能等による債務引受停止の場合における未決済約定の取扱い等に関して必要がある場合には、所要の取扱いについて規則により定めることができる。

(改正権限)

第40条　この規則の変更は、取締役会の決議をもって行う。ただし、変更の内容が軽微である場合は、この限りでない。

付　則

1　この規則は、平成16年2月2日から施行する。

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

付　則

1　この改正規定は、当社が定める日から施行する。

2　この改正規定施行の日(以下「施行日」という。)の前日において日本証券業協会に登録されていた有価証券の時価評価額又は代用価格の計算に施行日前の時価を使用する場合における当該時価は、改正後の別表第2項の規定にかかわらず、日本証券業協会が公表する午後3時現在における直近の売買価格とする。

3　施行日の前日において日本証券業協会に登録されていた銘柄(施行日に株式会社ジャスダック証券取引所に上場された銘柄に限る。)に関する別表第3項の規定の適用については、日本証券業協会が開設する店頭売買有価証券市場における当該銘柄の売買高を株式会社ジャスダック証券取引所における当該銘柄の売買高とみなす。

(注)第1項の「当社が定める日」は平成16年12月13日。

付　則

この改正規定は、平成18年5月1日から施行する。

付　則

この改正規定は、平成19年9月30日から施行する。

付　則

この改正規定は、平成20年1月15日から施行する。

付　則

この改正規定は、平成20年6月16日から施行する。

付　則

この改正規定は、平成21年1月5日から施行する。

付　則

この改正規定は、平成21年3月23日から施行する。

付　則

この改正規定は、平成21年9月28日から施行する。

付　則

この改正規定は、当社が定める日から施行する。

(注)「当社が定める日」は平成21年10月5日。

付　則

この改正規定は、平成21年12月30日から施行する。

付　則

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

付　則

この改正規定は、平成23年11月21日から施行する。

付　則

この改正規定は、平成24年1月30日から施行する。

付　則

この改正規定は、平成25年1月4日から施行する。

付　則

この改正規定は、平成25年2月12日から施行する。

付　則

この改正規定は、平成25年7月16日から施行する。

付　則

この改正規定は、平成25年9月24日から施行する。

付　則

この改正規定は、平成26年1月10日から施行する。

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、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社又は当社以外の機関が設置する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、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、平成26年3月24日以後の当社が定める日から施行する。

付　則

この改正規定は、平成26年7月22日から施行する。

付　則(平成26年9月22日)

この改正規定は、平成26年9月22日から施行する。

付　則(平成 27 年 1 月 19 日)

この改正規定は、平成 27 年 1 月 19 日から施行する。

付　則(平成 27 年 7 月 6 日)

この改正規定は、平成 27 年 7 月 6 日から施行する。

付　則(平成 27 年 9 月 24 日)

1　この改正規定は、平成 27 年 9 月 24 日から施行する。

2　前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社が設置する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、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、平成 27 年 9 月 24 日以後の当社が定める日から施行する。

付　則(平成 27 年 10 月 13 日)

1　この改正規定は、平成 27 年 10 月 13 日から施行する。

2　前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社又は当社以外の機関が設置する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、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、平成 27 年 10 月 13 日以後の当社が定める日から施行する。

付　則(平成 28 年 1 月 18 日)

この改正規定は、平成 28 年 1 月 18 日から施行する。

付　則(平成 28 年 7 月 4 日)

この改正規定は、平成 28 年 7 月 4 日から施行する。

付　則(平成 28 年 7 月 19 日)

この改正規定は、平成 28 年 7 月 19 日から施行する。

付　則(平成 29 年 1 月 10 日)

この改正規定は、平成 29 年 1 月 10 日から施行する。

付　則(平成 29 年 4 月 10 日)

この改正規定は、平成 29 年 4 月 10 日から施行する。

付　則(平成 29 年 7 月 10 日)

この改正規定は、平成 29 年 7 月 10 日から施行する。

付　則(平成 29 年 10 月 10 日)

この改正規定は、平成 29 年 10 月 10 日から施行する。

付　則(平成 30 年 1 月 9 日)

この改正規定は、平成 30 年 1 月 9 日から施行する。

付　則(平成 30 年 2 月 13 日)

1　この改正規定は、平成 30 年 2 月 13 日から施行する。ただし、第 23 条の 2 及び第 23 条の 3 の改正規定は、この改正規定の施行日以後の日で当社が定める日から適用する。

2　前項本文の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社又は当社以外の機関が設置する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、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、平成 30 年 2 月 14 日以後の当社が定める日から施行する。

付　則(平成 30 年 4 月 9 日)

この改正規定は、平成 30 年 4 月 9 日から施行する。

付　則(平成 30 年 5 月 1 日)

この改正規定は、平成 30 年 5 月 1 日から施行する。

付　則(平成 30 年 6 月 25 日)

1　この改正規定は、平成 30 年 6 月 25 日から施行する。

2　前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社又は当社以外の機関が設置する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、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、平成 30 年 6 月 25 日以後の当社が定める日から施行する。

付　則(平成 30 年 7 月 9 日)

この改正規定は、平成 30 年 7 月 9 日から施行する。

付　則(平成 30 年 10 月 9 日)

この改正規定は、平成 30 年 10 月 9 日から施行する。

付　則(平成 31 年 1 月 15 日)

この改正規定は、平成 31 年 1 月 15 日から施行する。

付　則(平成 31 年 4 月 8 日)

この改正規定は、平成31年4月8日から施行する。

付　則(令和元年7月8日)

この改正規定は、令和元年7月8日から施行する。

付　則(令和元年10月7日)

この改正規定は、令和元年10月7日から施行する。

付　則(令和2年1月14日)

この改正規定は、令和2年1月14日から施行する。

付　則(令和2年7月13日)

この改正規定は、令和2年7月13日から施行する。

付　則(令和2年7月27日)

1　この改正規定は、令和2年7月27日から施行する。

2　前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社又は当社以外の機関が設置する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、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、令和2年7月27日以後の当社が定める日から施行する。

3　第1項の規定にかかわらず、金融商品取引法等の一部を改正する法律(平成24年法律第86号)附則第4条第1項に規定する特定会員である清算参加者の顧客が取引証拠金を差し入れた場合及び委託証拠金を預託した場合における改正後の第11条第2項から第4項までの規定の適用については、「自己の金銭」とあるのは「金銭」とする。

付　則(令和2年10月5日)

この改正規定は、令和2年10月5日から施行する。

付　則(令和3年1月12日)

この改正規定は、令和3年1月12日から施行する。

付　則(令和3年4月5日)

この改正規定は、令和3年4月5日から施行する。

付　則(令和3年7月5日)

この改正規定は、令和3年7月5日から施行する。

付　則(令和3年9月21日)

1　この改正規定は、令和3年9月21日から施行する。
2　前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社又は当社以外の機関が設置する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、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、令和3年9月21日以後の当社が定める日から施行する。

付　則(令和3年10月11日)

この改正規定は、令和3年10月11日から施行する。

付　則(令和4年1月11日)

この改正付則は、令和4年1月11日から施行する。

付　則(令和4年4月4日)

1　この改正規定は、令和4年4月4日から施行する。
2　前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社が設置する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、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、令和4年4月4日以後の当社が定める日から施行する。

付　則(令和4年4月4日)

この改正規定は、令和4年4月4日から施行する。

付　則(令和4年7月4日)

この改正規定は、令和4年7月4日から施行する。

付　則(令和4年9月21日)

1　この改正規定は、令和4年9月21日から施行する。
2　前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社が設置する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、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、令和4年9月21日以後の当社が定める日から施行する。
3　この改正規定の施行に関し必要な事項については、当社が別に定めるところによる。

付　則(令和4年10月11日)

この改正規定は、令和4年10月11日から施行する。

付　則(令和5年5月29日)

1　この改正規定は、令和5年5月29日から施行する。
2　前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社が設置する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、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、令和5年5月29日以後の当社が定める日から施行する。

付　則(令和5年11月6日)

1　この改正規定は、令和5年11月6日から施行する。
2　前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社が設置する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、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、令和5年11月6日以後の当社が定める日から施行する。

別表１

代用有価証券等の種類及びその代用価格等に関する表

１　取引証拠金、委託証拠金及び取次証拠金の代用有価証券等の代用価格は、当該代用有価証券等の差入日又は預託日の前々日（休業日に当たるときは、順次繰り上げる。）における時価に当社の定める率を乗じた額（当該有価証券等が外国国債証券である場合は、その時価に当社の定める率を乗じた額を取引証拠金の預託を行う日の前々日における東京外国為替市場の対顧客直物電信買相場の各外国国債証券の評価に用いる通貨１単位当たりの円貨額により円貨に換算した額）（委託証拠金及び取次証拠金の代用有価証券等の代用価格にあっては、当社の定める率を乗じた額を超えない額）とする。ただし、当社は、相場に著しい変動を生じた場合等特に必要があると認めた場合には、代用価格を変更することができる。

２　前項の有価証券等の種類、時価及び当社の定める率は以下のとおりとする。

<table>
<tr><th colspan="2">有価証券等の種類</th><th>時価</th><th>時価に乗ずべき率</th></tr>
<tr><td rowspan="2">国債証券（物価連動国債にあっては国債店頭取引清算業務において清算対象取引とするものに限る。）</td><td>日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの</td><td>当該売買参考統計値のうち平均値（物価連動国債にあっては、当該平均値に財務省が公表する連動係数を乗じた値）</td><td rowspan="2">上限を100分の99として、国債証券の種類及び残存期間に応じて、金利が大きく変動した時期の価格変動率を加味した過去10年間の価格下落率を算出し、その99％カバー最小値（注8）を1から減じ100分の1未満を切り捨てた率として当社の定める率</td></tr>
<tr><td>売買参考統計値が発表されていないもののうち国内の金融商品取引所において上場されているもの</td><td>金融商品取引所（注1）における最終価格（注2）</td></tr>
</table>

政府保証債券 金融商品取引法施行令第2条の11に定める債券である円貨債券(注3)	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの	当該売買参考統計値のうち平均値	上限を100分の99として、残存期間に応じて、金利が大きく変動した時期の価格変動率を加味した過去10年間の価格下落率を算出し、その99%カバー最小値（注8）を1から減じ100分の1未満を切り捨てた率として当社の定める率
	売買参考統計値が発表されていないもののうち国内の金融商品取引所において上場されているもの	金融商品取引所(注1)における最終価格(注2)	

外国国債証券	アメリカ合衆国財務省証券	ニューヨーク市場における前日の最終の気配相場	上限を100分の99として、残存期間に応じて、金利が大きく変動した時期の価格変動率及び為替が大きく変動した時期の為替レート変動率を加味した過去10年間の価格下落率を算出し、その99%カバー最小値（注8）を1から減じ100分の1未満を切り捨てた率として当社の定める率
	グレートブリテンおよび北アイルランド連合王国政府が発行する英ポンド建債券	ロンドン市場における前日の最終の気配相場	
	ドイツ連邦共和国政府の発行するユーロ建債券	フランクフルト市場における前日の最終の気配相場	
	フランス共和国	パリ市場におけ	

<table>
<tr><td></td><td>政府の発行するユーロ建債券</td><td>る前日の最終の気配相場</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="2">地方債証券(注3)

特殊債券(政府保証債券を除く。)(注4)

社債券(新株予約権付社債券及び交換社債券を除く。)(注3)(注4)

円貨建外国債券(金融商品取引法施行令第2条の11に定める債券である円貨債券、転換社債型新株予約権付社債券及び交換社債券を除く。)(注3)(注4)</td><td>日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの</td><td>当該売買参考統計値のうち平均値</td><td rowspan="2">上限を100分の99として、残存期間に応じて、金利が大きく変動した時期の価格変動率を加味した過去10年間の価格下落率を算出し、その99%カバー最小値（注8）を1から減じ100分の1未満を切り捨てた率として当社の定める率</td></tr>
<tr><td>売買参考統計値が発表されていないもののうち国内の金融商品取引所において上場されているもの</td><td>金融商品取引所(注1)における最終価格(注2)</td></tr>
</table>

公社債投資信託の受益証券(注6)	一般社団法人投資信託協会が前日の時価を発表するもの	当該時価	100分の85
転換社債型新株予約権付社債券(注3)(注5)(注6) 交換社債券(注3)(注6)	国内の金融商品取引所に上場されているもの	金融商品取引所(注1)における最終価格(注2)	100分の80
株券 優先出資証券 外国株預託証券 外国投資信託の受益証券 外国投資証券 受益証券発行信託の受益証券 外国受益証券発行信託の受益証券	国内の金融商品取引所に上場されているもの	金融商品取引所(注1)における最終価格(注2)	100分の70
投資信託の受益証券(公社債投資信託の受益証券を除く。)	国内の金融商品取引所に上場されているもの	金融商品取引所(注1)における最終価格(注2)	
投資証券	一般社団法人投資信託協会が前日の時価を発表するもの(注6)	当該時価	
倉荷証券(注7)	株式会社大阪取引所が定めるところにより、取	最初に取引最終日が到来する限月取引に係る清	100分の70

	引の決済のための受渡しの目的物とすることができる物品の保管を証するもの	算値段	

(注)

1. 複数の金融商品取引所に上場している銘柄については、当社が定める順位により選択した金融商品取引所とする。
2. 最終価格については、当該金融商品取引所において気配表示が行われている場合は当該最終気配値段をいう。
3. 発行に際して元引受契約が金融商品取引業者により締結されたものに限る。
4. 特殊債券(政府保証債券を除く。)、社債券(新株予約権付社債券及び交換社債券を除く。)及び円貨建外国債券(金融商品取引法施行令第2条の11に定める債券である円貨債券、転換社債型新株予約権付社債券及び交換社債券を除く。)については、適格格付機関(法第2条第36項に規定する信用格付業者及び金融商品取引業等に関する内閣府令(平成19年内閣府令第52号)第116条の3第2項に規定する特定関係法人をいう。)から取得している格付が全てA格相当以上であること等、発行企業の信用力その他の事情を勘案して、当社が適当と認めるものに限る。
5. 転換社債型新株予約権付社債券については、国内の金融商品取引所にその株券が上場されている会社が発行するものに限る。
6. 清算参加者の自己の取引証拠金及びアフィリエイトの取引証拠金に対する代用有価証券等の範囲から除く。
7. 貴金属に係るもの以外の倉荷証券は、清算参加者の自己の取引証拠金及びアフィリエイトの取引証拠金に対する代用有価証券等の範囲から除く。
8. 99%カバー最小値とは、対象となる数値について、一の数値以下の数値の個数が、対象となるすべての数値の個数の100分の99以上となる場合の当該数値のうち最小の数値をいう。

3　前項の規定における当社が定める順位は、第一順位は、当該差入日又は預託日の前々日が毎年2月から7月までの間は前年7月から12月までの、当該差入日又は預託日の前々日が毎年8月から翌年1月までの間は1月から6月までの間における各金融商品取引所において成立した当該銘柄の売買高(売買立会により成立した普通取引(各金融商品取引所の定める普通取引をいう。)に係るものに限る。)の最も多い金融商品取引所とし、それ以降は、取引所・業界団体等コード(証券コード協議会の定めるものをいう。)の順序とする。

別表２

業務方法書第46条の3及び第46条の4に規定する各区分口座の担保超過リスク額の算出に関する表

業務方法書第46条の3及び第46条の4に規定する各区分口座の担保超過リスク額は、算出時点において、一の区分口座における顧客の委託若しくは非清算参加者の有価証券等清算取次ぎの委託に基づく建玉のそれぞれについて、次の計算式により算出される額とする。なお、計算式における用語の意義は、次のａからｃまでに定めるとおりとする。

担保超過リスク額
＝一の区分口座におけるリスク再計算額＋一の区分口座における先物取引差金相当額及びオプション取引代金相当額－一の区分口座における取引証拠金預託額

ａ　一の区分口座におけるリスク再計算額とは、区分口座ごとに次の計算式により算出される額とする。

(a)　一の区分口座が業務方法書第46条の3第2号b、同条第3号b、第46条の4第1号又は同条第2号bに規定する区分口座の場合の計算式
一の区分口座におけるリスク再計算額
＝一の区分口座における想定損失相当額－一の区分口座におけるネット・オプション価値の総額
（注1）　一の区分口座における想定損失相当額とは、算出時点における先物・オプション取引に係る一の区分口座の計算による建玉（その取引日にクロスマージンの申請の対象となった建玉を除く。）について想定される損失相当額として、当社が定める方法により計算した額をいう。
（注2）　一の区分口座におけるネット・オプション価値の総額とは、算出時点における一の区分口座における買オプション価値の総額から一の区分口座における売オプション価値の総額を差し引いて得た額をいう。

(b)　一の区分口座が業務方法書第46条の3第2号a、同条第3号a又は第46条の4第2号aに規定する区分口座の場合の計算式
一の区分口座におけるリスク再計算額
＝前取引日通知取引証拠金所要額＋リスク変動相当額
（注1）前取引日通知取引証拠金所要額とは、第24条の2第2項の規定に基づき前取引日に当社が清算参加者に対して一の区分口座の取引証拠金所要額として通知した額をいう。
（注2）リスク変動相当額とは、算出時点におけるａの(a)の規定に基づき算出した一の区分口座における想定損失相当額から前取引日においてａの(a)の規

定に基づき算出した一の区分口座における想定損失相当額を減じて得た額をいう。ただし、当該額が負となる場合には、当該額は零とする。

b　一の区分口座における先物取引差金相当額及びオプション取引代金相当額とは、算出時点の一の区分口座における各取引に係る先物取引差金相当額及びオプション取引代金相当額をいう。

c　一の区分口座における取引証拠金預託額とは、算出時点で一の区分口座の取引証拠金として預託されている金銭の額及び有価証券等の時価評価額の合計額

別表３

取引受渡証拠金所要額の算出に関する表

1. 貴金属に係る取引受渡証拠金所要額

(1)　申告受渡を行う場合の貴金属に係る取引受渡証拠金所要額は、次に定める計算式により算出される額とする。

貴金属に係る取引受渡証拠金所要額
＝受渡値段×受渡単位の倍率×10/100

(2)　前号に定める取引受渡証拠金は、申告受渡が成立した日から申告受渡日まで算出するものとする。

2. ゴムに係る取引受渡証拠金所要額

(1)　受渡し(RSS は申告受渡に限る。)を行う場合のゴムに係る取引受渡証拠金所要額は、次に定める計算式により算出される額とする。

ゴムに係る取引受渡証拠金所要額
＝受渡値段×受渡単位の倍率×10/100

(2)　前号に定める取引受渡証拠金は、次に定める期間算出するものとする。

a　RSS
申告受渡が成立した日から申告受渡日まで

b　TSR

(a)　本受渡による受渡しにあっては、直近の限月取引の取引最終日から故障申立に係る申出期限の日まで

(b)　申告受渡による受渡しにあっては、申告受渡が成立した日から申告受渡日まで

(c)　受渡条件調整による受渡しにあっては、直近の限月取引の取引最終日から受渡決済期日まで

(d)　ADP による受渡しにあっては、直近の限月取引の取引最終日から当社が ADP に係る申出を承認した日まで

3. 農産物に係る取引受渡証拠金所要額

(1)　一般大豆及びとうもろこしの受渡しを行う場合の農産物に係る取引受渡証拠金所要額は、次に定める計算式により算出される額とする。

農産物に係る取引受渡証拠金所要額

＝受渡値段×受渡単位の倍率×5/100

(2)　前号に定める取引受渡証拠金は、次に定める期間算出するものとする。

a　一般大豆

直近の限月取引の取引最終日(早受渡し及び申告受渡にあっては当該成立日)から業務方法書第 73 条の 31 の 41 に定める受渡品検品の請求の提出期限が経過した日、又は受渡品検品の請求による値引金額の調整が終了した日のいずれか遅い日(ADP による受渡しにあっては、当社が申出を承認した日)まで

b　とうもろこし

直近の限月取引の取引最終日(早受渡しにあっては当該成立日)から業務方法書第 73 条の 31 の 53 に定める受渡品の重量による調整が終了した日(ADP による受渡しにあっては、当社が申出を承認した日)まで