

株価指数証拠金取引に係る取引参加者及び清算参加者の要件に関する制度要綱(案)

平成 22 年 5 月 24 日
株式会社東京金融取引所

項 目	内 容	備 考
<p>1. 趣旨</p> <p>(1) 株価指数証拠金取引参加者</p> <p>(2) 株価指数証拠金清算参加者</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・本取引所は、株価指数証拠金取引の上場に伴い、これに係る取引資格及び清算資格を新たに設ける。 ・国内に営業所等を有する者を対象とする、株価指数証拠金取引を行うための取引資格を株価指数証拠金取引資格といい、これを有する取引参加者を株価指数証拠金取引参加者という。 ・国内に営業所等を有しない者を対象とする、株価指数証拠金取引を行うための取引資格を株価指数証拠金遠隔地取引資格といい、これを有する取引参加者を株価指数証拠金遠隔地取引参加者という。株価指数証拠金遠隔地取引参加者は、日本国内に所在する顧客から、株価指数証拠金取引の委託を受けることはできない。 ・株価指数証拠金取引について本取引所が行う金融商品債務引受業の相手方となるための資格を株価指数証拠金清算資格といい、これを有する清算参加者を株価指数証拠金清算参加者という。 ・株価指数証拠金清算資格は、その効力により次の2つに区分される。 <ul style="list-style-type: none"> ①他社清算資格：自己の呼び値による株価指数証拠金取引（顧客からの受託取引を含む）と、他の株価指数証拠金取引参加者が行った株価指数証拠金取引について清算を行うことができる。 ②自社清算資格：自己の呼び値による株価指数証拠金取引（顧客からの受託取引を含む）についてのみ、清算を行うことができる。 ・本取引所が他の株価指数証拠金取引参加者及び株価指数証拠金清算参加者の名において成立した株価指数証拠金取引に基づく債務を引き受けることにより、本取引所に損失が生じた場合は、株価指数証拠金清算参加者は、当該損失の全部又は一部を負担する。 	<ul style="list-style-type: none"> ・既に本取引所の取引参加者であっても、株価指数証拠金取引を行うには、別に株価指数証拠金取引資格を有しなければならない。 ・既に本取引所の清算参加者であっても、株価指数証拠金取引について本取引所が行う金融商品債務引受業の相手方となるには、別に株価指数証拠金清算資格を有しなければならない。

項 目	内 容	備 考
<p>2. 株価指数証拠金取引参加者の要件</p> <p>(1) 拠点</p> <p>(2) 人的構成</p> <p>(3) 財産的基礎</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・ 株価指数証拠金取引参加者は、(1)から(3)までの要件を満たさなければならない。 ・ 日本国内に本取引所における取引を行う営業所又は事業所を有すること。 ・ イからハまでの要件を満たすこと。 <ul style="list-style-type: none"> イ 有価証券関連業を行う第一種金融商品取引業者又は取引所取引許可業者であること。 ロ その人的構成に照らして、株価指数証拠金取引参加者としての業務を遂行できる知識および能力を有し、かつ十分な社会的信用を有すること。 ハ (金融商品取引業者のみ) 投資者保護基金に加入していること。 ・ イからニまでの要件を満たすこと。 <ul style="list-style-type: none"> イ 資本金の額が3億円以上であること。 ロ 純資産額が資本金の額以上であること。 ハ 自己資本規制比率が200パーセント以上であること。 ニ 安定的収益が見込める収支状況であること。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 金融商品取引法の定めによる。
<p>3. 株価指数証拠金遠隔地取引参加者の要件</p> <p>(1) 拠点</p> <p>(2) 人的構成</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・ 株価指数証拠金遠隔地取引参加者は、(1)から(4)までの要件を満たさなければならない。 ・ 本取引所が適当と認める国に、本取引所における取引を行う営業所等を有すること。 ・ 日本国内に、本取引所における取引を行う営業所又は事業所を有しないこと。 ・ イ及びロの要件を満たすこと。 <ul style="list-style-type: none"> イ 取引所取引許可業者であること。 ロ その人的構成に照らして、株価指数証拠金遠隔地取引参加者としての業務を遂行できる知識および能力を有し、かつ十分な社会的信用を有す 	

項目	内容	備考
<p>(3) 財産的基礎</p> <p>(4) 受託取引を行う場合の要件</p>	<p>ること。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・イからニまでの要件を満たすこと。 <ul style="list-style-type: none"> イ 資本金の額が3億円以上であること。 ロ 純資産額が資本金の額以上であること。 ハ 自己資本規制比率が200パーセント以上であること。 ニ 安定的収益が見込める収支状況であること。 ・株価指数証拠金遠隔地取引参加者が、特定の営業所等において顧客から取引を受託する場合は、イ又はロの要件のいずれかを満たすこと。 <ul style="list-style-type: none"> イ その所在する国の規制当局が定める手続を行っていること。 ロ その所在する国にある自主規制機関に加入していること。 	
<p>4. 株価指数証拠金清算参加者の要件</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・株価指数証拠金清算参加者は、(1)から(3)までの要件を満たさなければならない。 	
<p>(1) 拠点</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・日本国内に本取引所における株価指数証拠金取引に係る清算業務を行うための営業所又は事業所を有すること。 	
<p>(2) 人的構成</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・イ及びロの要件を満たすこと。 <ul style="list-style-type: none"> イ 第一種金融商品取引業者又は登録金融機関であること。 ロ その人的構成に照らして、株価指数証拠金清算参加者としての業務を遂行できる知識および能力を有し、かつ十分な社会的信用を有すること。 	<ul style="list-style-type: none"> ・登録金融機関については、株価指数証拠金取引資格を有することができないため、他社清算資格を有することを前提とする。
<p>(3) 財産的基礎</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・他社清算資格を有する場合は、イ又はロのいずれかに該当すること。 <ul style="list-style-type: none"> イ a から d までの要件を満たすこと。 <ul style="list-style-type: none"> a 資本金の額、出資の総額又は基金の総額が3億円以上であること。 b 純資産額が200億円以上であること。 c 金融商品取引業者にあつては自己資本規制比率が200パーセント以上、保険会社以外の登録金融機関にあつては自己資本比率が8パーセ 	<ul style="list-style-type: none"> ・保険会社以外の登録金融機関の自己資本比率は、海外事業拠点を有するものは8パーセン

項目	内容	備考
	<p>ント又は4パーセント以上、保険会社にあつてはソルベンシーマージン比率が400パーセント以上であること。</p> <p>d 安定的収益が見込める収支状況であること。</p> <p>ロ aからeまでの要件を満たすこと。</p> <p>a 資本金の額、出資の総額又は基金の総額が3億円以上であること。</p> <p>b 純資産額が10億円以上200億円未満であること。</p> <p>c 金融商品取引業者にあつては自己資本規制比率が200パーセント以上、保険会社以外の登録金融機関にあつては自己資本比率が8パーセント又は4パーセント以上、保険会社にあつてはソルベンシーマージン比率が400パーセント以上であること。</p> <p>d 安定的収益が見込める収支状況であること。</p> <p>e a及びdを満たす、純資産額が200億円以上の親会社による保証を受けること。</p> <p>・ 自社清算資格を有する場合は、ハ又はニのいずれかに該当すること。</p> <p>ハ aからdまでの要件を満たすこと。</p> <p>a 資本金の額が3億円以上であること。</p> <p>b 純資産額が20億円以上であること。</p> <p>c 自己資本規制比率が200パーセント以上であること。</p> <p>d 安定的収益が見込める収支状況であること。</p> <p>ニ aからeまでの要件を満たすこと。</p> <p>a 資本金の額が3億円以上であること。</p> <p>b 純資産額が20億円未満であること。</p> <p>c 自己資本規制比率が200パーセント以上であること。</p> <p>d 安定的収益が見込める収支状況であること。</p> <p>e a及びdを満たす、純資産額が30億円以上の親会社による保証を受けること。</p>	<p>ト以上、海外事業拠点を有しないものは4パーセント以上であることが必要。</p> <p>・ 登録金融機関が自社清算資格を有することを想定していないため、自己資本比率についての規制はない。</p>

項 目	内 容	備 考
<p>5. 信認金</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・ 株価指数証拠金取引参加者は、本取引所に対し信認金を預託しなければならない。 ・ 信認金の額は、株価指数証拠金取引参加者が自己取引を行うか、受託取引を行うかにかかわらず、300 万円とする。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 金利先物等取引参加者及び為替証拠金取引参加者として預託する信認金とは別に、預託しなければならない。 ・ 信認金は、本取引所が定めるところにより、有価証券をもって預託することができる。
<p>6. 清算預託金</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・ 株価指数証拠金清算参加者は、本取引所に対し清算預託金を預託しなければならない。 ・ 清算預託金の額は、本取引所が別に定めるところによる。ただし、清算預託金の最低額は 500 万円とする。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 金利先物等清算参加者及び為替証拠金清算参加者として預託する清算預託金とは別に、預託しなければならない。 ・ 清算預託金は、本取引所が定めるところにより、有価証券をもって預託することができる。

以 上