

## 証拠金及び未決済取引の引継ぎ等に関する規則の施行規則

### (目的)

第1条 この規則は、金利先物等取引及び清算建玉に関する証拠金及び未決済取引の引継ぎ等に関する規則（以下「証拠金規則」という。）に基づき、本取引所が定める事項及び本取引所が指定する事項を規定する。

(平成17年7月1日、平成19年9月30日 変更)

### (取引証拠金の預託方法)

第2条 証拠金規則第6条第1項の規定により、清算参加者が取引証拠金を預託するときは、本取引所が「取引証拠金口」預金口座を開設した金融機関の当該預金口座へ、次の各号に定める方法のいずれかにより入金するものとする。

- (1) 口座振替による振込。
- (2) 電信扱いによる振込。
- (3) 現金通貨による振込。
- (4) 日本銀行を支払人として銀行が振り出した小切手による振込。

2 前項の規定にかかわらず、有価証券を取引証拠金に代用するときは、有価証券の種類に応じ、次の各号に定める方法により預託するものとする。

- (1) 証拠金規則別表第1第1項及び別表第2第2項に規定する国債証券  
日本銀行に開設された本取引所名義の口座への振替により行うものとする。この場合において、振替停止期間中は振込国債の返戻の請求は行わないものとする。
- (2) 証拠金規則別表第1第2項及び別表第2第2項に規定する株券  
株式会社証券保管振替機構に開設された本取引所名義の口座への振替により行うものとする。

(平成19年9月30日、平成20年6月2日、平成21年9月28日、平成29年7月3日 変更)

### (取引証拠金に関する事項)

第3条 証拠金規則第7条第5項及び証拠金規則第27条第4項の規定により、証拠金に充てることができる有価証券に関し本取引所が定める事項は、次の各号に定める事項とする。

#### (1) 端数金額の調整

証拠金規則別表第1及び別表第2に掲げる有価証券について、時価又は元本額に同表に掲げる率を乗じた場合の端数金額の調整は、次のとおりとする。

イ 証拠金規則別表第1第1項及び別表第2第1項の日本国が発行する国債証券については、銭位未満の端数金額を切り捨てる。

- ロ 証拠金規則別表第1第2項及び別表第2第2項の株券については、円位未満の端数金額を切り捨てる。
- (2) 代用有価証券からの除外
  - 証拠金規則別表第1第2項及び別表第2第2項の株券が上場されている国内のすべての金融商品取引所において、当該金融商品取引所の定める上場廃止の基準に該当した場合（次のイからハまでに掲げる場合を除く。）は、該当した日の翌営業日から、当該株券を代用有価証券から除外する。
  - イ 当該株券の発行者が、株式交換又は株式移転により国内の取引所金融商品市場に株券が上場されている会社（以下「上場会社という。」）の完全子会社となる場合
  - ロ 当該株券の発行者が上場会社に吸収合併される場合
  - ハ その他当該株券が上場廃止となる場合であって当該株券と引換えに交付される株券が国内の取引所金融商品市場に速やかに上場される見込みがあるとき
- (3) 代用有価証券の評価替及び追加預託
  - すでに預託されている代用有価証券について、代用有価証券の前営業日（当該営業日が国内の金融商品取引所の休業日に当たるときは、順次繰り上げる。）の時価に基づいて各営業日の日中取引時間帯終了後にその代用価格を計算した結果、取引証拠金に不足を生じた清算参加者は、当該不足を生じた日の翌営業日の午前11時00分までに、不足額に相当する額以上の金銭又は有価証券を取引証拠金として本取引所に預託しなければならない。

（平成17年7月1日、平成17年12月20日、平成19年9月30日、平成20年6月2日、平成21年9月28日、平成29年7月3日 変更）

#### （代用有価証券の所有者）

第3条の2 顧客及び清算参加者は、自身が実質的な所有者である有価証券のみを代用有価証券とすることができる。

（平成20年6月2日 追加）

#### 第3条の3 （削除）

（平成20年6月2日 追加、平成29年7月3日削除）

#### （証拠金等の資料に関する事項）

第4条 証拠金規則第6条第5項に定める資料は、証拠金等元帳又は本取引所が必要と認めるものとし、本取引所から請求があった場合は、速やかに本取引所宛に提出するものとする。

### (関連会社の定義)

第5条 証拠金規則第6条第3項第5号に定める関連会社とは、次の各号に定める法人とする。

- (1) 清算参加者の議決権の過半数を実質的に所有している法人
  - (2) 清算参加者が議決権の過半数を実質的に所有している法人
  - (3) 清算参加者からみて第1号の立場にある法人が、清算参加者又は非清算参加者以外の第2号に規定する法人を持つ場合の当該法人
  - (4) 清算参加者が議決権の20%以上50%以下を実質的に所有し又は所有され、かつ人事、資金、技術、取引等の関係を通じて、財務及び事業の方針の決定に対して重要な影響を与えることができる又は重大な影響を受けている法人
- 2 前項各号に定めるもののほか、清算参加者は、必要があると認めるときは、関連会社を定めることができる。

(平成18年7月3日 変更)

### (委託証拠金の管理方法)

第6条 証拠金規則第11条第2項に定める管理は、委託証拠金であることを明示した名義により次の各号に掲げる方法で行うものとする。

- (1) 金融商品取引業等に関する内閣府令（次号及び次条において「業府令」という。）第143条第1項第2号イに規定する金融機関への預金
  - (2) 業府令第143条第1項第2号ロに規定する信託会社又は信託業務を営む銀行への金銭信託
- 2 前項の規定にかかわらず、取引参加者が円金利先物遠隔地取引参加者である場合は、証拠金規則第11条第2項に定める管理を、本取引所が認める方法により行うものとする。
- 3 取引参加者が第1項第1号に規定する金融機関である場合には、自行の別段預金で管理することも可能とする。

(平成17年7月1日、平成19年9月30日、平成20年12月1日、平成21年6月1日、平成29年8月31日、2023年3月20日 変更)

### (代用有価証券の預託時の届出)

第7条 証拠金規則別表第1第2項に規定する有価証券を預託する取引参加者は、その預託の時に、次の各号に掲げる区分に応じて、当該各号に定める書類を本取引所に提出しなければならない。

- (1) 第一種金融商品取引業を行う金融商品取引業者である取引参加者  
業府令第173条第1号に規定する報告書
- (2) 登録金融機関である取引参加者  
業府令第188条第1号に規定する報告書

- (3) 第一種金融商品取引業を行わない金融商品取引業者である取引参加者  
前2号に規定する報告書のいずれか又はこれらに準ずる書類

(平成20年12月1日、平成21年9月28日、平成29年7月3日 変更)

### (オプション価値の調整方法)

第8条 証拠金規則第2条第1項第6号に定める取引証拠金所要額又は非清算参加者証拠金を算出するためのオプション価値の調整方法については、次の各号に掲げる額を合算した額が正の数となるときはその額をSPAN証拠金額から差し引き、負の数となるときはその絶対値の額をSPAN証拠金額に加算するものとする。

- (1) 円金利先物オプションに関する業務規程及び受託契約準則の特例（以下「オプション特例」という。）に定める売建玉を清算値段で評価した額は、次の算式を銘柄ごとに合計した額とする。

$$-2,500 \text{ 円} \times \text{当日の清算値段} / 0.01 \times \text{取引数量}$$

- (2) オプション特例に定める買建玉を清算値段で評価した額は、次の算式を銘柄ごとに合計した額とする。

$$2,500 \text{ 円} \times \text{当日の清算値段} / 0.01 \times \text{取引数量}$$

2 前項においてオプション価値を計算するときは、自己の計算による建玉又は他の者の計算による建玉ごとに行い、合算後、千円に満たない端数金額があるときは、これを切り捨てるものとする。ただし、オプション価値が負の数となるときは、その絶対値を切り上げるものとする。

(平成17年7月1日、2023年3月20日 変更)

### (代用有価証券に関する制限)

第9条 本取引所は、著しい相場の変動が発生する等、証拠金規則の規定により代用有価証券を評価し、又は受け入れることが適当でないと認められる場合その他本取引所が必要と認める場合は、次に掲げる措置その他必要と認める措置をとることができる。

- (1) 証拠金規則別表第1及び別表第2に規定する時価に乗じる率の引下げ
- (2) 特定の有価証券についての、代用有価証券としての受入れの制限
- (3) 有価証券による証拠金の代用の制限

(平成17年12月20日、平成20年12月1日 変更)

### (一時管理分に係る申告時限)

第10条 証拠金規則第8条第2項の規定により、本取引所が定める時刻は、一時管理分に係る市場デリバティブ取引が成立又は清算建玉が発生した取引日の日中取引時間帯終了後に開始される夜間取引時間帯終了時（夜間取引時間帯における付合せを行わないときは当該日中取

引時間帯終了時)の30分後とする。

(平成19年9月30日 変更)

### (緊急時清算価格の決定方法等)

第11条 限月取引ごとの証拠金規則第17条第2項に規定する緊急時清算価格は、次の各号に定める方法により決定する。

- (1) 午前11時30分までの日中取引時間帯終了前の時間帯の本取引所がその都度必要と認める時間帯(以下「緊急時算出基準時間帯」という。)においてオークション方式により成立した市場デリバティブ取引の約定価格と取引数量(ストラテジー取引により成立した市場デリバティブ取引の約定価格及び取引数量を除く。次号において、約定価格について同じ。)の加重平均により算出した価格とする。
- (2) 前号に規定する緊急時算出基準時間帯に限月取引の約定価格がない場合には、当該取引日の前取引日における当該限月取引の清算価格と直近の限月取引の清算価格との差を当該取引日の直近の限月取引の緊急時清算価格に反映させて算出した価格とする。
- (3) 前2号にかかわらず、第1号の方法により算出した価格が適正でないと判断した場合又は前号における価格が算出できない場合は、本取引所は市場実勢その他の事由を勘案し、適正と認める緊急時清算価格を決定するものとする。

2 オプション特例に定める銘柄ごとの証拠金規則第17条第2項に規定する緊急時清算価格は、次の各号に定める方法により決定する。

- (1) オプション特例に定める別表「オプション理論価格算出式」に定める方法によって理論価格として算出した数値とする。
- (2) 前号における数値が算出できない場合又は前号に規定する方法により算出した理論価格が適正でないと判断した場合は、本取引所は適正と認める緊急時清算価格を決定するものとする。

(平成17年7月1日、平成19年9月30日、平成23年12月1日 変更)

第12条から第13条まで (削除)

(平成17年12月20日 変更)

## 附則

この規則は、平成16年4月1日から施行する。

**附則**

この変更規則は、平成 17 年 7 月 1 日から施行する。

**附則**

この変更規則は、平成 17 年 12 月 20 日から施行する。

**附則**

この変更規則は、平成 18 年 7 月 3 日から施行する。

**附則**

この改正規定は、平成 19 年 9 月 30 日から施行する。

**附則**

- 1 この改正規定は、平成 20 年 6 月 2 日から施行する。
- 2 この改正規定の施行の際現に有価証券を本取引所に持参する方法により預託している清算参加者は、本取引所が定める日までに、当該有価証券の返戻を受けなければならない。

**附則**

この改正規定は、平成 20 年 12 月 1 日から施行する。

**附則**

この改正規定は、平成 21 年 6 月 1 日から施行する。

**附則**

この改正規定は、平成 21 年 9 月 28 日から施行する。

**附則**

この変更規則は、平成 23 年 12 月 1 日から施行する。

**附則**

この変更規則は、平成 29 年 7 月 3 日から施行する。

**附則**

この変更規則は、平成 29 年 8 月 31 日から施行する。

**附則**

この変更規則は、2023 年 3 月 20 日から施行する。