

## 第1章 総則

(平成16年4月1日 追加)

### (目的)

第1条 この業務方法書は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号。以下「法」という。）第156条の7の規定に基づき、本取引所が行う金融商品債務引受業及びこれに付帯する業務の方法について基本的な事項を定め、その業務の適正な運営に資することを目的とする。

(平成16年4月1日、平成17年7月1日、平成19年9月30日、平成29年6月9日 変更)

### (債務の起因となる取引)

第2条 本取引所の金融商品債務引受業の対象とする債務の起因となる取引は、次の各号に掲げる取引とする。

- (1) 本取引所の開設する金融商品市場における市場デリバティブ取引
- (2) 外国金融商品市場を開設する外国に所在する取引所で、業務規程第2条第3号に定める提携外国取引所の開設する外国金融商品市場における提携外国取引所で行われる市場デリバティブ取引と類似の取引のうち、本取引所が別に定める金融指標と同一の指標に基づくもの（以下「提携市場デリバティブ取引」という。）

(平成16年4月1日、平成19年9月30日 変更)

### (取引所為替証拠金取引及び取引所株価指数証拠金取引に係る債務引受業に関する適用除外)

第2条の2 前条第1号に規定する市場デリバティブ取引が取引所為替証拠金取引であるときは、第4章第2節及び第3節、第10章から第12章まで、第13章の2、第14章並びに清算建玉及びギブアップ制度を前提とする規定は適用しないものとする。

2 前条第1号に規定する市場デリバティブ取引が取引所株価指数証拠金取引のときは、この規則のうち第4章第2節及び第3節、第10章から第13章まで、第14章並びに清算建玉及びギブアップ制度を前提とする規定は適用しないものとする。

(平成17年7月1日 追加、平成19年9月30日、平成22年10月1日、平成29年2月27日 変更)

## 第2章 清算参加者の要件

(平成16年4月1日 追加)

## 第1節 総則

(平成16年4月1日 追加)

### (清算参加者)

第3条 清算参加者とは、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（以下「清算資格」という。）を有する者をいう。

- 2 前項に規定する清算資格は、金利先物等清算資格及び証拠金清算資格の2種類とし、それぞれ次の各号に定めるものとする。
  - (1) 金利先物等清算資格とは、取引参加者規程第2条第10項に規定する金利先物等取引及び業務規程第2条第7号に規定する清算建玉に係る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いう。
  - (2) 証拠金清算資格とは、取引参加者規程第2条第10項に規定する取引所為替証拠金取引又は取引所株価指数証拠金取引に係る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いう。
- 3 金利先物等清算資格を有する者を金利先物等清算参加者、証拠金清算資格を有する者を証拠金清算参加者という。
- 4 清算参加者は、自己の有していない取引資格に係る市場デリバティブ取引について、本取引所の金融商品債務引受業の相手方となることはできない。ただし、ユーロ円先物取引資格を有する金利先物等清算参加者は、ユーロ円先物遠隔地取引資格に係る市場デリバティブ取引について、登録金融機関である証拠金他社清算参加者（第5条第6項に規定する「証拠金他社清算参加者」をいう。）は、株価指数証拠金取引資格に係る取引所株価指数証拠金取引について、証拠金清算参加者は、株価指数証拠金遠隔地取引資格に係る取引所株価指数証拠金取引について、それぞれ本取引所の金融商品債務引受業の相手方となることができる。
- 5 本取引所の市場デリバティブ取引に係る取引参加者であって、当該取引資格に係る清算資格を有していない者を非清算参加者という。
- 6 特定の非清算参加者との間で清算委託契約を締結し、当該非清算参加者が行った市場デリバティブ取引について清算を行う清算参加者を指定清算参加者という。

(平成16年4月1日 追加、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4月28日、平成20年10月27日、平成22年10月1日、平成23年8月1日、平成29年2月27日 変更)

## 第2節 清算資格の取得

(平成 16 年 4 月 1 日 追加)

### **(清算資格の取得申請及び承認)**

第 4 条 清算資格を取得しようとする者（以下「清算資格取得申請者」という。）は、本取引所が定めるところにより、本取引所に清算資格の取得の申請を行わなければならない。

- 2 前項の申請があった場合、本取引所は、第 5 条に規定する清算参加者の要件及びその他金融商品債務引受業の運営に関して必要と認める事項について審査を行い適当であると認めるときに、清算資格の取得の承認を行う。
- 3 第 1 項の規定にかかわらず、特定承継金融機関等（預金保険法（昭和 46 年法律第 34 号）第 126 条の 34 第 3 項第 5 号に規定する特定承継金融機関等をいう。以下同じ。）である清算資格取得申請者は、本取引所が定めるところにより、本取引所に清算資格の取得の申請を行うことができる。この場合において、本取引所は、当該清算資格取得申請者に対する清算資格の取得の承認を行うことができる。
- 4 本取引所が第 2 項の規定により清算資格の取得を承認したときは、本取引所が指定した期日までに、清算資格取得申請者は、清算資格取得料の払込み、清算預託金の預託その他本取引所が定める清算資格取得手続を履行しなければならない。
- 5 本取引所が第 3 項の規定により清算資格の取得を承認したときは、本取引所が指定した期日までに、清算資格取得申請者は、清算預託金の預託、その他本取引所が定める清算資格取得手続を履行しなければならない。
- 6 清算資格取得申請者が第 4 項又は第 5 項に定める手続を期日までに履行しないときは、その清算資格の取得申請を取り下げたものとみなす。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 17 年 7 月 1 日、平成 19 年 9 月 30 日、平成 20 年 7 月 14 日、平成 22 年 10 月 1 日、平成 26 年 3 月 6 日、平成 29 年 2 月 27 日 変更)

### **(清算参加者の要件)**

第 5 条 金利先物等清算参加者は第 2 項から第 5 項までに定める金利先物等清算参加者の要件のうちいずれかを満たさなければならない。

- 2 以下の各号に定めるすべての要件を満たすこと。

- (1) 拠点

日本国内に、本取引所の市場における市場デリバティブ取引を行うための営業所又は事務所を有すること

- (2) 取引資格

少なくとも 1 種類の金利先物等取引に係る取引資格を取得すること、又は既に取得していること

- (3) 人的構成

- イ 金融商品取引業者（法第 2 条第 9 項に規定する金融商品取引業者をいう。以下同じ。）であって、業務の種別として第二種金融商品取引業（ただし、顧客の委託を受けて市場デリバティブ取引を行う場合は、第二種金融商品取引業及び有価証券等管理業務）の登録を受けている法人又は登録金融機関（法第 2 条第 11 項に規定する登録金融機関をいう。以下同じ。）であること。
  - ロ その人的構成に照らして、金利先物等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
- (4) 財産的基礎
- イ 純資産額が 500 億円以上
  - ロ 純資産倍率が 1 倍程度以上
  - ハ 収支状況において安定的収益が見込めること
- 3 以下の各号に定めるすべての要件を満たすこと。
- (1) 拠点
- 日本国内に、本取引所の市場における市場デリバティブ取引を行うための営業所又は事務所を有すること
- (2) 取引資格
- 少なくとも 1 種類の金利先物等取引に係る取引資格を取得すること、又は既に取得していること
- (3) 人的構成
- イ 金融商品取引業者であって、業務の種別として第二種金融商品取引業（ただし、顧客の委託を受けて市場デリバティブ取引を行う場合は、第二種金融商品取引業及び有価証券等管理業務）の登録を受けている法人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、金利先物等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
- (4) 財産的基礎
- イ 清算資格取得申請者の総株主の議決権の過半数を有する法人（以下「親会社」という。）が前項第 4 号に掲げるすべての要件を満たすこと
  - ロ 純資産額が 50 億円以上 500 億円未満
  - ハ 純資産倍率が 1 倍程度以上
  - ニ 収支状況において安定的収益が見込めること
  - ホ 当該清算資格取得申請者の親会社による保証を受けること
- 4 以下の各号に定めるすべての要件を満たすこと。
- (1) 拠点
- 日本国内に、本取引所の市場における市場デリバティブ取引を行うための営業所又は事務所を有すること
- (2) 取引資格
- 少なくとも 1 種類の金利先物等取引に係る取引資格を取得すること、又は既に取得していること

(3) 人的構成

ただし、清算資格取得申請者が新設法人の場合は、ハの要件は適用しない。

- イ 金融商品取引業者であって、業務の種別として第二種金融商品取引業（ただし、顧客の委託を受けて市場デリバティブ取引を行う場合は、第二種金融商品取引業及び有価証券等管理業務）の登録を受けている法人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、金利先物等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
- ハ 市場デリバティブ取引等を行っている取引所の清算会員又は清算参加者として市場デリバティブ取引等を継続的に3年以上行っており、かつ十分な取引数量があること
- ニ 市場デリバティブ取引等を行っている取引所の清算会員又は清算参加者の使用人として市場デリバティブ取引等の実務経験を3年以上有する者を、日本国内において常時複数名雇用していること

(4) 財産的基礎

- イ 清算資格取得申請者の親会社が一般的な金融業務に習熟しており、かつ第2項第4号に掲げるすべての要件を満たすこと
- ロ 純資産額が50億円以上
- ハ 純資産倍率が1倍程度以上
- ニ 収支状況において安定的収益が見込めること

5 以下の各号に定めるすべての要件を満たすこと。

(1) 拠点

日本国内に、本取引所の市場における市場デリバティブ取引を行うための営業所又は事務所を有すること

(2) 取引資格

少なくとも1種類の金利先物等取引に係る取引資格を取得すること、又は既に取得していること

(3) 人的構成

ただし、清算資格取得申請者が新設法人の場合は、ハの要件は適用しない。

- イ 金融商品取引業者であって、業務の種別として第二種金融商品取引業（ただし、顧客の委託を受けて市場デリバティブ取引を行う場合は、第二種金融商品取引業及び有価証券等管理業務）の登録を受けている法人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、金利先物等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
- ハ 市場デリバティブ取引等を行っている取引所の清算会員又は清算参加者として市場デリバティブ取引等を継続的に3年以上行っており、かつ十分な取引数量があること
- ニ 市場デリバティブ取引等を行っている取引所の清算会員又は清算参加者の使用人として市場デリバティブ取引等の実務経験を3年以上有する者を、日本国内において常時複数名雇用していること

(4) 財産的基礎

- イ 清算資格取得申請者の親会社が一般的な金融業務に習熟しており、かつ第2項第4号に掲げるすべての要件を満たすこと
  - ロ 純資産額が10億円以上50億円未満
  - ハ 純資産倍率が1倍程度以上
  - ニ 収支状況において安定的収益が見込めること
  - ホ 当該清算資格取得申請者の親会社による保証を受けること
- 6 証拠金清算資格の要件は、第3章に定めるところにより有価証券等清算取次ぎを行うことができる証拠金清算参加者（以下この項において「証拠金他社清算参加者」という。）と、有価証券等清算取次ぎを行うことができない証拠金清算参加者（以下この項において「証拠金自社清算参加者」という。）が満たすべき要件とに区分し、証拠金他社清算参加者は、次項又は第8項に定める証拠金清算参加者の要件のいずれかを満たされなければならない、証拠金自社清算参加者は、第9項又は第10項に定める証拠金清算参加者の要件のいずれかを満たされなければならない。
- 7 次に掲げるすべての要件を満たすこと。
- (1) 拠点  
日本国内に、本取引所の市場における市場デリバティブ取引に係る清算業務を行うための営業所又は事務所を有すること。
  - (2) 取引資格 清算業務を行う市場デリバティブ取引に係る取引資格（為替証拠金取引資格又は株価指数証拠金取引資格）を取得すること。ただし、株価指数証拠金取引資格の取得について、取引所株価指数証拠金取引に係る清算業務を行う登録金融機関にあつては、この限りでない。
  - (3) 人的構成
    - イ 取引所為替証拠金取引に係る清算業務を行う者にあつては、金融商品取引業者であつて業務の種別として第二種金融商品取引業（ただし、顧客の委託を受けて市場デリバティブ取引を行う場合は、第二種金融商品取引業及び有価証券等管理業務）の登録を受けている法人、又は登録金融機関であること。
    - ロ 取引所株価指数証拠金取引に係る清算業務を行う者にあつては、金融商品取引業者であつて業務の種別として第一種金融商品取引業の登録を受けている法人、又は登録金融機関であること。
    - ハ その人的構成に照らして、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。
  - (4) 財産的基礎
    - イ 資本金の額が3億円以上であること。
    - ロ 純資産額が200億円以上であること。
    - ハ 金融商品取引業者にあつては、法第46条の6第1項に規定する自己資本規制比率が200パーセント以上であること。
    - ニ 清算参加者として安定的な収益力が見込まれること。
    - ホ 特別金融商品取引業者（法第57条の2第2項に規定する特別金融商品取引業者のうち、

法第 57 条の 5 第 2 項の届出を行う者に限る。以下同じ。) にあつては、平成 22 年金融庁告示第 128 号第 2 条に規定する方法により算出される連結自己資本規制比率 (以下「川下連結に係る連結自己資本規制比率」という。) が 200 パーセント以上であること。

へ 対象特別金融商品取引業者 (法第 57 条の 12 第 3 項に規定する対象特別金融商品取引業者をいう。以下同じ。) にあつては、平成 22 年金融庁告示第 130 号第 2 条に規定する連結自己資本規制比率 (以下「国際統一基準に係る連結自己資本規制比率」という。) について同条第 1 号に規定する連結普通株式等 Tier1 比率 (以下「連結普通株式等 Tier1 比率」という。) が 4.5 パーセント以上、かつ、第 2 号に規定する連結 Tier1 比率 (以下「連結 Tier1 比率」という。) が 6 パーセント以上、かつ、第 3 号に規定する連結総自己資本規制比率 (以下「連結総自己資本規制比率」という。) が 8 パーセント以上であること、又は同告示第 4 条に規定する方法により算出される連結自己資本規制比率 (以下「川下連結の例による連結自己資本規制比率」という。) が 200 パーセント以上であること。

8 次に掲げるすべての要件を満たすこと。

(1) 日本国内に、本取引所の市場における市場デリバティブ取引に係る清算業務を行うための営業所又は事務所を有すること。

(2) 取引資格 清算業務を行う市場デリバティブ取引に係る取引資格 (為替証拠金取引資格又は株価指数証拠金取引資格) を取得すること。ただし、株価指数証拠金取引資格の取得について、取引所株価指数証拠金取引に係る清算業務を行う登録金融機関にあつては、この限りでない。

(3) 人的構成

イ 取引所為替証拠金取引に係る清算業務を行う者にあつては、金融商品取引業者であつて業務の種別として第二種金融商品取引業 (ただし、顧客の委託を受けて市場デリバティブ取引を行う場合は、第二種金融商品取引業及び有価証券等管理業務) の登録を受けている法人、又は登録金融機関であること。

ロ 取引所株価指数証拠金取引に係る清算業務を行う者にあつては、金融商品取引業者であつて業務の種別として第一種金融商品取引業の登録を受けている法人、又は登録金融機関であること。

ハ その人的構成に照らして、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。

(4) 財産的基礎

イ 資本金の額が 3 億円以上であること。

ロ 純資産額が 10 億円以上 200 億円未満であること。

ハ 法第 46 条の 6 第 1 項に規定する自己資本規制比率が 200 パーセント以上であること。

ニ 清算参加者として安定的な収益力が見込まれること。

ホ 特別金融商品取引業者にあつては、川下連結に係る連結自己資本規制比率が 200 パーセント以上であること。

へ 対象特別金融商品取引業者にあつては、国際統一基準に係る連結自己資本規制比率に

ついて連結普通株式等 Tier1 比率が 4.5 パーセント以上、かつ、連結 Tier1 比率が 6 パーセント以上、かつ、連結総自己資本規制比率が 8 パーセント以上であること、又は川下連結の例による連結自己資本規制比率が 200 パーセント以上であること。

ト イ、ハ及びホ又はへの要件を満たし、かつ、安定的な収益力が見込まれる純資産額が 200 億円以上の親会社による保証を受けること。

9 次に掲げるすべての要件を満たすこと。

(1) 日本国内に、本取引所の市場における市場デリバティブ取引に係る清算業務を行うための営業所又は事務所を有すること。

(2) 取引資格 清算業務を行う市場デリバティブ取引に係る取引資格（為替証拠金取引資格又は株価指数証拠金取引資格）を取得すること。

(3) 人的構成

イ 取引所為替証拠金取引に係る清算業務を行う者にあつては、業務の種別として第二種金融商品取引業（ただし、顧客の委託を受けて市場デリバティブ取引を行う場合は、第二種金融商品取引業及び有価証券等管理業務）の登録を受けている法人又は登録金融機関であること。

ロ 取引所株価指数証拠金取引に係る清算業務を行う者にあつては、金融商品取引業者であつて、業務の種別として第一種金融商品取引業の登録を受けている法人であること。

ハ その人的構成に照らして、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。

(4) 財産的基礎

イ 資本金の額が 3 億円以上であること。

ロ 純資産額が 20 億円以上であること（ただし、これを実質的に満たすものとして本取引所が特に認めた場合は、この限りでない。）。

ハ 法第 46 条の 6 第 1 項に規定する自己資本規制比率が 200 パーセント以上であること。

ニ 清算参加者として安定的な収益力が見込まれること。

ホ 特別金融商品取引業者にあつては、川下連結に係る連結自己資本規制比率が 200 パーセント以上であること。

ヘ 対象特別金融商品取引業者にあつては、国際統一基準に係る連結自己資本規制比率について連結普通株式等 Tier1 比率が 4.5 パーセント以上、かつ、連結 Tier1 比率が 6 パーセント以上、かつ、連結総自己資本規制比率が 8 パーセント以上であること、又は川下連結の例による連結自己資本規制比率が 200 パーセント以上であること。

10 純資産額が 20 億円未満であつて、次に掲げるすべての要件を満たすこと。

(1) 日本国内に、本取引所の市場における市場デリバティブ取引に係る清算業務を行うための営業所又は事務所を有すること。

(2) 取引資格 清算業務を行う市場デリバティブ取引に係る取引資格（為替証拠金取引資格又は株価指数証拠金取引資格）を取得すること。

(3) 人的構成

イ 取引所為替証拠金取引に係る清算業務を行う者にあつては、金融商品取引業者であつ



て業務の種別として第二種金融商品取引業（ただし、顧客の委託を受けて市場デリバティブ取引を行う場合は、第二種金融商品取引業及び有価証券等管理業務）の登録を受けている法人、又は登録金融機関であること。

- ロ 取引所株価指数証拠金取引に係る清算業務を行う者にあつては、金融商品取引業者であつて、業務の種別として第一種金融商品取引業の登録を受けている法人であること。
- ハ その人的構成に照らして、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。

(4) 財産的基礎

- イ 資本金の額が3億円以上であること。
- ロ (削除)
- ハ 法第46条の6第1項に規定する自己資本規制比率が200パーセント以上であること。
- ニ 清算参加者として安定的な収益力が見込まれること。
- ホ 特別金融商品取引業者にあつては、川下連結に係る連結自己資本規制比率が200パーセント以上であること。
- ヘ 対象特別金融商品取引業者にあつては、国際統一基準に係る連結自己資本規制比率について連結普通株式等Tier1比率が4.5パーセント以上、かつ、連結Tier1比率が6パーセント以上、かつ、連結総自己資本規制比率が8パーセント以上であること、又は川下連結の例による連結自己資本規制比率が200パーセント以上であること。
- ト イ、ハ及びホ又はへの要件を満たし、かつ、安定的な収益力が見込まれる純資産額が30億円以上の親会社による保証を受けること。

(平成16年4月1日 追加、平成17年7月1日、平成17年10月24日、平成17年12月20日、平成19年2月15日、平成19年9月30日、平成20年4月28日、平成20年7月14日、平成22年10月1日、平成23年6月1日、平成24年6月18日、平成25年3月31日、平成27年11月2日、平成29年2月27日 変更)

**(清算資格取得の日時)**

- 第6条 清算資格取得申請者が第4条第4項の規定による手続を期日までに履行したときは、本取引所が指定する日時に本取引所の清算資格を取得する。
- 2 特定承継金融機関等である清算資格取得申請者が第4条第5項の規定による手続のうち本取引所が指定するものを期日までに履行したときは、本取引所が指定する日時に本取引所の清算資格を取得する。
  - 3 本取引所は、清算資格取得申請者が前2項の規定により清算資格を取得したときは、その旨を以下の各号に定める者に通知する。
    - (1) 金利先物等清算資格の取得のとき  
すべての金利先物等清算参加者及び金利先物等取引に係る非清算参加者
    - (2) 証拠金清算資格の取得のとき  
すべての証拠金清算参加者並びに取引所為替証拠金取引及び取引所株価指数証拠金取引に係る非清算参加者

(平成16年4月1日 追加、平成17年7月1日、平成22年10月1日、平成26年3月6日、平成29年2月27日 変更)

#### **(非清算参加者が清算資格を取得した場合の未決済取引の取扱い)**

第7条 非清算参加者が前条第1項の規定により清算資格を取得して清算参加者となったときは、本取引所が指定する日時をもって、当該非清算参加者の本取引所の市場における自己のなした呼び値により成立した市場デリバティブ取引で未決済のものを取引参加者規程第1条の2第4号に定める指定清算参加者から当該非清算参加者に引き継がせるものとする。

(平成16年4月1日 追加、平成17年7月1日、平成19年9月30日、平成20年4月28日 変更)

### **第3節 清算参加者の義務等**

(平成16年4月1日 追加、平成25年3月11日 変更)

#### **(誓約書の差入れ)**

第8条 清算参加者は、本取引所に、本取引所の定める誓約書を差し入れなければならない。

(平成16年4月1日 追加)

#### **(清算参加者代表者)**

第9条 清算参加者は、その代表権を有する役員（清算参加者が外国の法令に準拠して設立された法人であるときは、会社法（平成17年法律第86号）第817条第1項に規定する日本における代表者で、かつ、役員と同等以上の地位にある者）のうちから、本取引所において当該清算参加者を代表するのに適当な者1人を、清算参加者代表者に定め、本取引所に届け出なければならない。

2 清算参加者と本取引所との関係においては、清算参加者代表者のみが当該清算参加者を代表するものとする。

(平成16年4月1日 追加、平成19年9月30日、平成22年10月1日 変更)

#### **(連絡事務所)**

第9条の2 清算参加者は、本店その他の営業所又は事務所で国内にあるもののうちから、本取引所からの通知を受ける連絡事務所1か所を定め、本取引所が定めるところにより、本取引所に届け出なければならない。

2 清算参加者は、連絡事務所に関し変更があったときは、本取引所が定めるところにより、本取引所に届け出なければならない。

- 取引資格を有する清算参加者は、取引参加者として取引参加者規程第 10 条の規定により連絡事務所を届け出ている場合は、当該連絡事務所を第 1 項の連絡事務所とする。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加)

#### **(金融商品債務引受業に関する責任の所在)**

第 10 条 本取引所は、清算参加者が業務上、本取引所が行う金融商品債務引受業に関し損害を受けることがあっても、本取引所に故意又は重大な過失のない限り、これを賠償する責めに任じない。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 19 年 9 月 30 日 変更)

#### **(市場施設の利用による責任の所在)**

第 10 条の 2 前条の規定にかかわらず、本取引所は、取引参加者規程第 15 条第 1 項に定める取引所システムを清算参加者が利用したことによって損害を受けることがあっても、これを賠償する責めに任じない。

- 本取引所は、取引参加者規程第 15 条第 2 項に定める参加者システムを利用したことによって清算参加者が損害を受けることがあっても、これを賠償する責めに任じない。
- 清算参加者は、取引参加者規程第 15 条第 3 項に定める市場施設を利用したことによって本取引所に損害を生ぜしめた場合には、これを賠償する責めに任じなければならない。

(平成 25 年 3 月 11 日 追加)

#### **(リスク管理体制の整備)**

第 10 条の 3 清算参加者は、本取引所の市場における市場デリバティブ取引に係る未決済取引に関するリスク管理体制（保有する未決済取引の価格の変動、取引の相手方の契約不履行又はその他の理由により発生し得る危険を管理する体制をいう。第 15 条の 2 の 3 において同じ。）を整備しなければならない。

(平成 27 年 11 月 2 日 追加)

### **第 4 節 清算資格の喪失等**

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 26 年 3 月 6 日 変更)

#### **(清算資格の喪失申請)**

第 11 条 清算参加者が清算資格を喪失しようとするときは、本取引所が定めるところにより、清算資格の喪失申請を行わなければならない。ただし、以下の各号に該当する場合を除き、清算資格の喪失申請を行うことができない。

- (1) 喪失しようとする清算資格が対象とする市場デリバティブ取引等に係る取引資格をすべて喪失する場合
  - (2) 前号に該当しない場合においては、あらかじめ当該清算資格と同じ清算資格を有し、かつ、当該清算資格が対象とする市場デリバティブ取引等に係る取引資格について、当該清算参加者と同じ取引資格を有する他の清算参加者との間に当該清算資格に係る清算委託契約を締結している場合（ただし、喪失しようとする清算資格が証拠金清算資格であって、当該他の清算参加者が取引所株価指数証拠金取引に係る清算業務を行う登録金融機関である場合においては、あらかじめ証拠金清算資格を有する他の清算参加者との間に当該証拠金清算資格に係る清算委託規約を締結している場合）
- 2 清算資格を喪失しようとする清算参加者が当該清算資格に係る指定清算参加者であるときは、あらかじめ当該指定清算参加者が締結している当該清算資格に係る清算委託契約をすべて解約し、本取引所の承認を受けない限り、前項の喪失申請を行うことができない。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 17 年 7 月 1 日、平成 22 年 10 月 1 日、平成 29 年 2 月 27 日 変更)

#### **(清算資格の喪失申請者の市場デリバティブ取引)**

第 12 条 本取引所は、清算参加者からの清算資格の喪失申請を受理した日の翌営業日の本取引所が指定する時刻から、当該清算資格の喪失を申請した清算参加者（以下「清算資格喪失申請者」という。）の本取引所の市場における自己のなす呼び値による当該清算資格に係る市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けを停止するものとする。

- 2 本取引所は、前項の規定により市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けを停止したときは、本取引所が定める期間内に、当該清算資格喪失申請者の本取引所の市場における自己のなした呼び値により成立した当該清算資格に係る市場デリバティブ取引で未決済のものについて、他の清算参加者への引継ぎその他本取引所が必要と認める整理を行わせることができる。
- 3 第 1 項の規定にかかわらず、当該清算資格喪失申請者が前項の規定による整理を行うために必要とする限度において、本取引所は、当該清算資格喪失申請者が本取引所の市場において自己のなす呼び値により成立させる当該清算資格に係る市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けを行うことができる。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 17 年 7 月 1 日、平成 19 年 9 月 30 日 変更)

#### **(喪失申請者の合併等の場合における市場デリバティブ取引)**

第 13 条 本取引所は、清算資格喪失申請者が、その喪失と同時に、当該喪失申請に係る清算資格を取得する者又は当該喪失申請に係る清算資格を有する他の清算参加者に合併され若しく

は事業の譲渡を行う等の場合で、当該清算参加者の本取引所の市場における自己のなした呼び値により成立した当該清算資格に係る市場デリバティブ取引で未決済のものを整理させる必要がないと認めるときは、前条第1項の規定にかかわらず、当該清算資格喪失申請者の本取引所の市場における自己のなす呼び値による当該清算資格に係る市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けを停止しないことができる。

(平成16年4月1日 追加、平成17年7月1日、平成18年7月3日、平成19年9月30日 変更)

### **(清算資格喪失の承認)**

第13条の2 清算資格喪失の承認は、将来の一定の日時を指定して行うものとする。

(平成16年4月1日 追加、平成17年7月1日、平成19年9月30日、平成22年10月1日 変更)

### **(清算資格喪失の公告及び通知)**

第14条 本取引所は、清算参加者が清算資格を喪失（清算資格の取消しによる喪失を含む。以下同じ。）したときは、直ちに当該清算参加者の清算資格の喪失について公告を行い、かつ、当該清算参加者の清算資格の喪失について以下の各号に定める者に通知するものとする。

(1) 金利先物等清算資格の喪失のとき

すべての金利先物等清算参加者及び金利先物等取引に係る非清算参加者

(2) 証拠金清算資格の喪失のとき

すべての証拠金清算参加者並びに取引所為替証拠金取引及び取引所株価指数証拠金取引に係る非清算参加者

(平成16年4月1日 追加、平成17年7月1日、平成22年10月1日、平成29年2月27日 変更)

### **(清算資格の喪失の際の債務弁済)**

第14条の2 清算資格を喪失した者は、本取引所から返付を受ける金銭又は有価証券その他をもって、その者が清算参加者として他の清算参加者、非清算参加者及び本取引所に対して負担している一切の債務の弁済に充てなければならない。

(平成19年9月30日 追加)

### **(清算資格の名義書換)**

第14条の2の2 清算資格は、清算資格喪失申請者が清算資格を喪失すると同時に、その喪失を条件として同種類の清算資格を取得する者に対してのみ、本取引所の承認を受けて、名義の書換えを行うことができる。

2 名義の書換えによって清算資格を取得しようとする者は、第2節に規定する清算資格の取得に係る手続きを行わなければならない。

3 第4条第3項の規定にかかわらず、名義の書換えによって清算資格を取得する者は、当該清

算資格に係る清算資格取得料に代えて名義書換手数料を支払うものとする。

- 4 第 1 項の規定にかかわらず、清算資格喪失申請者が特定承継金融機関等である場合は、当該清算資格喪失申請者は、原則として名義書換を行うことができないものとする。

(平成 20 年 4 月 28 日 追加、平成 26 年 3 月 6 日 変更)

#### **(清算資格喪失手数料)**

第 14 条の 2 の 3 清算参加者は、清算資格を喪失することとなる場合には、第 11 条に規定する清算資格の喪失申請その他いかなる事由に基づくかを問わず、本取引所が指定する日時までに清算資格喪失手数料を支払うものとする。

- 2 本取引所は、特段の事由があると認めたときは、清算資格喪失手数料の全部又は一部の支払いを免除することができる。

(平成 22 年 10 月 1 日 追加)

## **第 4 節の 2 清算参加者の調査等**

(平成 19 年 9 月 30 日 追加)

#### **(届出事項)**

第 14 条の 3 清算参加者は、次の各号のいずれかに掲げる行為をしようとするときは、本取引所が定めるところにより、あらかじめその内容を本取引所に届け出なければならない。

- (1) 定款の変更（第 4 号又は次条第 1 項第 6 号若しくは第 9 号に掲げる場合を除く。）
- (2) 合併
- (3) 分割による事業の全部又は一部の他の会社への承継若しくは他の会社からの承継
- (4) 事業の全部又は重要な一部の譲渡
- (5) 出資の総額の減少
- (6) 金融商品取引業又は登録金融機関業務（以下「金融商品取引業等」という。）の廃止

(平成 19 年 9 月 30 日 追加、平成 20 年 1 月 1 日 変更)

#### **(報告事項)**

第 14 条の 4 清算参加者は、次の各号のいずれかに該当することとなった場合は、本取引所が別に定めるところにより、直ちにその内容を本取引所に報告しなければならない。ただし、本取引所が不要と認めたときは、この限りでない。

- (1) 第5条に定める清算資格の要件（同条第9項第4号ロ、ハ、ホ及びヘ並びに第10項第4号ハ、ホ及びヘの要件を除く。）に適合しなくなったとき
- (1)の2 清算資格の取得において親会社による保証を受けていない証拠金自社清算参加者にあつては、純資産額が3億円を下回ったとき
- (1)の3 証拠金自社清算参加者については、次のいずれかに該当することとなったとき
  - イ 金融商品取引業者にあつては、法第46条の6第1項に規定する自己資本規制比率が140パーセントを下回ったとき
  - ロ 特別金融商品取引業者にあつては、川下連結に係る連結自己資本規制比率が140パーセントを下回ったとき
  - ハ 対象特別金融商品取引業者にあつては、国際統一基準に係る連結自己資本規制比率について連結普通株式等Tier1比率が2.25パーセントを下回ったとき、連結Tier1比率が3パーセントを下回ったとき、若しくは連結総自己資本規制比率が4パーセントを下回ったとき、又は川下連結の例による連結自己資本規制比率が140パーセントを下回ったとき
- (2) 法第29条の4第1項各号又は法第33条の5第1項各号のいずれかに該当することとなったとき
- (3) 支払不能となり又は支払不能となるおそれのある状態となったとき
- (4) 純資産の額が、清算参加者の直近の事業年度末又は本号に基づき本取引所に対して直近の報告を行ったときに比べ100分の20以上減少したとき
- (5) 租税滞納処分その他によって差押えを受けたとき（第10号に掲げる場合を除く。）
- (6) 出資の総額が増加したとき、又は発行可能株式総数若しくはこれに相当するものに関し変更があつたとき
- (7) 自己又は他人の名義をもって出資の総額の100分の10以上に相当する額を出資又は拠出する者に関し変更があつたとき
- (8) 事業の全部又は重要な一部を譲り受けたとき
- (9) 本店又は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営業所若しくは事務所に関し変更があつたとき。
- (10) 法及びその関係法令又はこれらに相当する外国の法令の規定により質問、検査、領置、臨検、搜索、差押え、審問、処分又は処罰を受けたとき（市場デリバティブ取引等（市場デリバティブ取引及び外国市場デリバティブ取引をいう。以下同じ。）又は商品市場における取引に係るものに限る、第2号に掲げる場合を除く。）
- (11) 他の金融商品取引所、商品取引所、金融商品取引業協会、商品先物取引協会又はこれらに相当する外国の取引所若しくは団体の処分を受けたとき（市場デリバティブ取引等又は商品市場における取引に係るものに限る。）
- (12) 役員が法及びその関係法令、外為法令、商品先物取引法令又はこれらに相当する外国の法令の規定により罰金以上の刑を受けたとき（市場デリバティブ取引等又は商品市場における取引に係るものに限る。）。
- (13) 金融商品取引業者又は登録金融機関の登録が取り消されたとき。

- (14) 本取引所の市場における市場デリバティブ取引に係る金融商品取引業等の業務の内容及び方法の変更があったとき
  - (15) 本取引所の市場における市場デリバティブ取引若しくはその受託に係る訴訟の当事者となったとき、又は当該訴訟が終結したとき
  - (16) 前各号に掲げる場合のほか、本取引所がその報告の必要があると認めたとき
- 2 清算参加者は、当該清算参加者を子会社とする法人又は本取引所が実質的に当該清算参加者を支配している法人であると指定する者（以下「親会社等」という。）が前条第5号又は前項第3号、第4号若しくは第5号のいずれかに該当することとなったときは、本取引所が定めるところにより、直ちにその内容を本取引所に報告しなければならない。この場合において、前項第4号中「清算参加者の直近の事業年度末又は本号に基づき本取引所に対して直近の届出を行ったとき」とあるのは「親会社等の直近の事業年度末」に読み替えるものとする。
- 3 清算参加者は、業務規程第2条第6号に規定する提携市場デリバティブ取引若しくはその委託、提携市場デリバティブ取引の受託等、受管の受託又は業務規程第2条第7号に規定する清算建玉の発生に係る訴訟の当事者となったとき、又は当該訴訟が終結したときは、本取引所が定めるところにより、直ちにその内容を本取引所に報告しなければならない。
- 4 指定清算参加者は、次に掲げる事態が生じたときは、直ちにその内容を本取引所に報告しなければならない。
- (1) 清算委託契約を締結した非清算参加者について、当該指定清算参加者に対する債務の不履行が発生したとき。
  - (2) 清算委託契約を締結した非清算参加者について、支払いの停止、破産手続開始、再生手続開始、更正手続開始若しくは特別清算開始の申立て又は外国の法令に基づくこれらに相当若しくは類する手続きが行われたことを知ったとき。
  - (3) 清算委託契約を締結した非清算参加者に対する債権の保全を必要とする相当の事由が生じたとき。
  - (4) 前各号のほか、清算委託契約を締結した非清算参加者について、その信用を損なう事態が発生したことを知ったとき。
- 5 特別金融商品取引業者又は対象特別金融商品取引業者である清算参加者は、本取引所が別に定める場合に該当することとなったときは、遅滞なく、その内容を本取引所に報告しなければならない。ただし、本取引所が不要と認めたときは、この限りでない。

（平成19年9月30日 追加、平成19年12月3日、平成20年1月1日、平成20年4月28日、平成22年10月1日、平成23年6月1日、平成24年6月18日、平成25年3月31日、平成27年12月14日、平成29年2月27日 変更）

### （財務報告）

- 第14条の5 清算参加者は、本取引所が定めるところにより、その財務の状況を定期的に本取引所に報告しなければならない。
- 2 清算参加者は、親会社等があるときは、本取引所が定めるところにより、当該親会社等の財務諸表を定期的に本取引所に提出しなければならない。
- 3 証拠金清算参加者は、法第56条の2に基づくモニタリング調査表を作成したときは、本取



引所が定めるところにより、当該モニタリング調査表の内容を本取引所に報告しなければならない。

4 証拠金清算参加者は、当該清算参加者の自己資本規制比率について、法令に基づく書面を作成した場合又は金融庁長官への届出を行った場合で、本取引所が必要と認めたときは、本取引所の定めるところにより当該自己資本規制比率を本取引所に報告しなければならない。

5 特別金融商品取引業者である証拠金清算参加者は、当該清算参加者の川下連結に係る連結自己資本規制比率について、法令に基づく書面を作成した場合又は金融庁長官への届出を行った場合で、本取引所が必要と認めたときは、本取引所の定めるところにより当該連結自己資本規制比率を本取引所に報告しなければならない。

6 対象特別金融商品取引業者である証拠金清算参加者は、当該清算参加者の国際統一基準に係る連結自己資本規制比率に係る連結普通株式等 Tier1 比率、連結 Tier1 比率及び連結総自己資本規制比率、又は川下連結の例による連結自己資本規制比率について、法令に基づく書面を作成した場合又は金融庁長官への届出を行った場合で、本取引所が必要と認めたときは、本取引所の定めるところにより当該各比率を本取引所に報告しなければならない。

(平成 19 年 9 月 30 日 追加、平成 27 年 12 月 14 日、平成 29 年 2 月 27 日 変更)

#### (清算参加者の調査)

第 14 条の 6 本取引所は、次の各号に掲げる場合その他本取引所の市場の運営上必要があると認める場合は、清算参加者に対し、当該清算参加者の業務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し、又は本取引所の職員をして当該清算参加者の業務若しくは財産の状況若しくはその帳簿書類その他の物件を検査させることができる。

- (1) 金融商品取引法令（以下「法令」という。）、外為法令、商品先物取引法令、これらに相当する外国の法令（以下「法令等」という。）若しくはこれらに基づいてする行政官庁の処分（市場デリバティブ取引等又は商品市場における取引に係るものに限る。）、本取引所の定款、業務規程、受託契約準則、清算委託契約、この方法書その他諸規則若しくはこれらに基づく処分、受管契約又は取引の信義則に係る清算参加者の遵守の状況の調査を行う場合
- (2) 清算参加者の財務状況の調査を行う場合
- (3) 本取引所の市場における市場デリバティブ取引の公正の確保を図るための調査を行う場合
- (4) 他の金融商品取引所又は金融商品取引業協会（これらに相当する外国の団体を含む。）から市場デリバティブ取引等の公正の確保を図るための調査に関し、情報提供の要請があった場合において、本取引所が当該要請に応じることが相当と認める場合

2 本取引所は、清算参加者に親会社等がある場合において、前項に規定する清算参加者に対する調査のため必要があると認めるときその他本取引所の市場の運営上必要があると認めるときは、当該清算参加者に対し、当該清算参加者の親会社等の業務又は財産に関して参考となるべき報告又は資料の提出を請求することができる。

(平成 19 年 9 月 30 日 追加、平成 24 年 6 月 18 日 変更)

### **(届出等に関する適用除外)**

第 14 条の 7 清算参加者が取引参加者として、第 14 条の 3 から前条までの規定に基づき届出又は報告すべき事項について、取引参加者規程第 55 条から第 58 条までの規定に基づき届出又は報告を行っている場合は、適用しない。

(平成 19 年 9 月 30 日 追加)

## **第 5 節 清算参加者の処分及び処置等**

(平成 16 年 4 月 1 日 追加)

### **第 1 款 処分及び処置等**

(平成 19 年 9 月 30 日 追加)

#### **(役員又は他の者との共同関係若しくは支配関係)**

第 14 条の 8 本取引所は、清算参加者の役員又は他の者との共同関係若しくは支配関係が本取引所の市場の運営にかんがみて適当でないとき認めるときは、当該清算参加者を審問のうえ、その変更を請求することができる。ただし、当該清算参加者が陳述書を提出したときは、その提出をもって、審問に代えることができる。

- 2 本取引所は、清算参加者が正当な理由がないにもかかわらず前項の審問に応じない場合には、審問を行わずに同項の変更請求を行うことができる。
- 3 清算参加者は、第 1 項の変更請求が不当であると認めるときは、変更請求の通知を受けた日から 10 営業日（業務規程第 6 条の 2 に規定する営業日をいう。以下同じ。）以内に、本取引所に対し書面をもって、理由を示して、異議の申立てを行うことができる。
- 4 本取引所は、前項の異議の申立てを受理したときは、遅滞なく、取締役会を開催する。
- 5 前項の取締役会において、第 1 項の変更請求を変更し、又は取り消すことが適当であると認められたときは、直ちに第 1 項の請求を変更し、又は取り消すものとする。

(平成 19 年 9 月 30 日 追加、平成 27 年 11 月 2 日 変更)

## 第 15 条 (削除)

(平成 19 年 9 月 30 日 追加、平成 20 年 1 月 1 日、平成 27 年 11 月 2 日 変更)

### (清算参加者の処分)

第 15 条の 2 本取引所は、清算参加者が次の各号のいずれかに該当することとなったと認める場合には、当該清算参加者を審問のうえ、取締役会の決議により当該各号に掲げる処分をすることができる。

- (1) 不正な手段によって清算資格を取得したときは、清算資格の取消し
- (2) 本取引所が第 5 条に定める清算資格の要件に適合しなくなったとき（ただし、証拠金清算参加者の財産的基礎に係る要件にあつては、第 15 条の 3 第 2 項各号に掲げる要件に適合しなくなったとき）は、清算資格の取消し
- (3) 支払不能となり、容易に回復しえない状態となったときは、清算資格の取消し
- (4) 本取引所の市場における市場デリバティブ取引に関する本取引所又は他の清算参加者又は非清算参加者との契約を履行しないときは、6 月以内の本取引所の市場における自己の名による市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けの停止若しくは制限、自己の名による清算建玉に基づく債務の引受けの停止若しくは制限又は清算資格の取消し
- (5) 清算参加者として本取引所に払込み、納入又は預託しなければならない金銭、有価証券その他のものを、本取引所が定めるところにより、払込み、納入又は預託しないときは、6 月以内の本取引所の市場における自己の名による市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けの停止若しくは制限、自己の名による清算建玉に基づく債務の引受けの停止若しくは制限又は清算資格の取消し
- (6) 清算参加者が他の金融商品取引所、商品取引所、金融商品取引業協会、商品先物取引協会又はこれらに相当する外国の取引所若しくは団体の処分（市場デリバティブ取引等又は商品市場における取引に係るものに限る。）を受けたときは、6 月以内の本取引所の市場における自己の名による市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けの停止若しくは制限、自己の名による清算建玉に基づく債務の引受けの停止若しくは制限又は清算資格の取消し
- (7) 第 14 条の 3 の規定による届出又は第 14 条の 4 若しくは第 14 条の 5 の規定による報告をせず、又は虚偽の届出若しくは報告をしたときは、1 億円以下の過怠金、戒告、6 月以内の本取引所の市場における自己の名による市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けの停止若しくは制限又は清算資格の取消し
- (8) 第 14 条の 6 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、又は取引参加者規程第 45 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 月以内の本取引所の市場における自己の名による市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けの停止若しくは制限又は清算資格の取消し

- (9) 前各号のほか、清算参加者が法令等、若しくはこれらに基づいてする行政官庁の処分(市場デリバティブ取引等又は商品市場における取引に係るものに限る。)、又は本取引所の定款、業務規程、受託契約準則、清算委託契約、この方法書その他諸規則若しくはこれらに基づく処分に違反し、又は取引の信義則に反する行為をしたときは、1億円以下の過怠金、戒告、本取引所の市場における自己のなす呼び値による市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けの停止若しくは制限、6月以内の本取引所の市場における自己の名による市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けの停止若しくは制限、自己の名による清算建玉に基づく債務の引受けの停止若しくは制限又は清算資格の取消し
- (10) 受管契約に違反し又は取引の信義則に反する行為をしたときは、戒告、自己の名による清算建玉に基づく債務の引受けの停止若しくは制限、本取引所の市場における自己の名による市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けの停止若しくは制限、6月以内の本取引所の市場における市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けの停止若しくは制限又は清算資格の取消し
- 2 前項第9号に規定する法令等又はこれらに基づいてする行政官庁の処分に違反し、よって本取引所の信用を著しく失墜させたと認める場合には、当該清算参加者を審問のうえ、取締役会の決議により、5億円以下の過怠金を賦課することができる。
- 3 第1項各号の規定にかかわらず、本取引所は、証拠金清算参加者が以下のいずれかに該当することとなったと認める場合には、当該証拠金清算参加者を審問のうえ、取締役会の決議により、証拠金清算資格の取消しの処分をすることができる。
- (1) 証拠金清算参加者を保証する親会社(当該証拠金清算参加者の総株主の議決権の過半数を有する法人をいう。)が、第14条の5第2項に定める財務報告において、3期間連続して第5条第8項第4号ト又は第10項第4号トの規定に反したとき、又は債務超過となり直後の事業年度内に回復しえない状態となったとき。
- (2) 法令により金融商品取引業等の全部又は一部の停止の処分を受けたとき。
- 4 第1項及び第2項の場合において、当該処分が1億円を超える過怠金又は清算資格の取消し以外の処分であるときは、取締役会の決議によらずに当該処分を行うことができるものとする。
- 5 第1項及び第2項の規定による処分において、過怠金の賦課と本取引所の市場における自己のなす呼び値による市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けの停止若しくは制限又は戒告は、併科することができる。

(平成16年4月1日 追加、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1月1日、平成20年10月27日、平成22年10月1日、平成27年11月2日、平成27年12月14日、平成29年2月27日 変更)

#### **(清算参加者の支配関係等が不適当な場合の処置)**

第15条の2の2 本取引所は、清算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、当該清算参加者を審問のうえ、市場デリバティブ取引等に基づく債務の引受けの停止その他本取引所が必要かつ適当と認める処置をすることができる。この場合において、当該

処置が市場デリバティブ取引等に基づく債務の引受けの停止であるときは、取締役会の決議により行うものとする。

- (1) 清算参加者が第 14 条の 8 の規定による役員又は他の者との共同関係若しくは支配関係の変更請求に応じないとき
- (2) 本取引所の市場の運営上適当でない認められる者が、清算参加者の出資の総額の 2 分の 1 以上に相当する額を出資又は拠出することになったとき
- (3) 相談役、顧問その他いかなる名称を有する者であるかを問わず、清算参加者に対し役員と同等以上の支配力を有する者が、本取引所の市場の運営上適当でない認められるとき

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 17 年 7 月 1 日、平成 19 年 9 月 30 日、平成 20 年 10 月 27 日、平成 22 年 10 月 1 日、平成 27 年 11 月 2 日 変更)

### **(リスク管理体制の不備が認められる場合の処置)**

第 15 条の 2 の 3 本取引所は、第 10 条の 3 に定める清算参加者のリスク管理体制が本取引所の市場の運営にかんがみて著しく適当でない認められる場合、当該清算参加者を審問のうえ、その改善のために必要かつ適当と認める処置をすることができる。

(平成 27 年 11 月 2 日 追加)

### **(支払不能等の清算参加者に対する処置)**

第 15 条の 3 本取引所は、清算参加者が支払不能となり又は支払不能となるおそれがあると認める場合には、当該清算参加者を審問のうえ、その事由の消滅するまで、本取引所の市場における市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けの全部又は一部の停止その他本取引所が必要かつ適当と認める処置をすることができる。

2 本取引所は、清算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、当該清算参加者を審問のうえ、その事由の消滅するまで、本取引所の市場における市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けの全部又は一部の停止その他本取引所が必要かつ適当と認める処置をすることができる。

- (1) 証拠金清算参加者について、資本金の額が 3 億円を下回り、速やかな回復が見込めないとき
- (2) 清算資格の取得において親会社による保証を受けていない証拠金自社清算参加者について、純資産の額が 3 億円を下回り、速やかな回復が見込めないとき
- (3) 証拠金自社清算参加者について、次のいずれかに該当することとなったとき
  - イ 金融商品取引業者にあつては、法第 46 条の 6 第 1 項に規定する自己資本規制比率が 120 パーセントを下回り、速やかな回復が見込めないとき
  - ロ 特別金融商品取引業者にあつては、川下連結に係る連結自己資本規制比率が 120 パーセントを下回り、速やかな回復が見込めないとき

- ハ 対象特別金融商品取引業者にあつては、国際統一基準に係る連結自己資本規制比率について連結普通株式等 Tier1 比率が 2.25 パーセントを下回ったとき、連結 Tier1 比率が 3 パーセントを下回ったとき、若しくは連結総自己資本規制比率が 4 パーセントを下回ったとき、又は川下連結の例による連結自己資本規制比率が 120 パーセントを下回り、速やかな回復が見込めないとき
- (4) 清算資格の取得において親会社による保証を受けた証拠金清算参加者について、当該清算参加者の親会社が、第 5 条第 8 項第 4 号ト又は同第 10 項第 4 号トに掲げる財産的基礎に係る要件に適合しなくなり、速やかな回復が見込めないとき（第 5 号に掲げる場合を除く。）
- (5) 証拠金他社清算参加者について、第 5 条第 7 項第 4 号又は第 8 項第 4 号に掲げる財産的基礎に係る要件に適合しなくなり、速やかな回復が見込めないとき

（平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 17 年 7 月 1 日、平成 19 年 9 月 30 日、平成 22 年 10 月 1 日、平成 27 年 11 月 2 日、平成 27 年 12 月 14 日、平成 29 年 2 月 27 日 変更）

#### （過大な未決済取引を保有する清算参加者に対する処置等）

第 15 条の 3 の 2 本取引所は、清算参加者が市場デリバティブ取引で未決済のものを過大に保有していると認められる場合（当該清算参加者が保有する未決済取引が負っているものと想定されるリスク相当額（市場デリバティブ取引の価格の変動により損失が発生し得る危険に相当する額をいう。）が、当該清算参加者の純資産額その他財務の状況に比して過大であると認められる場合であつて、当該リスク相当額が当該清算参加者の自己の計算による取引若しくは少数の顧客の委託に基づく取引（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を含む。）に起因しているときをいう。）その他本取引所が当該清算参加者のリスク相当額の軽減が必要と認める場合には、次の各号に掲げる処置その他本取引所が必要と認める処置をすることができる。

- (1) 預託すべき清算預託金（第 31 条第 2 項に規定する預託すべき金利先物等清算預託金の額又は同第 3 項に規定する預託すべき証拠金取引清算預託金の額をいう。次条において同じ。）又は取引証拠金、為替取引証拠金若しくは株価指数取引証拠金（以下この条において清算預託金とあわせて、「取引証拠金等」と総称する。）の額の引き上げ
- (2) 取引証拠金等を有価証券をもって代用する場合における本取引所が指定する有価証券の種類制限
- (3) 取引証拠金等を有価証券をもって代用する場合の代用価格の計算における時価に乗すべき率の引下げ
- 2 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市場デリバティブ取引に係る取引証拠金等に対し、前項の処置がなされた場合には、当該処置の対象となった清算参加者は、当該顧客又は当該非清算参加者に対して同項の処置と同様の措置を行わなければならない。

(平成 27 年 11 月 2 日 追加、平成 29 年 2 月 27 日 変更)

### **(担保の預託状況が不相当と認められる場合等における清算参加者への処置)**

第 15 条の 3 の 3 一の清算参加者が清算預託金、取引証拠金、為替取引証拠金、株価指数取引証拠金及び信託金（以下この条において「清算預託金等」と総称する。）の本取引所への預託を株券により行っている場合において、銘柄ごとの預託数量が当該銘柄の上場株式数の 5% 相当数量を超えているときは、本取引所は、当該清算参加者に対し、次の各号に掲げる処置をすることができる。

- (1) 清算預託金等を有価証券をもって預託する場合における本取引所が指定する銘柄の制限
- (2) 清算預託金等を有価証券をもって預託する場合の代用価格の計算における時価に乗じる率の引下げ

2 前項のほか、清算参加者の本取引所に対する債務の履行確保の観点から本取引所が必要と認めた場合には、本取引所は、当該清算参加者に対し、前項各号に掲げる処置をすることができる。

(平成 27 年 11 月 2 日 追加)

### **(市場デリバティブ取引等に基づく債務の引受けの停止等の処置の解除)**

第 15 条の 4 第 15 条の 2 の 2 又は第 15 条の 3 の規定により、期間を定めずに本取引所の市場における市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けの停止を受けた清算参加者は、当該処置を受けた事由を除去したときは、それについての説明書を添付して、その処置の解除を申請することができる。

- 2 本取引所は、前項の申請に基づく処置の解除が適当であると認めるときは、その申請を承認する。
- 3 第 15 条の 2 の 2 又は第 15 条の 3 の規定により、期間を定めずに本取引所の市場における市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けの停止を受けた清算参加者が、その処置を受けた日から 1 年以内に、前項の承認を受けられないときは、本取引所は、取締役会の決議により、当該清算参加者の清算資格を取り消すことができる。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 19 年 9 月 30 日 変更)

### **(異議の申立て等)**

第 15 条の 5 第 14 条の 8 第 1 項ただし書き及び第 2 項の規定は、第 15 条の 2 から第 15 条の 3 までに規定する審問について、第 14 条の 8 第 3 項から第 5 項までの規定は、第 15 条の 2 から第 15 条の 3 までに規定する処分及び処置並びに前条第 3 項に規定する清算資格の取消しについて準用する。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 17 年 7 月 1 日、平成 19 年 9 月 30 日、平成 20 年 1 月 1 日、平成 24 年 6 月 18 日、平成 27

年 11 月 2 日 変更)

### **(法令等により処分を受けた清算参加者への措置)**

第 15 条の 6 本取引所は、法令等により金融商品取引業等の全部又は一部の停止の処分を受けた清算参加者について、当該処分の内容に応じ、本取引所の市場における自己のなす呼び値による市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けの停止又は制限を行う。

2 本取引所は、法令等により金融商品取引業等の全部又は一部の停止の処分を受けた清算参加者について、当該処分の内容に応じ、自己の名における清算建玉に基づく債務の引受けの停止又は制限を行うことができる。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 19 年 9 月 30 日、平成 20 年 1 月 1 日、平成 24 年 6 月 18 日 変更)

### **(取引の信義則違反)**

第 15 条の 7 本節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行為で、本取引所の市場の運営上、本取引所若しくは本取引所の清算参加者若しくは非清算参加者の信用を失墜し、又は本取引所、本取引所の清算参加者若しくは非清算参加者、提携外国取引所等若しくはこれらの会員に対する信義に反する行為をいう。

- (1) 本取引所の業務又は他の清算参加者若しくは非清算参加者の業務に干渉し又はこれを妨げる行為
- (2) 市場デリバティブ取引等又は市場デリバティブ取引等の受託等に関し、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行為
- (3) 提携市場デリバティブ取引若しくはその委託、提携市場デリバティブ取引の受託等、受託の受託又は清算建玉の発生に関し、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行為

(平成 19 年 9 月 30 日 追加)

### **(清算参加者に対する勧告)**

第 15 条の 8 本取引所は、清算参加者の業務又は財産の状況が、本取引所の市場の運営上適当でないと認めるときは、当該清算参加者に対し、適切な措置を講ずることを勧告することができる。

2 本取引所は、前項の勧告を行った場合において必要があると認めるときは、当該清算参加者に対し、その対応について報告を求めることができる。

(平成 19 年 9 月 30 日 追加)



## 第2款 処分及び処置等の効果

(平成19年9月30日 追加)

### (本取引所の市場における市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けの停止又は制限の処分等を受けた清算参加者の市場デリバティブ取引)

第15条の9 本取引所が清算参加者に対して行った処分等（第15条の2から第15条の3までに規定する処分及び処置、第15条の4第3項に規定する清算資格の取消し並びに第15条の6に規定する措置をいう。以下同じ。）が清算参加者の本取引所の市場における自己のなす呼び値による市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けの停止又は制限であるときは、本取引所は、その期間中、当該清算参加者の本取引所の市場における自己のなした呼び値により成立した市場デリバティブ取引で未決済のものについて、他の清算参加者への引継ぎその他本取引所が必要と認める整理を行わせることができる。

- 2 前項の処分等を受けた清算参加者が前項の規定による整理を行うために必要とする限度において、本取引所は、当該清算参加者が本取引所の市場において自己のなす呼び値により成立させる市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けを行うことができる。
- 3 本取引所は、清算参加者に対して行った処分等が、清算参加者の本取引所の市場における市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けの停止又は制限であるときは、その期間中、当該清算参加者の名により発生した清算建玉で未決済のものについて、他の清算参加者への引継ぎその他本取引所が必要と認める整理を行わせることができる。
- 4 第2項の規定は、前項に規定する整理について準用する。

(平成19年9月30日 追加、平成22年10月1日、平成24年6月18日 変更)

### (債務の引受けの停止等の処置を受けたマーケットメイカーの未決済の取引所為替証拠金取引)

第15条の9の2 本取引所が取引所為替証拠金取引に係るマーケットメイカー（取引所為替証拠金取引に関する業務規程の特例（以下「為替特例」という。）第2条第4号に規定する「マーケットメイカー」をいう。以下この条において同じ。）に指定されている証拠金清算参加者に対し、第15条の3第1項に規定する処置又は第15条の6第1項に規定する措置を行った場合であって、本取引所が前条第1項の規定により、当該証拠金清算参加者（以下この条において「対象為替マーケットメイカー清算参加者」という。）がマーケットメイク呼び値を提示する義務を遂行するために行った業務により成立した取引所為替証拠金取引で未決済のもの（以下この条において「未決済為替証拠金取引」という。）につき、取引所為替証拠金取引に係るマーケットメイカーに指定されている他の証拠金清算参加者（以下この条において「非対象為替マーケットメイカー清算参加者」という。）又は取引所為替証拠金取引に係るマーケットメイカーに指定されている非清算参加者（以下この条において「非清算参加者為替マー

ケットメイカー」という。)との間で清算委託契約を締結している証拠金清算参加者(以下この条において「指定証拠金清算参加者」という。)への引継ぎを行わせるときの価格(以下この条において「MM等移管価格」という。)、一の非対象為替マーケットメイカー清算参加者が引継ぐ未決済為替証拠金取引の数量(以下この条において「MM移管数量」という。)及び一の指定証拠金清算参加者が引継ぐ未決済為替証拠金取引の数量(以下この条において「指定清算参加者移管数量」という。)は、それぞれ次に掲げるとおりとする。

- (1) MM等移管価格 取引所為替証拠金取引の種類ごとに、その付合せ時間帯の開始時が、本取引所が対象為替マーケットメイカー清算参加者に対し、第15条の3第1項に規定する処置又は第15条の6第1項に規定する措置を行った日以降の最初の営業日に属する取引日における外国為替相場を勘案し、本取引所が適正であると認める価格とする。
  - (2) MM移管数量 取引所為替証拠金取引の種類ごとに、当該取引所為替証拠金取引に係る未決済為替証拠金取引の数量を、当該取引所為替証拠金取引につきマーケットメイク呼び値を提示する義務を負う非対象為替マーケットメイカー清算参加者及び非清算参加者株価指数マーケットメイカーの数で除した数量とする。
  - (3) 指定清算参加者移管数量 取引所為替証拠金取引の種類ごとに、当該取引所為替証拠金取引につきマーケットメイク呼び値を提示する義務を負う非清算参加者為替マーケットメイカーであって指定証拠金清算参加者との間で清算委託契約を締結している者の数に、当該取引所為替証拠金取引に係る未決済為替証拠金取引の数量を当該取引所為替証拠金取引につき非対象為替マーケットメイカー清算参加者及び非清算参加者為替マーケットメイカーの数で除した数量(小数点以下第1位を切り上げるものとする。)を乗じて得られた数量を上限として、当該指定証拠金清算参加者と各非清算参加者為替マーケットメイカーの間で決定される数量とする。
- 2 MM移管数量の計算に関し本取引所が必要と認める事項については、本取引所が都度定めるものとする。
  - 3 本取引所が第1項第1号に規定する方法によりMM等移管価格を定めることが適当でないと判断したときは、本取引所が都度適当と認める方法によりMM等移管価格を定めるものとする。
  - 4 本取引所が第1項第2号に規定する方法によりMM移管数量を定めることが適当でないと判断したときは、本取引所が都度適当と認める方法によりMM移管数量を定めるものとする。

(平成27年11月2日 追加、平成29年2月27日 変更)

#### **(債務の引受けの停止等の処置を受けたマーケットメイカーの未決済の取引所株価指数証拠金取引)**

第15条の9の3 本取引所が取引所株価指数証拠金取引に係るマーケットメイカー(取引所株価指数証拠金取引に関する業務規程の特例(以下「株価指数特例」という。)第2条第1項第4号に規定する「マーケットメイカー」をいう。以下この条において同じ。)に指定されている証拠金清算参加者に対し、第15条の3第1項に規定する処置又は第15条の6第1項に規

定する措置を行った場合であって、本取引所が第15条の9第1項の規定により、当該証拠金清算参加者（以下この条において「対象株価指数マーケットメイカー清算参加者」という。）がマーケットメイク呼び値を提示する義務を遂行するために行った業務により成立した取引所株価指数証拠金取引で未決済のもの（以下この条において「未決済株価指数証拠金取引」という。）につき、取引所株価指数証拠金取引に係るマーケットメイカーに指定されている他の証拠金清算参加者（以下この条において「非対象株価指数マーケットメイカー清算参加者」という。）又は取引所株価指数証拠金取引に係るマーケットメイカーに指定されている非清算参加者（以下この条において「非清算参加者株価指数マーケットメイカー」という。）との間で清算委託契約を締結している証拠金清算参加者（以下この条において「指定証拠金清算参加者」という。）への引継ぎを行わせるときの価格（以下この条において「MM等移管価格」という。）、一の非対象株価指数マーケットメイカー清算参加者が引継ぐ未決済株価指数証拠金取引の数量（以下この条において「MM移管数量」という。）及び一の指定証拠金清算参加者が引継ぐ未決済株価指数証拠金取引の数量（以下この条において「指定清算参加者移管数量」という。）は、それぞれ次に掲げるとおりとする。

- (1) MM等移管価格 取引所株価指数証拠金取引の種類ごとに、その付合せ時間帯の開始時が、本取引所が対象株価指数マーケットメイカー清算参加者に対し、第15条の3第1項に規定する処置又は第15条の9第1項に規定する措置を行った日以降の最初の営業日に属する取引日における当該取引所株価指数証拠金取引の取引対象である株価指数の価格等を勘案し、本取引所が適正と認める価格とする。
  - (2) MM移管数量 取引所株価指数証拠金取引の種類ごとに、当該取引所株価指数証拠金取引に係る未決済株価指数証拠金取引の数量を、当該取引所株価指数証拠金取引につきマーケットメイク呼び値を提示する義務を負う非対象株価指数マーケットメイカー清算参加者及び非清算参加者株価指数マーケットメイカーの数で除した数量とする。
  - (3) 指定清算参加者移管数量 取引所株価指数証拠金取引の種類ごとに、当該取引所株価指数証拠金取引につきマーケットメイク呼び値を提示する義務を負う非清算参加者株価指数マーケットメイカーであって指定証拠金清算参加者との間で清算委託契約を締結している者の数に、当該取引所株価指数証拠金取引に係る未決済株価指数証拠金取引の数量を当該取引所株価指数証拠金取引につき非対象株価指数マーケットメイカー清算参加者及び非清算参加者株価指数マーケットメイカーの数で除した数量（小数点以下第1位を切り上げるものとする。）を乗じて得られた数量を上限として、当該指定証拠金清算参加者と各非清算参加者株価指数マーケットメイカーの間で決定される数量とする。
- 2 MM移管数量の計算に関し本取引所が必要と認める事項については、本取引所が都度定めるものとする。
  - 3 本取引所が第1項第1号に規定する方法によりMM等移管価格を定めることが適当でないと判断したときは、本取引所が都度適当と認める方法によりMM等移管価格を定めるものとする。
  - 4 本取引所が第1項第2号に規定する方法によりMM移管数量を定めることが適当でないと判断したときは、本取引所が都度適当と認める方法によりMM移管数量を定めることができる。

(平成 27 年 11 月 2 日 追加、平成 29 年 2 月 27 日 変更)

### **(指定清算参加者が市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けの停止の処分等を受けた場合における非清算参加者の市場デリバティブ取引)**

第 15 条の 10 本取引所は、市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けの停止の処分等を受けた清算参加者が指定清算参加者であるときは、当該指定清算参加者との間で清算委託契約を締結している非清算参加者が本取引所の市場において自己のなす呼び値により当該指定清算参加者の名において成立させる市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けを停止させることができる。

2 本取引所は、前項の規定により市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けを停止したときは、当該非清算参加者の本取引所の市場における自己のなした呼び値により当該指定清算参加者の名において成立した市場デリバティブ取引で未決済のものについて、他の清算参加者への引継ぎその他本取引所が必要と認める整理を行わせることができる。

3 第 1 項の規定にかかわらず、当該非清算参加者が前項の規定による整理を行うために必要とする限度において、本取引所は、当該非清算参加者が本取引所の市場において自己のなす呼び値により当該指定清算参加者の名において成立させる市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けを行うことができる。

4 本取引所は、市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けの停止の処分等を受けた清算参加者が指定清算参加者であるときは、当該指定清算参加者との間で清算委託契約を締結している非清算参加者の計算による当該指定清算参加者の名における清算建玉に基づく債務の引受けを停止することができる。

5 本取引所は、第 1 項の規定により市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けを停止したときは、当該非清算参加者の計算により当該指定清算参加者の名において発生した清算建玉で未決済のものについて、他の清算参加者への引継ぎその他本取引所が必要と認める整理を行わせることができる。

6 第 3 項の規定は、前項に規定する整理について準用する。

(平成 19 年 9 月 30 日 追加)

### **(処分等の通知及び公表)**

第 15 条の 11 本取引所は、次の各号に掲げる清算参加者に対する処分等をしたときは、その旨を当該各号に定める者に通知し、かつ、公表する。

(1) 金利先物等清算参加者

すべての金利先物等清算参加者及び金利先物等取引に係る非清算参加者

(2) 証拠金清算参加者

すべての証拠金清算参加者並びに取引所為替証拠金取引及び取引所株価指数証拠金取引

に係る非清算参加者

- 2 本取引所が清算参加者に対して行った処分等が本取引所の市場における自己のなす呼び値による市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けの停止又は制限であるときは、当該清算参加者は、本取引所が定めるところにより、その旨を店頭等に表示しなければならない。
- 3 本取引所が清算参加者に対して行った処分等が清算建玉に基づく債務の引受けの停止又は制限であるときは、当該清算参加者は、本取引所が定めるところにより、その旨を店頭等に表示しなければならない。

(平成 19 年 9 月 30 日 追加、平成 22 年 10 月 1 日、平成 24 年 6 月 18 日、平成 29 年 2 月 27 日 変更)

### 第 3 章 有価証券等清算取次ぎ

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 19 年 9 月 30 日 変更)

#### (有価証券等清算取次ぎの対象取引)

- 第 15 条の 12 指定清算参加者が行うことができる有価証券等清算取次ぎの対象取引は、第 2 条に規定する取引とする。
- 2 有価証券等清算取次ぎによるユーロ円 3 ヶ月金利先物オプション取引の権利行使によって成立するユーロ円 3 ヶ月金利先物は、有価証券等清算取次ぎによるものとみなして、この方法書の規則を適用する。

(平成 19 年 9 月 30 日 追加)

#### (清算委託契約)

第 16 条 金利先物等取引に係る非清算参加者は、その有する取引資格と同種類の取引資格（為替証拠金取引資格及び株価指数証拠金取引資格を除く。）をすべて有する金利先物等清算参加者との間で、次に掲げる事項を記載した本取引所が定める様式による清算委託契約を締結しなければならない。ただし、ユーロ円先物遠隔地取引参加者は、ユーロ円先物取引資格を有する金利先物等清算参加者との間で清算委託契約を締結しなければならない。

- (1) 金利先物等取引に係る非清算参加者がその指定清算参加者を代理して金利先物等取引を成立させようとするときは、当該非清算参加者が有価証券等清算取次ぎの申込みをし、かつ、当該指定清算参加者が当該有価証券等清算取次ぎの受託をしたこととする旨
  - (2) その他取引所が定める事項
- 2 取引所為替証拠金取引に係る非清算参加者は、証拠金他社清算参加者との間で、次に掲げる事項を記載した本取引所が定める様式による清算委託契約を締結しなければならない。
    - (1) 取引所為替証拠金取引に係る非清算参加者がその指定清算参加者を代理して取引所為

替証拠金取引を成立させようとするときは、当該非清算参加者が有価証券等清算取次ぎの申込みをし、かつ、当該指定清算参加者が当該有価証券等清算取次ぎの受託をしたこととする旨

(2) その他本取引所が定める事項

3 取引所株価指数証拠金取引に係る非清算参加者は、証拠金他社清算参加者との間で、次に掲げる事項を記載した本取引所が定める様式による清算委託契約を締結しなければならない。

(1) 取引所株価指数証拠金取引に係る非清算参加者がその指定清算参加者を代理して取引所株価指数証拠金取引を成立させようとするときは、当該非清算参加者が有価証券等清算取次ぎの申込みをし、かつ、当該指定清算参加者が当該有価証券等清算取次ぎの受託をしたこととする旨

(2) その他本取引所が定める事項

4 非清算参加者のなした呼び値につき業務規程又は株価指数特例の定める条件が満たされたときは、当該非清算参加者の計算により、指定清算参加者の名において本取引所の市場における市場デリバティブ取引が成立するものとし、当該指定清算参加者は当該市場デリバティブ取引につき自ら権利を取得し、義務を負うものとする。

5 非清算参加者がその指定清算参加者の名において業務規程第20条の10に規定するギブアップにより発生させた市場デリバティブ取引及び清算建玉について、当該指定清算参加者は、当該市場デリバティブ取引及び清算建玉につき自ら権利を取得し、義務を負うものとする。

6 清算参加者は、清算委託契約を締結した場合は、本取引所が定めるところにより、その旨を本取引所に届け出なければならない。

7 清算委託契約の解約（本取引所が別に定める場合を除く。）は、本取引所の承認を受けなければ、その効力を生じない。

（平成16年4月1日 追加、平成17年7月1日、平成19年9月30日、平成20年4月28日、平成22年10月1日、平成27年11月2日、平成29年2月27日 変更）

### （清算委託に係る区分経理）

第17条 金利先物等取引に係る指定清算参加者は、自己の名において成立した金利先物等取引のうち、非清算参加者のなした呼び値により成立した金利先物等取引と自己の呼び値により成立した金利先物等取引とを、区分して経理しなければならない。

2 金利先物等取引に係る指定清算参加者は、自己の名において発生した清算建玉のうち、非清算参加者の計算により発生した清算建玉と、自己の計算により発生した清算建玉とを、区分して経理しなければならない。

3 取引所為替証拠金取引又は取引所株価指数証拠金取引に係る指定清算参加者は、自己の名において成立した取引所為替証拠金取引又は取引所株価指数証拠金取引のうち、非清算参加者の呼び値により成立した取引と自己の呼び値により成立した取引とを、区分して経理しなければならない。

(平成16年4月1日 追加、平成19年9月30日、平成22年10月1日、平成29年2月27日 変更)

### **(指定清算参加者の変更等における市場デリバティブ取引)**

第18条 本取引所は、指定清算参加者の変更をした場合には、本取引所が指定する日時をもって、変更前の指定清算参加者の本取引所の市場における自己のなした呼び値により成立した市場デリバティブ取引で未決済のものを変更後の指定清算参加者に引き継がせるものとする。

(平成16年4月1日 追加、平成19年9月30日 変更)

### **(清算委託契約の解約の承認申請)**

第19条 清算参加者が、清算委託契約を解約したときは、本取引所が別に定めるところにより、その解約の承認申請を行わなければならない。

2 本取引所は、清算委託契約の解約の承認申請を受理した場合は、本取引所の市場の運営上適当かつ必要と認めるときに限り、これを承認するものとする。

(平成16年4月1日 追加、平成17年7月1日 変更)

### **(清算委託契約の解約の場合における非清算参加者の市場デリバティブ取引)**

第20条 本取引所は、前条第2項の規定により清算委託契約の解約を承認したときは、当該清算委託契約の当事者の一方である非清算参加者が本取引所の市場において自己のなす呼び値により当該清算委託契約の相手方である清算参加者の名において成立させる市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けを停止するものとする。

2 本取引所は、前項の規定により市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けを停止したときは、当該非清算参加者の本取引所の市場における自己のなした呼び値により当該清算参加者の名において成立した市場デリバティブ取引で未決済のものについて、他の清算参加者への引継ぎその他本取引所が必要と認める整理を行わせることができる。

3 第1項の規定にかかわらず、当該非清算参加者が前項の規定による整理を行うために必要とする限度において、本取引所は、当該非清算参加者が本取引所の市場において自己のなす呼び値により当該清算参加者の名において成立させる市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けを行うことができる。

4 本取引所は、第1項の規定により市場デリバティブ取引に基づく債務の引受けを停止したときは、当該非清算参加者の計算により発生した清算建玉で未決済のものについて、他の清算参加者への引継ぎその他本取引所が必要と認める整理を行わせることができる。

5 第3項の規定は、前項に規定する整理について準用する。

(平成16年4月1日 追加、平成19年9月30日 変更)

## 第4章 債務の引受け

(平成16年4月1日 追加)

### 第1節 市場デリバティブ取引の清算

(平成16年4月1日 追加、平成19年9月30日 変更)

#### (市場デリバティブ取引の清算)

第21条 本取引所は、本取引所の市場において市場デリバティブ取引が成立したときは、市場デリバティブ取引を円滑にするため、次条、第24条、第25条又は第26条の定めるところにより、清算参加者に代わって当該清算参加者の当該市場デリバティブ取引に基づく債務を引き受け、当該債務に対当する新たな債権を取得し、又はオプションの付与者としての地位を承継し、当該オプションに対当する新たなオプションの取得者としての地位に立つものとし、当該市場デリバティブ取引について当該清算参加者との間で清算を行うものとする。

(平成16年4月1日 追加、平成19年9月30日、平成22年10月1日 変更)

#### (取引所による市場デリバティブ取引に基づく債務の引受け)

第22条 本取引所と清算参加者との間での債務の引受けは次に掲げる方法による。

- (1) 業務規程、為替特例及び株価指数特例で定めるところにより市場デリバティブ取引が成立したときは、当該市場デリバティブ取引の売付取引及び買付取引について、本取引所は売付取引をなした清算参加者がその取引の相手方として買付取引をなした清算参加者に対し負担する債務を免責的に引き受け、当該売付取引をなした清算参加者は本取引所により引き受けられた当該債務と同一内容の債務を新たに本取引所に対し負担し、かつ、本取引所は、買付取引をなした清算参加者がその取引の相手方として売付取引をなした清算参加者に対し負担する債務を免責的に引き受け、当該買付取引をなした清算参加者は本取引所により引き受けられた当該債務と同一内容の債務を新たに本取引所に対し負担するものとする。
- (2) ユーロ円3ヵ月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。)の定めるところによりユーロ円3ヵ月金利先物オプション取引が成立したときは、本取引所は売付取引をなした清算参加者のその取引の相手方として買付取引をなした清算参加者に対するユーロ円3ヵ月金利先物オプションの付与者としての地



位を承継し（ただし、オプション料請求権を除く。）、当該売付取引をなした清算参加者は本取引所に対して、本取引所によりその付与者としての地位が承継された当該ユーロ円 3 ヶ月金利先物オプションと同一内容のあらたなユーロ円 3 ヶ月金利先物オプションの付与者の地位に立つものとし、この場合、本取引所は、当該買付取引をなした清算参加者が当該売付取引をなした清算参加者に対し負担するオプション料支払債務を免責的に引き受け、当該買付取引をなした清算参加者は本取引所により引き受けられた当該債務と同一内容の債務をあらたに本取引所に対し負担するものとする。

（平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 17 年 7 月 1 日、平成 19 年 9 月 30 日、平成 22 年 10 月 1 日、平成 27 年 11 月 2 日 変更）

## 第 2 節 清算建玉の清算

（平成 16 年 4 月 1 日 追加）

### （清算建玉の清算）

第 23 条 本取引所は、本取引所の市場における清算建玉につき、自己の名において発生させた清算参加者との間で清算を行う。

（平成 16 年 4 月 1 日 追加）

### （取引所及び清算参加者による清算建玉に基づく債務の引受け）

第 24 条 業務規程第 21 条第 2 項の定めるところにより清算参加者との間に清算建玉が発生したときは、業務規程第 2 条第 4 号に定める提携外国清算機関が業務規程第 21 条第 1 項に定める外国建玉につき業務規程第 2 条第 9 号イに規定する受管契約の当事者である提携外国取引所の会員（当該清算参加者の外国の本店又は支店を含む。）に対して有しかつ負担していた債権債務と同一内容の債権債務を、本取引所は当該清算参加者に対してあらたに取得しかつ負担し、当該清算参加者は、当該提携外国取引所の当該会員が当該外国建玉につき当該提携外国清算機関に対して有しかつ負担していた債権債務と同一内容の債権債務を、本取引所に対して取得しかつ負担することで、本取引所は当該清算参加者との間で清算を行うものとする。

2 業務規程第 21 条第 3 項の定めるところにより清算参加者との間に清算建玉が発生したときは、提携外国清算機関が業務規程第 21 条第 1 項に定める外国建玉につき業務規程第 2 条第 9 号ロに規定する受管契約の当事者である提携外国取引所の会員（当該清算参加者の外国の本店又は支店を含む。）に対して有しかつ負担していた債権債務と同一内容の債権債務を、本取引所は当該清算参加者に対してあらたに取得しかつ負担し、当該清算参加者は、当該提携外国取引所の当該会員が当該外国建玉につき当該提携外国清算機関に対して有しかつ負担していた債権債務と同一内容の債権債務を、本取引所に対して取得しかつ負担することで、本取引所は当該清算参加者との間で清算を行うものとする。

(平成16年4月1日 追加、平成19年9月30日 変更)

### 第3節 ギブアップに係る市場デリバティブ取引及び清算建玉の清算

(平成16年4月1日 追加、平成19年9月30日 変更)

#### (ギブアップに係る市場デリバティブ取引及び清算建玉の清算)

第24条の2 本取引所は、ギブアップにより発生した市場デリバティブ取引及び清算建玉につき、自己の名において発生させた清算参加者との間で清算を行うものとする。

(平成16年4月1日 追加、平成19年9月30日 変更)

#### (ギブアップに係る市場デリバティブ取引の消滅及び発生、取引所及び注文執行取引参加者の債権債務の消滅並びに取引所及び清算執行取引参加者による債権債務の取得及び負担)

第25条 業務規程第20条の10の定めるところによりギブアップに係る市場デリバティブ取引又は清算建玉が消滅及び発生したときは、当該消滅した市場デリバティブ取引又は清算建玉につき本取引所及び業務規程第2条第33号に定める注文執行取引参加者(当該注文執行取引参加者が非清算参加者である場合にはその指定清算参加者。以下本条において同じ。)が相互に有しかつ負担していた債権債務が消滅し、本取引所は、当該消滅した市場デリバティブ取引又は清算建玉につき当該注文執行取引参加者に対して有しかつ負担していた債権債務と同一内容の債権債務を業務規程第2条第34号に定める清算執行取引参加者(当該清算執行取引参加者が非清算参加者である場合にはその指定清算参加者。以下「当該清算執行取引参加者の計算により」とある場合を除き本条において同じ。)に対してあらたに取得しかつ負担し、当該清算執行取引参加者は、当該消滅した市場デリバティブ取引又は清算建玉につき当該注文執行取引参加者が本取引所に対して有しかつ負担していた債権債務と同一内容の債権債務を、当該清算執行取引参加者の計算により本取引所に対してあらたに取得しかつ負担することで、本取引所は当該清算参加者との間で清算を行うものとする。

(平成16年4月1日 追加、平成17年7月1日、平成19年9月30日 変更)

#### (ギブアップに係るユーロ円3ヵ月金利先物オプション取引の消滅及び発生並びに取引所、注文執行取引参加者及び清算執行取引参加者による契約上の地位の消滅及び発生等)

第26条 オプション特例第15条の2の定めるところによりギブアップに係る市場デリバティブ取引又は清算建玉が消滅及び発生したときは、次に掲げる方法により本取引所は債務を引き受ける。

- (1) ギブアップにより消滅したユーロ円3ヵ月金利先物オプション取引が売付取引の場合には、当該消滅した売付取引につき注文執行取引参加者（当該注文執行取引参加者が非清算参加者である場合にはその指定清算参加者。以下本条において同じ。）が本取引所に対し有していたユーロ円3ヵ月金利先物オプションの付与者としての地位が消滅し、清算執行取引参加者（当該清算執行取引参加者が非清算参加者である場合にはその指定清算参加者。以下「当該清算執行取引参加者の計算により」とある場合を除き本条において同じ。）が、当該その付与者としての地位が消滅したユーロ円3ヵ月金利先物オプションと同一内容のユーロ円3ヵ月金利先物オプションの付与者としての地位に当該清算執行取引参加者の計算により本取引所に対してあらたに立つものとする。この場合、当該消滅した売付取引につき本取引所が注文執行取引参加者に対し負担するオプション料支払債務が消滅し、本取引所は、当該消滅した債務と同一内容の債務を、当該清算執行取引参加者に対してあらたに負担するものとする。
- (2) ギブアップにより消滅したユーロ円3ヵ月金利先物オプション取引が買付取引の場合には、当該消滅した買付取引につき、本取引所が当該注文執行取引参加者に対し有するユーロ円3ヵ月金利先物オプションの付与者としての地位が消滅し、本取引所は当該その付与者としての地位が消滅したユーロ円3ヵ月金利先物オプションと同一内容のユーロ円3ヵ月金利先物オプションの付与者としての地位に当該清算執行取引参加者に対してあらたに立つものとする。この場合、当該消滅した買付取引につき注文執行取引参加者が本取引所に対し負担するオプション料支払債務が消滅し、当該清算執行取引参加者は、当該消滅した債務と同一内容の債務を、当該清算執行取引参加者の計算により本取引所に対してあらたに負担することで、本取引所は当該清算参加者との間で清算を行うものとする。

(平成16年4月1日 追加、平成17年7月1日、平成19年9月30日 変更)

## 第5章 市場デリバティブ取引に係る債務の履行義務

(平成16年4月1日 追加、平成19年9月30日 変更)

### (本取引所の責任)

第27条 本取引所は、本取引所の市場において成立した市場デリバティブ取引については、清算参加者に対してのみ債務の履行責任を負うものとする。

(平成16年4月1日 追加、平成19年9月30日 変更)

### (提携に係る本取引所の責任)

第28条 本取引所は、発生した清算建玉については、清算参加者に対してのみ債務の履行責任

を負う。

- 2 本取引所は、本取引所が別に定める金銭について、提携外国清算機関に対して債務の履行責任を負う。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 19 年 9 月 30 日 変更)

#### **(ギブアップにより発生した市場デリバティブ取引等の取扱い)**

第 29 条 ギブアップにより発生した市場デリバティブ取引は、本取引所の市場において成立した市場デリバティブ取引とみなす。

- 2 ギブアップにより発生した清算建玉は、本取引所の市場において発生した清算建玉とみなす。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 19 年 9 月 30 日 変更)

### **第 6 章 証拠金及び未決済取引の引継ぎ等**

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 17 年 7 月 1 日 変更)

#### **(証拠金及び未決済取引の引継ぎ等)**

第 30 条 本取引所が行う金融商品債務引受業における証拠金等に関する事項は、当該金融商品債務引受業が金利先物等取引及び清算建玉に係るときは、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。）、当該金融商品債務引受業が取引所為替証拠金取引に係るときは、取引所為替証拠金取引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「為替証拠金規則」という。）、当該金融商品債務引受業が取引所株価指数証拠金取引に係るときは、取引所株価指数証拠金取引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「株価指数証拠金規則」という。）をもって定める。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 17 年 7 月 1 日、平成 19 年 9 月 30 日、平成 22 年 10 月 1 日 変更)

### **第 7 章 清算預託金**

(平成 16 年 4 月 1 日 追加)

#### **(清算預託金の預託)**

第 31 条 清算参加者は、本取引所が定めるところにより、清算預託金を本取引所に預託しなければならない。この場合において清算参加者は、清算資格の種類に応じて、以下の各号に規定する清算預託金の種類に区分して預託するものとする。

- (1) 金利先物等清算参加者の預託する清算預託金（以下「金利先物等清算預託金」という。）
  - (2) 証拠金清算参加者の預託する清算預託金（以下「証拠金取引清算預託金」という。）
- 2 預託すべき金利先物等清算預託金の額は、本取引所が別に定めるところにより算出する額とする。ただし、この額が 5,000 万円を下回る場合は、5,000 万円を預託すべき金利先物等清算預託金の額とする。
  - 3 預託すべき証拠金取引清算預託金の額は、本取引所が別に定めるところにより算出する額とする。
  - 4 清算預託金は、円通貨のほか、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。
  - 5 清算参加者は、清算預託金の返還請求権を、他の者に譲渡し、譲渡の予約をし又は担保の目的に供することができない。

（平成 16 年 4 月 1 日、平成 17 年 7 月 1 日、平成 19 年 9 月 30 日、平成 20 年 6 月 2 日、平成 20 年 7 月 31 日、平成 21 年 7 月 3 日、平成 22 年 4 月 1 日、平成 22 年 10 月 1 日、平成 22 年 11 月 22 日、平成 27 年 7 月 3 日、平成 29 年 2 月 27 日 変更）

#### （清算資格の取得に伴う清算預託金の額）

- 第 32 条 金利先物等清算資格の取得の承認を受けた者が第 4 条第 4 項の規定により預託する金利先物等清算預託金の額は、5,000 万円を基準として、本取引所が適当と認める額とする。
- 2 証拠金清算資格の取得の承認を受けた者が第 4 条第 4 項の規定により預託する証拠金取引清算預託金の額は、500 万円を基準として、本取引所が適当と認める額とする。

（平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 17 年 7 月 1 日、平成 20 年 7 月 31 日、平成 22 年 4 月 1 日、平成 22 年 10 月 1 日、平成 27 年 7 月 3 日、平成 29 年 2 月 27 日 変更）

#### （清算預託金の額の変更）

- 第 33 条 本取引所は、本取引所の市場におけるリスクを適切に管理する場合その他本取引所が必要と認める場合は、第 31 条第 2 項から第 3 項までに規定する清算預託金の額を臨時に変更することができる。
- 2 本取引所は、複数の清算参加者が合併する場合その他本取引所が必要と認める場合は、特定の清算参加者が預託する清算預託金の額を臨時に変更することができる。

（平成 20 年 7 月 31 日追加、平成 21 年 7 月 3 日、平成 29 年 2 月 27 日 変更）

#### 第 34 条 削除

（平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 17 年 7 月 1 日、平成 21 年 7 月 3 日 変更）

### **(清算預託金の復元)**

第35条 本取引所が第40条から第41条までの規定により清算預託金をもって損失の補填に充てた場合において、当該損失の補填により清算預託金の額が預託すべき清算預託金の額を下回ったときは、当該損失の補填に係る清算資格を有する清算参加者は、取締役会の決議により本取引所が定める期日までに、その差額を清算預託金として預託しなければならない。

(平成16年4月1日 追加、平成17年7月1日、平成27年7月3日 変更)

### **(清算預託金の返還)**

第36条 清算参加者は、本取引所に預託した各清算預託金の額のうち、当該清算参加者の預託すべき清算預託金の額をこえる部分の返還を、本取引所が定めるところにより、請求することができる。

2 前項の請求があった場合において、本取引所が特に必要があると認めるときは、当該清算参加者の預託すべき各清算預託金の額をこえる部分の返還を停止することができる。

(平成16年4月1日 追加、平成17年7月1日 変更)

### **(清算資格喪失の場合の清算預託金の返還)**

第37条 本取引所は、清算参加者が清算資格を喪失したときは、その喪失の日以降当該喪失に係る清算資格に関する清算預託金の返還を行うものとする。

2 前項の場合において、本取引所が特に必要があると認めるときは、その清算預託金の返還を停止することができる。

(平成16年4月1日 追加、平成17年7月1日 変更)

### **(合併の場合の清算預託金の承継)**

第38条 清算参加者につき合併があったときは、合併により存続し、又は新設された法人は、合併前に生じた当該清算参加者の清算預託金に係る権利義務を承継するものとする。

(平成16年4月1日 追加)

### **(清算預託金の管理及び運用)**

第39条 本取引所は、口座を区分する等の方法により、清算預託金を自己の固有の財産と分別して保管し、清算参加者及び第31条第1項に規定する清算預託金の種類ごとに区分して帳簿により管理するものとする。

2 本取引所は、金銭による清算預託金の預託を受けたときは、次の各号に掲げる方法により運

用するものとする。

- (1) 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券又は社債券の保有
  - (2) 金融機関への預貯金
  - (3) 信託業務を営む銀行への金銭信託(元本の補填の契約のあるものに限る。)
- 3 本取引所は、前項の清算預託金の運用により収益が生じたときは、本取引所が定めるところにより、これを金銭により預託した清算参加者に返戻するものとする。

(平成16年4月1日 追加、平成17年7月1日、平成20年7月31日 変更)

## 第8章 債務の引受けによる損失の補填

(平成16年4月1日 追加)

### (金利先物等清算参加者の違約による損失の補填)

第40条 本取引所は、本取引所の市場における金利先物等取引及び清算建玉について、金利先物等清算参加者の債務不履行により本取引所が損失を受けたときは、当該金利先物等清算参加者の預託金のうち、以下の各号に掲げるもので、当該債務不履行のなされた金利先物等取引及び清算建玉に係る取引資格又は当該取引資格に係る清算資格に関して預託されているものにより損失を補填するものとする。

- (1) 当該金利先物等清算参加者が本取引所に預託している自己取引に係る取引証拠金
  - (2) 当該金利先物等清算参加者が取引参加者規程第12条の規定に基づき本取引所に預託している信認金(委託者が優先弁済権を行使したときはその残額)
  - (3) 当該金利先物等清算参加者が第31条第1項の規定に基づき本取引所に預託している清算預託金
  - (4) 当該金利先物等清算参加者が本取引所に預託しているその他の預託金
  - (5) 当該金利先物等清算参加者が返還請求権を有する受託取引及び清算委託取引に係る取引証拠金
- 2 本取引所は、前項の規定により損失を補填した後、なお不足がある場合には、前項各号に掲げる預託金のうち、当該債務不履行のなされた金利先物等取引及び清算建玉に係る取引資格以外又は当該取引資格に係る清算資格以外に関して預託されているものであっても、当該預託金によって損失を補填するものとする。
- 3 本取引所は、前項の規定により損失を補填した後、なお不足があるときは、金利先物等違約損失積立金をもって当該損失を補填するものとする。
- 4 本取引所は、前3項の規定により損失を補填した後、なお不足があるときは、当該債務不履行のなされた金利先物等取引及び清算建玉に係る清算資格を有する他の金利先物等清算参加者が当該清算資格に基づいて本取引所に預託している金利先物等清算預託金をもって損失を

補填するものとする。

- 5 前項の規定により損失を補填するときは、本取引所は、当該債務不履行のなされた金利先物等取引及び清算建玉に係る清算資格を有する各金利先物等清算参加者に対して、その預託すべき金利先物等清算預託金の額に応じて、損失を負担させるものとする。
- 6 第4項の規定により損失を補填した後、なお不足があるときは、本取引所は、当該債務不履行のなされた金利先物等取引及び清算建玉に係る清算資格を有する他の清算参加者をして、第31条第2項の規定による預託すべき清算預託金の額のほか、取締役会の決議により定める額を、臨時に清算預託金として預託させ、当該清算預託金をもって損失を補填することができる。
- 7 本取引所は、提携契約に基づき本取引所が提携外国清算機関から受け取るべき金銭の未収により本取引所が損失を受けたときは、本取引所の金利先物等違約損失積立金によりその損失を補填する。
- 8 本取引所は、前項の規定により損失を補填した後、なお不足があるときは、金利先物等清算参加者が本取引所に預託している金利先物等清算預託金をもって損失を補填する。
- 9 本取引所は、第1項から前項までに規定する損失の補填について、代用有価証券を換価処分する必要がある場合には、本取引所が相当と認める方法、時期、場所、価格等によりこれを任意に処分し、その取得金から諸費用を差し引いた残額によって当該損失を補填するものとする。

(平成16年4月1日 追加、平成17年7月1日、平成19年9月30日、平成21年9月30日、平成22年10月1日、平成23年7月1日、平成27年7月3日、平成29年7月3日 変更)

#### **(証拠金清算参加者の違約による損失の補填)**

第40条の2 本取引所は、本取引所の市場における取引所為替証拠金取引又は取引所株価指数証拠金取引について、証拠金清算参加者の債務不履行により本取引所が損失を受けたときは、当該証拠金清算参加者の預託金のうち、以下の各号に掲げるもので、当該債務不履行のなされた取引所為替証拠金取引又は取引所株価指数証拠金取引に係る取引資格又は当該取引資格に係る清算資格に関して預託されているものにより損失を補填するものとする。

- (1) 当該証拠金清算参加者が本取引所に預託している自己取引に係る取引証拠金
  - (2) 当該証拠金清算参加者が取引参加者規程第12条の規定に基づき本取引所に預託している信認金（委託者が優先弁済権を行使したときはその残額）
  - (3) 当該証拠金清算参加者が第31条第1項の規定に基づき本取引所に預託している清算預託金
  - (4) 当該証拠金清算参加者が本取引所に預託しているその他の預託金
  - (5) 当該証拠金清算参加者が返還請求権を有する受託取引に係る取引証拠金
- 2 本取引所は、前項の規定により損失を補填した後、なお不足がある場合には、前項各号に掲げる預託金のうち、当該債務不履行のなされた取引所為替証拠金取引若しくは取引所株価指数証拠金取引に係る取引資格以外又は証拠金清算資格以外に関して預託されているものであ



っても、当該預託金によって損失を補填するものとする。

- 3 本取引所は、前項の規定により損失を補填した後、なお不足があるときは、証拠金取引違約損失積立金をもって当該損失を補填するものとする。
- 4 本取引所は、前3項の規定により損失を補填した後、なお不足があるときは、当該債務不履行のなされた取引所為替証拠金取引又は取引所株価指数証拠金取引に係る清算資格を有する他の証拠金清算参加者（以下本条において「他の証拠金清算参加者」という。）が当該清算資格に基づいて本取引所に預託している証拠金取引清算預託金をもって損失を補填するものとする。
- 5 前項の規定により証拠金取引清算預託金をもって損失を補填するときは、本取引所は、他の証拠金清算参加者に対して、その預託すべき証拠金取引清算預託金の額に応じて、損失を負担させるものとする。
- 6 第4項の規定により損失を補填した後、なお不足があるときは、本取引所は、他の証拠金清算参加者をして、第31条第3項の規定による預託すべき清算預託金の額のほか、取締役会の決議により定める額を、臨時に清算預託金として預託させ、当該清算預託金をもって損失を補填することができる。
- 7 本取引所は、第1項から前項までに規定する損失の補填について、代用有価証券を換価処分する必要がある場合には、本取引所が相当と認める方法、時期、場所、価格等によりこれを任意に処分し、その取得金から諸費用を差し引いた残額によって当該損失を補填するものとする。

（平成27年7月3日 追加、平成27年11月2日、平成29年2月27日、平成29年7月3日 変更）

### 第40条の3（削除）

（平成27年7月3日 追加、平成27年11月2日、平成29年2月27日 変更）

### （債務の引受けによるその他の損失の補填）

- 第41条 本取引所は、第40条第1項又は第40条の2第1項に規定する原因以外の理由で、第21条の規定による債務の引受けにより損失が生じたときは、金利先物等取引に係る債務の引受けにより生じた損失については金利先物等違約損失積立金をもって当該損失を補填するものとし、取引所為替証拠金取引又は取引所株価指数証拠金取引に係る債務の引受けにより生じた損失については証拠金取引違約損失積立金をもって当該損失を補填するものとする。
- 2 本取引所は、前項の規定により損失を補填した後、なお不足があるときは、当該損失発生の原因となった債務の引受けに係る市場デリバティブ取引及び清算建玉に係る清算資格を有する清算参加者が本取引所に預託している清算預託金をもって損失を補填することができる。
- 3 第40条第4項から第6項まで及び第9項並びに第40条の2第4項から第7項までの規定は、前項の場合について準用する。
- 4 本取引所は、第24条の規定に基づく債務の負担により損失が生じたときは、第40条第7項

に規定する場合を除き、本取引所の金利先物等違約損失積立金によりその損失を補填するものとする。

- 5 第40条第4項から第6項まで及び第8項、第9項の規定は、前項の規定により損失を補填した後なお不足があるときについて準用する。

(平成16年4月1日 追加、平成17年7月1日、平成19年9月30日、平成21年9月30日、平成23年7月1日、平成27年7月3日、平成29年2月27日 変更)

## 第9章 転売又は買戻し

(平成16年4月1日 追加)

### (転売又は買戻し)

第42条 清算参加者は、自己のなした呼び値により自己の名において成立した市場デリバティブ取引又は自己の名において発生した清算建玉（業務規程第21条第3項に定める清算受託建玉は除く。）に係る売建玉又は買建玉について、当該売建玉を減じるための買付取引を成立若しくは清算買建玉を発生させたとき（以下第12章を除き当該買付取引を成立又は当該清算買建玉を発生させることを「買戻し」という。）又は当該買建玉を減じるための売付取引を成立若しくは清算売建玉を発生させたとき（以下第12章を除き当該売付取引を成立又は当該清算売建玉を発生させることを「転売」という。）は、転売又は買戻しの別及び数量を本取引所に申告するものとする。

- 2 本取引所は、前項の申告を受付けた場合には、当該申告に係る転売又は買戻しの数量を、決済に係るものとして、当該清算参加者の売建玉又は買建玉から減じるものとする。
- 3 前項の規定にかかわらず、本取引所は、申告された転売又は買戻しの数量が、当該取引日（業務規程第2条第24号に規定する取引日をいう。以下、別途の定めがある場合を除き同じ。）に成立させた市場デリバティブ取引の数量を上回る等、本取引所が別に定めるところにより、適当でないと認めた場合は、当該申告数量を修正することができる。
- 4 前3項の規定は、取引所為替証拠金取引及び取引所株価指数証拠金取引については、適用しない。

(平成16年4月1日 追加、平成17年7月1日、平成19年9月30日、平成20年10月27日、平成22年10月1日 変更)

### (非清算参加者による転売又は買戻し)

第43条 非清算参加者は、業務規程第17条に定める有価証券等清算取次ぎ若しくは清算受託建玉に係る指定清算参加者の売建玉（以下第12章及び第13章を除き「清算受託売建玉」と

いう。)又は有価証券等清算取次ぎ若しくは清算受託建玉に係る指定清算参加者の買建玉(以下第12章及び第13章を除き「清算受託買建玉」という。)に係る買戻し又は転売を行ったときは、転売又は買戻しの別及び数量を当該指定清算参加者に代わって本取引所に申告するものとする。ただし、当該指定清算参加者が自ら申告することを妨げない。

- 2 本取引所は、前項の申告を受付けた場合には、当該申告に係る転売又は買戻しの数量を、決済に係るものとして、当該指定清算参加者の清算受託売建玉又は清算受託買建玉から減じるものとする。
- 3 前項の規定にかかわらず、本取引所は、申告された転売又は買戻しの数量が、当該取引日に成立させた市場デリバティブ取引の数量を上回る等、本取引所が別に定めるところにより、適当でないと認めた場合は、当該申告数量を修正することができる。
- 4 非清算参加者が第1項の申告を行ったときは、遅滞なくその旨を指定清算参加者に通知しなければならない。
- 5 前各項の規定は、取引所為替証拠金取引及び取引所株価指数証拠金取引については、適用しない。

(平成16年4月1日 追加、平成17年7月1日、平成19年9月30日、平成22年10月1日、平成29年2月27日 変更)

#### **(転売又は買戻しに関する事項)**

第44条 この方法書に定めるもののほか、転売又は買戻しの申告の方法及び時限並びに申告内容の訂正に関し必要な事項については、本取引所が別に定めるところによる。

(平成16年4月1日 追加)

## **第10章 金利先物等取引及び清算建玉に係る値洗い**

(平成16年4月1日 追加、平成17年7月1日、平成19年9月30日 変更)

#### **(清算価格)**

第45条 本取引所は、金利先物等取引及び清算建玉に関して、各取引日の日中取引時間帯終了後、限月取引ごとに、当該取引日の取引証拠金、非清算参加者証拠金及び委託証拠金の算出基準となる数値又は値段(以下「清算価格」という。)を定め、清算参加者及び非清算参加者に通知するものとする。

- 2 前項の清算価格は、当該取引日の日中取引時間帯終了前の本取引所が別に定める時間帯(以下「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金利先物等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金利先物等取引の約定価格及び取引数量を除く。次項において、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。

ただし、本取引所は、当該加重平均により算出した価格が適正でないと判断した場合には、本取引所が適正であると認める価格を清算価格とする。

- 3 当該算出基準時間帯に約定価格がない場合には、本取引所が別に定めるところによるものとする。
- 4 前2項の規定にかかわらず、取引最終日が到来した限月取引（無担保コールオーバーナイト金利先物に係る限月取引を除く。）の当該取引最終日の清算数値は、第55条、第70条、第72条、第74条、第76条及び第76条の7の規定により算出された差金決済数値とする。

（平成16年4月1日 追加、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19年12月3日、平成23年12月1日、平成24年4月23日 変更）

### （約定価格又は受管数値と清算価格との差に基づく金銭の授受）

第46条 あらたに成立した売付取引若しくは買付取引について、当該取引が成立した取引日の清算価格と当該取引の約定価格とを比較して差が生じたとき、又はあらたに発生した清算売建玉若しくは清算買建玉について、当該建玉が発生した取引日の清算価格と当該建玉の受管数値とを比較して差が生じたときは、清算参加者はその差に基づいて算出した金銭を当該取引日の日中取引時間帯の属する営業日の翌営業日（日本の銀行休業日にあたるときは、順次繰り下げる。以下、別途の定めがある場合を除き同じ。）の本取引所が別に定める時刻までに、本取引所が第98条の規定により定めた金融機関（以下「決済銀行」という。）に開設した預金口座を通じ、本取引所との間で授受するものとする。

- 2 あらたに成立した有価証券等清算取次ぎに係る売付取引若しくは買付取引について、当該取引が成立した取引日の清算価格と当該取引の約定価格とを比較して差が生じたとき、又はあらたに発生した清算受託建玉に係る清算売建玉若しくは清算買建玉について、当該建玉が発生した取引日の清算価格と当該建玉の受管数値とを比較して差が生じたときは、非清算参加者はその差に基づいて算出した金銭を当該取引日の日中取引時間帯の属する営業日の翌営業日（ユーロ円先物遠隔地取引参加者である非清算参加者にあつては、原則として翌々営業日（日本の銀行休業日にあたるときは、順次繰り下げる。以下同じ。））の本取引所が別に定める時刻までに、指定清算参加者との間で授受するものとする。

（平成16年4月1日 追加、平成19年9月30日、平成20年4月28日、平成21年6月1日 変更）

### （清算価格間の差に基づく金銭の授受）

第47条 一の取引日の前取引日までに成立した金利先物等取引又は発生した清算建玉に係る売建玉又は買建玉について、当該取引日の清算価格と前取引日の清算価格とを比較して差が生じたときは、清算参加者はその差に基づいて算出した金銭を当該取引日の日中取引時間帯の属する営業日の翌営業日の本取引所が別に定める時刻までに、決済銀行に開設した預金口座を通じ、本取引所との間で授受するものとする。

- 2 一の取引日の前取引日までに成立した有価証券等清算取次ぎ又は発生した清算受託建玉に

係る清算受託売建玉又は清算受託買建玉について、当該取引日の清算価格と前取引日の清算価格とを比較して差が生じたときは、非清算参加者はその差に基づいて算出した金銭を当該取引日の日中取引時間帯の属する営業日の翌営業日（ユーロ円先物遠隔地取引参加者である非清算参加者にあつては、原則として翌々営業日）の本取引所が別に定める時刻までに、指定清算参加者との間で授受するものとする。

（平成16年4月1日 追加、平成19年9月30日、平成20年4月28日、平成21年6月1日 変更）

### （値洗いのために授受する金銭の額）

第48条 前2条の規定により差が生じたときは、その差（以下「値洗い価格差」という。）に基づく取引単位あたりの金銭の額は、金融指標等ごとに、次の算式により算出する。

(1) ユーロ円3ヵ月金利先物

$1 \text{ 億円} \times \text{値洗い価格差の絶対値} \times 100 \text{ 分の } 1 \times 360 \text{ 日分の } 90 \text{ 日}$

(2) 2年円金利スワップ先物、5年円金利スワップ先物、7年円金利スワップ先物及び10年円金利スワップ先物

$1,000 \text{ 万円} \times \text{値洗い価格差の絶対値} \times 100 \text{ 分の } 1$

(3) 無担保コールオーバーナイト金利先物

$3 \text{ 億円} \times \text{値洗い価格差の絶対値} \times 100 \text{ 分の } 1 \times 360 \text{ 日分の } 30 \text{ 日}$

(4) ユーロ円LIBOR6ヵ月金利先物

$1 \text{ 億円} \times \text{値洗い価格差の絶対値} \times 100 \text{ 分の } 1 \times 360 \text{ 日分の } 180 \text{ 日}$

（平成16年4月1日 追加、平成17年12月20日、平成18年7月3日、平成19年12月3日、平成21年6月1日、平成23年12月1日、平成24年4月23日 変更）

### （総受入金額及び総支払金額）

第49条 値洗い価格差が負の数となる売付取引、清算売建玉若しくは売建玉又は値洗い価格差が正の数となる買付取引、清算買建玉若しくは買建玉について、前条の規定により算出した金銭の額は、本取引所と清算参加者との間においては清算参加者の、指定清算参加者と非清算参加者との間においては非清算参加者の総受入金額に算入するものとする。

2 値洗い価格差が正の数となる売付取引、清算売建玉若しくは売建玉又は値洗い価格差が負の数となる買付取引、清算買建玉若しくは買建玉について、前条の規定により算出した金銭の額は、本取引所と清算参加者との間においては清算参加者の、指定清算参加者と非清算参加者との間においては非清算参加者の総支払金額に算入するものとする。

3 第46条第1項及び第47条第1項の規定により本取引所と清算参加者の間で授受する金銭の額は、同一清算参加者の総受入金額と総支払金額の差引額とする。

4 第46条第2項及び第47条第2項の規定により指定清算参加者と非清算参加者の間で授受する金銭の額は、同一非清算参加者の総受入金額と総支払金額の差引額とする。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 17 年 12 月 20 日 変更)

### **(値洗いに関する細則)**

第 50 条 この方法書に定めるもののほか、値洗いに関し必要な事項については、本取引所が定める。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加)

## **第 11 章 金利先物等取引及び清算建玉に係る最終決済**

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 17 年 7 月 1 日、平成 19 年 9 月 30 日 変更)

### **第 1 節 総則**

(平成 16 年 4 月 1 日 追加)

#### **(最終決済)**

- 第 51 条 清算参加者は、金利先物等取引及び清算建玉に関して、各限月取引について、取引最終日までに第 42 条に定める転売又は買戻しを行わなかった売建玉（以下「最終売建玉」という。）又は買建玉（以下「最終買建玉」という。）がある場合には、当該最終売建玉及び当該最終買建玉について、次条に定める方法により本取引所が算出した数値（以下「差金決済数値」という。）と取引最終日に成立した金利先物等取引の約定数値、取引最終日に発生した清算建玉の受管数値又は前取引日の清算数値との差（無担保コールオーバーナイト金利先物にあっては、差金決済数値と取引最終日における清算数値との差）（以下「差金決済数値差」という。）に基づいて算出した金銭を授受することによる決済（以下「差金決済」という。）により、金融指標等の決済（以下「最終決済」という。）を行うものとする。
- 2 非清算参加者は、各限月取引について、取引最終日までに第 43 条に定める転売又は買戻しを行わなかった清算受託売建玉（以下「最終清算受託売建玉」という。）又は清算受託買建玉（以下「最終清算受託買建玉」という。）がある場合には、当該最終清算受託売建玉及び当該最終清算受託買建玉について、差金決済により最終決済を行うものとする。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、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 19 年 12 月 3 日 変更)

#### **(差金決済数値の決定方法)**

第 52 条 本取引所は、金融指標のもとになる金利を、取引最終日の実勢金利に基づいて算出することにより差金決済数値を決定するものとする。

2 前項の規定にかかわらず、本取引所は、無担保コールオーバーナイト金利先物に係る差金決済数値を第 76 条の 3 に定めるところにより決定するものとする。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 17 年 7 月 1 日、平成 17 年 12 月 20 日、平成 19 年 12 月 3 日、平成 24 年 4 月 23 日 変更)

#### **(最終決済に関する細則)**

第 53 条 この方法書に定めるもののほか、最終決済に関し必要な事項については、本取引所が定める。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加)

## **第 2 節 ユーロ円 3 ヶ月金利先物**

(平成 16 年 4 月 1 日 追加)

#### **(値洗いの規定の準用)**

第 54 条 第 46 条から第 49 条までの規定は、ユーロ円 3 ヶ月金利先物の差金決済について準用する。この場合において、第 46 条中「当該取引が成立した取引日の清算価格」とあるのは「差金決済数値」と、「約定価格」とあるのは「約定数値」と、第 47 条中「当該取引日の清算価格」とあるのは「差金決済数値」と、「前取引日の清算価格」とあるのは「前取引日の清算数値」と、第 48 条及び第 49 条中「値洗い価格差」とあるのは「差金決済数値差」と読み替えるものとする。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加)

#### **(差金決済数値の決定)**

第 55 条 本取引所は、一般社団法人全銀協 TIBOR 運営機関（以下「全銀協 TIBOR 運営機関」という。）が取引最終日に公表する期間 3 ヶ月のユーロ円 TIBOR（Tokyo Inter-Bank Offered Rate）を、取引最終日の日中取引時間帯の終了時点における実勢金利とする。

2 前項に規定する期間 3 ヶ月のユーロ円 TIBOR について、全銀協 TIBOR 運営機関による金利の訂正がなされた場合には、本取引所は訂正後の金利を実勢金利として採用する。

3 本取引所は、第 1 項に定める実勢金利の小数点以下第 3 位未満を四捨五入したものを 100 から差し引いた数値を、ユーロ円 3 ヶ月金利先物の差金決済数値とする。

4 前 3 項の規定にかかわらず、第 1 項における全銀協 TIBOR 運営機関によるユーロ円 TIBOR の

公表がなされない場合においては、本取引所がユーロ円 3 ヶ月金利先物の差金決済数値を定めることとする。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 26 年 4 月 30 日 変更)

## 第 56 条から第 68 条まで (削除)

(平成 17 年 12 月 20 日 変更)

## 第 3 節 2 年円金利スワップ先物

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 19 年 12 月 3 日 変更)

### (値洗いの規定の準用)

第 69 条 第 46 条から第 49 条までの規定は、2 年円金利スワップ先物の差金決済について準用する。この場合において、第 46 条中「当該取引が成立した取引日の清算価格」とあるのは「差金決済数値」と、「約定価格」とあるのは「約定数値」と、第 47 条中「当該取引日の清算価格」とあるのは「差金決済数値」と、「前取引日の清算価格」とあるのは「前取引日の清算数値」と、第 48 条及び第 49 条中「値洗い価格差」とあるのは「差金決済数値差」と読み替えるものとする。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加)

### (差金決済数値の決定)

第 70 条 本取引所は、取引最終日の日中取引時間帯が属する営業日に、2 年円金利スワップ標準物の開始日から満期日までの期間に半年ごとに発生する 100 円あたりの固定金利の利息と満期日の 100 円との合計額について、本取引所が別に定める算出式により当該標準物の開始日における現在価値を算出する。

- 2 前項の現在価値を算出する際に用いるスワップ・レートは、International Swaps and Derivatives Association, Inc. (以下「ISDA」という。)が取引最終日に公表する午前 10 時の期間 1 年及び期間 2 年の円金利スワップ指標レート (ISDA Benchmark JPY Swap Rate) とする。ただし、2 年円金利スワップ標準物の開始日から奇数回目の利息交換日までの各期間のスワップ・レートは、本取引所が別に定める方法により求めるものとする。
- 3 前項に規定する期間 1 年及び期間 2 年の円金利スワップ指標レートについて、ISDA による訂正がなされた場合には、本取引所は訂正後の指標レートを第 1 項に定める現在価値の算出に



用いるものとする。

- 4 本取引所は、第1項に定める現在価値に最も近接する0.005の整数倍の数値（当該数値が2種類ある場合は高い方の数値）を、2年円金利スワップ先物の差金決済数値とする。
- 5 第1項から前項までの規定にかかわらず、第2項に定めるISDAによる円金利スワップ指標レートの公表がなされない場合又は本取引所が当該円金利スワップ指標レートを取得できない場合においては、本取引所が2年円金利スワップ先物の差金決済数値を定めることとする。

（平成16年4月1日 追加）

#### 第4節 5年円金利スワップ先物

（平成16年4月1日 追加、平成19年12月3日 変更）

##### （値洗いの規定の準用）

第71条 第46条から第49条までの規定は、5年円金利スワップ先物の差金決済について準用する。この場合において、第46条中「当該取引が成立した取引日の清算価格」とあるのは「差金決済数値」と、「約定価格」とあるのは「約定数値」と、第47条中「当該取引日の清算価格」とあるのは「差金決済数値」と、「前取引日の清算価格」とあるのは「前取引日の清算数値」と、第48条及び第49条中「値洗い価格差」とあるのは「差金決済数値差」と読み替えるものとする。

（平成16年4月1日 追加）

##### （差金決済数値の決定）

第72条 本取引所は、取引最終日の日中取引時間帯が属する営業日に、5年円金利スワップ標準物の開始日から満期日までの期間に半年ごとに発生する100円あたりの固定金利の利息と満期日の100円との合計額について、本取引所が別に定める算出式により当該標準物の開始日における現在価値を算出する。

- 2 前項の現在価値を算出する際に用いるスワップ・レートは、ISDAが取引最終日に公表する午前10時の期間1年から期間5年までの円金利スワップ指標レート（ISDA Benchmark JPY Swap Rate）とする。ただし、5年円金利スワップ標準物の開始日から奇数回目の利息交換日までの各期間のスワップ・レートは、本取引所が別に定める方法により求めるものとする。
- 3 前項に規定する期間1年から期間5年までの円金利スワップ指標レートについて、ISDAによる訂正がなされた場合には、本取引所は訂正後の指標レートを第1項に定める現在価値の算出に用いるものとする。
- 4 本取引所は、第1項に定める現在価値の小数点以下第2位未満を四捨五入した数値を、5年

円金利スワップ先物の差金決済数値とする。

- 5 第1項から前項までの規定にかかわらず、第2項に定める ISDA による円金利スワップ指標レート公表がなされない場合又は本取引所が当該円金利スワップ指標レートを取得できない場合においては、本取引所が5年円金利スワップ先物の差金決済数値を定めることとする。

(平成16年4月1日 追加)

## 第5節 7年円金利スワップ先物

(平成16年4月1日 追加、平成19年12月3日 変更)

### (値洗いの規定の準用)

第73条 第46条から第49条までの規定は、7年円金利スワップ先物の差金決済について準用する。この場合において、第46条中「当該取引が成立した取引日の清算価格」とあるのは「差金決済数値」と、「約定価格」とあるのは「約定数値」と、第47条中「当該取引日の清算価格」とあるのは「差金決済数値」と、「前取引日の清算価格」とあるのは「前取引日の清算数値」と、第48条及び第49条中「値洗い価格差」とあるのは「差金決済数値差」と読み替えるものとする。

(平成16年4月1日 追加)

### (差金決済数値の決定)

第74条 本取引所は、取引最終日の日中取引時間帯が属する営業日に、7年円金利スワップ標準物の開始日から満期日までの期間に半年ごとに発生する100円あたりの固定金利の利息と満期日の100円との合計額について、本取引所が別に定める算出式により当該標準物の開始日における現在価値を算出する。

- 2 前項の現在価値を算出する際に用いるスワップ・レートは、ISDAが取引最終日に公表する午前10時の期間1年から期間7年までの円金利スワップ指標レート（ISDA Benchmark JPY Swap Rate）とする。ただし、7年円金利スワップ標準物の開始日から奇数回目の利息交換日までの各期間のスワップ・レートは、本取引所が別に定める方法により求めるものとする。
- 3 前項に規定する期間1年から期間7年までの円金利スワップ指標レートについて、ISDAによる訂正がなされた場合には、本取引所は訂正後の指標レートを第1項に定める現在価値の算出に用いるものとする。
- 4 本取引所は、第1項に定める現在価値の小数点以下第2位未満を四捨五入した数値を、7年円金利スワップ先物の差金決済数値とする。
- 5 第1項から前項までの規定にかかわらず、第2項に定める ISDA による円金利スワップ指標

レート公表がなされない場合又は本取引所が当該円金利スワップ指標レートを取得できない場合においては、本取引所が7年円金利スワップ先物の差金決済数値を定めることとする。

(平成16年4月1日 追加)

## 第6節 10年円金利スワップ先物

(平成16年4月1日 追加、平成19年12月3日 変更)

### (値洗いの規定の準用)

第75条 第46条から第49条までの規定は、10年円金利スワップ先物の差金決済について準用する。この場合において、第46条中「当該取引が成立した取引日の清算価格」とあるのは「差金決済数値」と、「約定価格」とあるのは「約定数値」と、第47条中「当該取引日の清算価格」とあるのは「差金決済数値」と、「前取引日の清算価格」とあるのは「前取引日の清算数値」と、第48条及び第49条中「値洗い価格差」とあるのは「差金決済数値差」と読み替えるものとする。

(平成16年4月1日 追加)

### (差金決済数値の決定)

第76条 本取引所は、取引最終日の日中取引時間帯が属する営業日に、10年円金利スワップ標準物の開始日から満期日までの期間に半年ごとに発生する100円あたりの固定金利の利息と満期日の100円との合計額について、本取引所が別に定める算出式により当該標準物の開始日における現在価値を算出する。

- 2 前項の現在価値を算出する際に用いるスワップ・レートは、ISDAが取引最終日に公表する午前10時の期間1年から期間10年までの円金利スワップ指標レート(ISDA Benchmark JPY Swap Rate)とする。ただし、10年円金利スワップ標準物の開始日から奇数回目の利息交換日までの各期間のスワップ・レートは、本取引所が別に定める方法により求めるものとする。
- 3 前項に規定する期間1年から期間10年までの円金利スワップ指標レートについて、ISDAによる訂正がなされた場合には、本取引所は訂正後の指標レートを第1項に定める現在価値の算出に用いるものとする。
- 4 本取引所は、第1項に定める現在価値の小数点以下第2位未満を四捨五入した数値を、10年円金利スワップ先物の差金決済数値とする。
- 5 第1項から前項までの規定にかかわらず、第2項に定めるISDAによる円金利スワップ指標レートの公表がなされない場合又は本取引所が当該円金利スワップ指標レートを取得できない場合においては、本取引所が10年円金利スワップ先物の差金決済数値を定めることとする。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加)

## 第 7 節 無担保コールオーバーナイト金利先物

(平成 19 年 12 月 3 日 追加)

### (値洗いの規定の準用)

第 76 条の 2 第 47 条から第 49 条までの規定は、無担保コールオーバーナイト金利先物の差金決済について準用する。この場合において、第 47 条中「当該取引日の前取引日まで」とあるのは「取引最終日まで」と、「当該取引日の清算価格」とあるのは「差金決済数値」と、「前取引日の清算価格」とあるのは「取引最終日の清算数値」と、「当該取引日の日中取引時間帯の属する営業日の翌営業日」とあるのは「取引最終日の日中取引時間帯の属する営業日の翌々営業日」と、第 48 条及び第 49 条中「値洗い価格差」とあるのは「差金決済数値差」と読み替えるものとする。

(平成 19 年 12 月 3 日 追加)

### (差金決済数値の決定)

第 76 条の 3 本取引所は、日本銀行が確報として公表する無担保コールオーバーナイト物レート（毎営業日）のうち百分率で表示される平均の利率について、取引最終日が属する月の最初の暦日の利率から最後の暦日の利率までを合計してその月の暦日数で除した数値を月中平均値とする。ただし、日本の銀行休業日における平均の利率は、当該日本の銀行休業日の直前の日本の銀行営業日の平均の利率を当該日本の銀行休業日における平均の利率として月中平均値の算出に用いる。

- 2 日本銀行が、公表後の無担保コールオーバーナイト物レート（毎営業日）の訂正を行った場合は、訂正後のものを月中平均値の算出に用いる。ただし、最終決済日以後に訂正が行われたときは、この限りでない。
- 3 本取引所は、第 1 項に定める月中平均値の小数点以下第 3 位未満を四捨五入したものを 100 から差し引いた数値を、無担保コールオーバーナイト金利先物の差金決済数値とする。
- 4 前 3 項の規定にかかわらず、日本の銀行営業日において第 1 項における日本銀行による無担保コールオーバーナイト物レート（毎営業日）の公表がなされない場合その他の特別な事情がある場合においては、本取引所が無担保コールオーバーナイト金利先物の差金決済数値を定めることとする。

(平成 19 年 12 月 3 日 追加、平成 22 年 6 月 28 日、平成 27 年 12 月 24 日 変更)

## 第 8 節 (削除)

(平成 19 年 12 月 3 日 追加、平成 24 年 4 月 23 日 変更)

### 第 76 条の 4、第 76 条の 5 (削除)

(平成 19 年 12 月 3 日 追加、平成 24 年 4 月 23 日 変更)

## 第 9 節 ユーロ円 LIBOR6 ヲ月金利先物

(平成 23 年 12 月 1 日 追加)

### (値洗いの規定の準用)

第 76 条の 6 第 46 条から第 49 条までの規定は、ユーロ円 LIBOR6 ヲ月金利先物の差金決済について準用する。この場合において、第 46 条中「当該取引が成立した取引日の清算価格」とあるのは「差金決済数値」と、「約定価格」とあるのは「約定数値」と、第 47 条中「当該取引日の清算価格」とあるのは「差金決済数値」と、「前取引日の清算価格」とあるのは「前取引日の清算数値」と、第 48 条及び第 49 条中「値洗い価格差」とあるのは「差金決済数値差」と読み替えるものとする。

(平成 23 年 12 月 1 日 追加)

### (差金決済数値の決定)

第 76 条の 7 本取引所は、ICE Benchmark Administration Limited (以下「IBA」という。)が取引最終日の夜間取引時間帯が属する営業日に公表する期間 6 ヲ月のユーロ円 LIBOR (London Inter-Bank Offered Rate) を、取引最終日の夜間取引時間帯の終了時点における実勢金利とする。

- 2 前項に規定する期間 6 ヲ月のユーロ円 LIBOR について、IBA による金利の訂正が取引最終日の夜間取引時間帯が属する営業日の翌営業日の午前 10 時までになされた場合には、本取引所は訂正後の金利を実勢金利として採用する。
- 3 本取引所は、前 2 項に定める実勢金利の小数点以下第 4 位未満を四捨五入したものを 100 から差し引いた数値を、ユーロ円 LIBOR6 ヲ月金利先物の差金決済数値とする。
- 4 前 3 項の規定にかかわらず、第 1 項における IBA によるユーロ円 LIBOR の公表がなされない

場合又は本取引所が当該ユーロ円 LIBOR を取得できない場合においては、本取引所がユーロ円 LIBOR6 ヲ月金利先物の差金決済数値を定めることとする。

(平成 23 年 12 月 1 日 追加、平成 26 年 4 月 30 日 変更)

## 第 12 章 ユーロ円 3 ヲ月金利先物オプションに係る特例

(平成 16 年 4 月 1 日 追加)

### 第 1 節 オプション料の授受

(平成 16 年 4 月 1 日 追加)

#### (オプション料の授受)

第 77 条 清算参加者は、自己の名においてユーロ円 3 ヲ月金利先物オプションの買付取引（ギブアップにより消滅したユーロ円 3 ヲ月金利先物オプション取引を除く。以下第 89 条を除き本章において「買付取引」という。）が成立したときは、ユーロ円 3 ヲ月金利先物オプションの取得の対価（以下「オプション料」という。）を当該買付取引が成立した取引日の日中取引時間帯の属する営業日の翌営業日（日本の銀行休業日にあたるときは、順次繰り下げる。以下同じ。）の本取引所が別に定める時刻までに、本取引所が定めるところにより、決済銀行に開設した本取引所名義の預金口座に入金するものとする。

2 非清算参加者は、自己のなした呼び値により、有価証券等清算取次ぎとしての買付取引が成立したときは、これに係るオプション料を、当該買付取引が成立した取引日の日中取引時間帯の属する営業日の翌営業日（ユーロ円先物遠隔地取引参加者である非清算参加者にあつては、原則として翌々営業日）の本取引所が別に定める時刻までに、指定清算参加者との間で授受するものとする。

3 本取引所は、清算参加者の名においてユーロ円 3 ヲ月金利先物オプションの売付取引（ギブアップにより消滅したユーロ円 3 ヲ月金利先物オプション取引を除く。以下第 89 条を除き本章において「売付取引」という。）が成立したときは、これに係るオプション料を、当該売付取引が成立した取引日の日中取引時間帯の属する営業日の翌営業日の本取引所が別に定める時刻までに、本取引所が定めるところにより、決済銀行に開設した当該清算参加者名義の預金口座に入金するものとする。

4 非清算参加者のなした呼び値により、有価証券等清算取次ぎとしての売付取引が成立したと

きは、当該非清算参加者の指定清算参加者は、これに係るオプション料を、当該売付取引が成立した取引日の日中取引時間帯の属する営業日の翌営業日（ユーロ円先物遠隔地取引参加者である非清算参加者にあつては、原則として翌々営業日）の本取引所が別に定める時刻までに、当該非清算参加者との間で授受するものとする。

（平成16年4月1日 追加、平成19年9月30日、平成20年4月28日、平成21年6月1日 変更）

### （授受する金銭の額）

第78条 前条各項の規定により授受する金銭の額は、取引単位あたり次の算式により算出した額とする。

$$2,500 \text{ 円} \times (\text{約定値段} / 0.01)$$

（平成16年4月1日 追加）

### （総受入金額及び総支払金額）

第79条 第77条第1項及び第3項の規定による本取引所と清算参加者間のオプション料の授受は、同一清算参加者のオプション料として支払うべき金銭の合計額と受け取るべき金銭の合計額の差額をもって行うものとする。

2 第77条第2項及び第4項の規定による指定清算参加者と非清算参加者間のオプション料の授受に関しては、前項の規定を準用する。

（平成16年4月1日 追加）

### （オプション料の授受に関する細則）

第80条 この方法書に定めるもののほか、オプション料の授受に関し必要な事項については、本取引所が定める。

（平成16年4月1日 追加）

## 第2節 転売又は買戻し

（平成16年4月1日 追加）

### （転売又は買戻し）

第81条 清算参加者は、自己の名において成立したユーロ円3ヵ月金利先物オプション取引に係る売建玉又は買建玉のうち、自己のなした呼び値により成立したユーロ円3ヵ月金利先物オプション取引に係る売建玉又は買建玉について、当該売建玉を減じるための買付取引（以

下本章において「買戻し」という。)又は当該買建玉を減じるための売付取引(以下本章において「転売」という。)を行ったときは、転売又は買戻しの別及び数量を本取引所に申告するものとする。

- 2 本取引所は、前項の申告を受付けた場合には、当該申告に係る転売又は買戻しの数量を、決済に係るものとして、当該清算参加者の売建玉又は買建玉から減じるものとする。
- 3 前項の規定にかかわらず、本取引所は、申告された転売又は買戻しの数量が、当該取引日に成立させたユーロ円 3 ヶ月金利先物オプション取引の数量を上回る等、本取引所が別に定めるところにより、適当でないと認めた場合は、当該申告数量を修正することができる。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加)

### **(非清算参加者による転売又は買戻し)**

第 82 条 非清算参加者は、有価証券等清算取次ぎに係る指定清算参加者の売建玉(以下本章において「清算受託売建玉」という。)又は買建玉(以下本章において「清算受託買建玉」という。)に係る買戻し又は転売を行ったときは、転売又は買戻しの別及び数量を当該指定清算参加者に代わって本取引所に申告するものとする。ただし、当該指定清算参加者が自ら申告することを妨げない。

- 2 本取引所は、前項の申告を受付けた場合には、当該申告に係る転売又は買戻しの数量を、決済に係るものとして、当該指定清算参加者の清算受託売建玉又は清算受託買建玉から減じるものとする。
- 3 前項の規定にかかわらず、本取引所は、申告された転売又は買戻しの数量が、当該取引日に成立させたユーロ円 3 ヶ月金利先物オプション取引の数量を上回る等、本取引所が別に定めるところにより、適当でないと認めた場合は、当該申告数量を修正することができる。
- 4 非清算参加者が第 1 項の申告を行ったときは、当該非清算参加者は、遅滞なくその旨を指定清算参加者に通知しなければならない。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 19 年 9 月 30 日 変更)

### **(転売又は買戻しに関する事項)**

第 83 条 この方法書に定めるもののほか、転売又は買戻しの申告の方法及び時限並びに申告内容の訂正に関し必要な事項については、本取引所が別に定めるところによる。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加)

## **第 3 節 権利行使**



(平成 16 年 4 月 1 日 追加)

### (権利行使期間)

第 84 条 清算参加者又は非清算参加者は、各限月取引の取引開始日の日中取引時間帯の属する営業日以降取引最終日の日中取引時間帯の属する営業日（以下「権利行使期間満了の日」という。）まで（以下「権利行使期間」という。）の各営業日に、次条に定めるところにより権利行使の申告を行うことができる。

- 2 前項の規定にかかわらず、本取引所は、必要があると認めるときは、全部又は一部の銘柄について権利行使期間を変更することができる。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加)

### (権利行使の申告)

第 85 条 清算参加者又は非清算参加者は、権利行使を行う場合には、自己又は委託の別ごとに各銘柄について、権利行使を行う日（以下「権利行使日」という。）の日中取引時間帯終了時に有する買建玉（非清算参加者である場合には、その指定清算参加者が有する清算受託買建玉。以下本項において同じ。）につき権利行使に係る数量を、本取引所が別に定める時刻（以下「権利行使申告時限」という。）までに、本取引所に申告するものとする。この場合において、非清算参加者に代わって当該非清算参加者の指定清算参加者が申告することを妨げない。ただし、自己又は委託の別ごとに各銘柄について、清算参加者又は非清算参加者から申告された権利行使に係る数量が権利行使日の日中取引時間帯終了時に有する買建玉の数量を上回る場合には、当該買建玉の数量の権利行使の申告がなされたものとみなす。

- 2 非清算参加者が権利行使の申告を行った場合には、当該非清算参加者は、遅滞なくその旨を指定清算参加者に通知するものとする。
- 3 本取引所は、ユーロ円 3 ヶ月金利先物又はユーロ円 3 ヶ月金利先物オプション取引の停止、取引所システムの稼働の支障その他の事由により本取引所が権利行使を行わせることが適当でないと認める場合には、本取引所が定めるところにより、全部又は一部の銘柄について権利行使を停止することができる。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 17 年 7 月 1 日、平成 19 年 9 月 30 日 変更)

### (自動権利行使)

第 86 条 前条第 1 項の規定にかかわらず、権利行使期間満了の日の日中取引時間帯終了後、当該限月取引の権利行使対象先物限月取引の差金決済数値を上回る行使価格のユーロ円 3 ヶ月金利先物プットオプション又は当該限月取引の権利行使対象先物限月取引の差金決済数値を下回る行使価格のユーロ円 3 ヶ月金利先物コールオプションにつき、権利行使申告時限までに清算参加者又は非清算参加者から権利行使の申告がない場合には、当該清算参加者又は当該非清算参加者は、当該ユーロ円 3 ヶ月金利先物オプションにつき権利行使の申告を行った

ものとみなされる。ただし、本取引所が別に定める時刻までに、清算参加者又は非清算参加者が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。この場合において、非清算参加者に代わって当該非清算参加者の指定清算参加者が申告することを妨げない。

- 2 非清算参加者が権利行使を行わない旨の申告を行った場合には、当該非清算参加者は、遅滞なくその旨を指定清算参加者に通知するものとする。
- 3 本取引所は、ユーロ円3ヵ月金利先物又はユーロ円3ヵ月金利先物オプション取引の停止、取引所システムの稼働の支障その他の事由により本取引所が権利行使を行わせることが適当でないと認める場合には、本取引所が定めるところにより、全部又は一部の銘柄について、第1項の規定を適用しないことができる。

(平成16年4月1日 追加)

### (割当の方法)

第87条 第85条第1項又は前条第1項の規定により清算参加者又は非清算参加者が権利行使の申告を行い又は行ったものとみなされた場合には、本取引所は、当該権利行使日に、銘柄ごとの権利行使に係る数量について、当該権利行使日の日中取引時間帯終了時に当該銘柄の売建玉(清算受託売建玉を除く。)を有する清算参加者又はその指定清算参加者が清算受託売建玉を有する非清算参加者に対し、本取引所が別に定めるところにより、権利行使の対象となる売建玉の指定(以下「割当」という。)を行うものとする。

- 2 本取引所は、割当を受けた清算参加者又は非清算参加者に、その内容を、当該清算参加者又は当該非清算参加者の自己の計算によりなした売建玉及び他の者の計算によりなした売建玉(清算参加者については、清算受託売建玉を除く。)に区分して遅滞なく通知するものとする。
- 3 非清算参加者が前項の通知を受けたときは、当該非清算参加者は、遅滞なくその内容を指定清算参加者に通知するものとする。

(平成16年4月1日 追加)

### (権利行使に伴う建玉の消滅)

第88条 本取引所は、権利行使期間満了の日以外の各営業日において、第85条第1項の規定により清算参加者から権利行使の申告を受けた場合には、権利行使日の本取引所が別に定める時刻に、当該権利行使に係る数量を当該清算参加者が当該権利行使日の日中取引時間帯終了時において有する買建玉から減じるものとする。

- 2 本取引所は、権利行使期間満了の日以外の各営業日において、第85条第1項の規定により非清算参加者から権利行使の申告を受けた場合には、権利行使日の本取引所が別に定める時刻に、当該権利行使に係る数量を当該非清算参加者の指定清算参加者が当該権利行使日の日中取引時間帯終了時において有する清算受託買建玉から減じるものとする。
- 3 本取引所は、権利行使期間満了の日以外の各営業日において、前条第1項の規定により、清算参加者に対し割当を行った場合には、権利行使日の本取引所が別に定める時刻に、当該割当に係る数量を当該清算参加者が当該権利行使日の日中取引時間帯終了時において有する売

建玉から減じるものとする。

- 4 本取引所は、権利行使期間満了の日以外の各営業日において、前条第1項の規定により、非清算参加者に対し割当を行った場合には、権利行使日の本取引所が別に定める時刻に、当該割当に係る数量を当該非清算参加者の指定清算参加者が当該権利行使日の日中取引時間帯終了時において有する清算受託売建玉から減じるものとする。
- 5 前各項の規定は、権利行使期間満了の日において、第85条第1項の規定により権利行使の申告がなされ、第86条第1項の規定により権利行使の申告がなされたものとみなされ、又は前条第1項の規定により割当がなされた場合にこれを準用する。この場合において、本条第1項から第4項の規定中「権利行使日」とあるのは「権利行使期間満了の日」と読み替えるものとする。

(平成16年4月1日 追加)

### **(権利行使に伴うユーロ円3ヵ月金利先物の成立)**

第89条 ユーロ円3ヵ月金利先物プットオプションについて、権利行使期間満了の日以外の各営業日において、第85条第1項の規定により清算参加者（以下「権利行使清算参加者」という。）から権利行使の申告がなされた場合又は第87条第1項の規定により清算参加者（以下「割当清算参加者」という。）に対して割当がなされた場合には、権利行使日の本取引所が別に定める時刻に、行使価格を約定数値とする権利行使清算参加者の本取引所に対する権利行使対象先物限月取引の売付取引又は割当清算参加者の本取引所に対する権利行使対象先物限月取引の買付取引が成立するものとする。

- 2 ユーロ円3ヵ月金利先物プットオプションについて、権利行使期間満了の日以外の各営業日において、第85条第1項の規定により非清算参加者（以下「権利行使非清算参加者」という。）から権利行使の申告がなされた場合又は第87条第1項の規定により非清算参加者（以下「割当非清算参加者」という。）に対して割当がなされた場合には、権利行使日の本取引所が別に定める時刻に、行使価格を約定数値とする権利行使非清算参加者の指定清算参加者の本取引所に対する権利行使対象先物限月取引の有価証券等清算取次ぎとしての売付取引又は割当非清算参加者の指定清算参加者の本取引所に対する権利行使対象先物限月取引の有価証券等清算取次ぎとしての買付取引が成立するものとする。
- 3 ユーロ円3ヵ月金利先物コールオプションについて、権利行使期間満了の日以外の各営業日において、第85条第1項の規定により権利行使清算参加者から権利行使の申告がなされた場合又は第87条第1項の規定により割当清算参加者に対して割当がなされた場合には、権利行使日の本取引所が別に定める時刻に、行使価格を約定数値とする権利行使清算参加者の本取引所に対する権利行使対象先物限月取引の買付取引又は割当清算参加者の本取引所に対する権利行使対象先物限月取引の売付取引が成立するものとする。
- 4 ユーロ円3ヵ月金利先物コールオプションについて、権利行使期間満了の日以外の各営業日において、第85条第1項の規定により権利行使非清算参加者から権利行使の申告がなされた場合又は第87条第1項の規定により割当非清算参加者に対して割当がなされた場合には、権

利行使日の本取引所が別に定める時刻に、行使価格を約定数値とする権利行使非清算参加者の指定清算参加者の本取引所に対する権利行使対象先物限月取引の有価証券等清算取次ぎとしての買付取引又は割当非清算参加者の指定清算参加者の本取引所に対する権利行使対象先物限月取引の有価証券等清算取次ぎとしての売付取引が成立するものとする。

- 5 前各項の規定は、権利行使期間満了の日において、第 85 条第 1 項の規定により権利行使の申告がなされ、第 86 条第 1 項の規定により権利行使の申告がなされたものとみなされ、第 87 条第 1 項の規定により割当がなされた場合にこれを準用する。この場合において、本条第 1 項から第 4 項の規定中「権利行使日」とあるのは「権利行使期間満了の日」と読み替えるものとする。
- 6 権利行使に伴いユーロ円 3 ヶ月金利先物が成立した場合には、業務規程第 18 条第 1 項の規定はこれを適用しないものとする。
- 7 権利行使に伴い、非清算参加者の指定清算参加者の名において、ユーロ円 3 ヶ月金利先物が成立した場合には、当該ユーロ円 3 ヶ月金利先物が成立した日の日中取引時間帯終了後、本取引所は、当該指定清算参加者に対して、当該ユーロ円 3 ヶ月金利先物に係る有価証券等清算取次ぎの清算に必要な取引内容を通知するものとする。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 19 年 9 月 30 日 変更)

#### 第 4 節 清算値段

(平成 16 年 4 月 1 日 追加)

##### (清算値段の決定)

第 90 条 本取引所は、各取引日の日中取引時間帯終了後、銘柄ごとに、当該取引日の取引証拠金、非清算参加者証拠金及び委託証拠金の算出基準となる値段（以下「清算値段」という。）を定め、清算参加者及び非清算参加者に通知するものとする。

- 2 前項の清算値段は、本取引所が別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。
- 3 前項の規定にかかわらず、取引最終日の清算値段は、ユーロ円 3 ヶ月金利先物プットオプションに係る各銘柄においては、当該銘柄の行使価格から当該銘柄の権利行使対象先物限月取引の取引最終日の清算数値を差し引いた値段とし、ユーロ円 3 ヶ月金利先物コールオプションに係る各銘柄においては、当該銘柄の権利行使対象先物限月取引の取引最終日の清算数値から当該銘柄の行使価格を差し引いた値段とする。ただし、いずれの場合においても、当該差引値段が零を下回った場合には、取引最終日の当該銘柄の清算値段は零とする。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 17 年 7 月 1 日、平成 26 年 3 月 6 日 変更)

## 第13章 取引所為替証拠金取引に係る特例

(平成17年7月1日 追加)

### 第1節 為替清算価格

(平成17年7月1日 追加)

#### (為替清算価格)

第90条の2 本取引所は、取引所為替証拠金取引について、各取引日（為替特例第2条第15号に規定する取引日をいう。以下本章において同じ。）の付合せ時間帯終了後、第90条の4に規定する引直為替評価損益、当該取引日における第90条の5に規定する更新為替評価損益及び第90条の7第2項に規定する決済為替評価損益の算出基準となる価格（以下「為替清算価格」という。）を定め、取引所為替証拠金取引に係る清算業務を行う証拠金清算参加者に通知するものとする。

- 2 前項の為替清算価格は、各取引日の付合せ時間帯終了前の本取引所が別に定める時間帯において、マーケットメイク方式により成立した取引所為替証拠金取引の約定価格により算出した価格とする。ただし、本取引所は、当該価格が適正でないと判断した場合には、本取引所が適正であると認める価格を為替清算価格とする。
- 3 前項に規定する時間帯において約定価格がない場合には、本取引所が別に定めるところによるものとする。

(平成17年7月1日 追加、平成20年10月27日、平成29年2月27日 変更)

### 第2節 ロールオーバー

(平成17年7月1日 追加)

#### (ロールオーバー)

第90条の3 取引所為替証拠金取引における売建玉又は買建玉について、その建玉が存する取引日において転売・買戻しの申告（第90条の9第1項第1号に規定する転売・買戻しの申

告をいう。以下同じ。)又は転売・買戻し(同項第2号に規定する転売・買戻しをいう。以下同じ。)が行われないときは、当該取引日を限日とする建玉は当該付合せ時間帯終了時に消滅し、同時に、翌取引日を限日とすることを除き消滅した建玉と同一内容を有する建玉が、本取引所と消滅した建玉を有していた証拠金清算参加者との間に新たに発生するものとする。この場合における当該建玉の消滅及び発生をこの章においてロールオーバーという。

(平成17年7月1日 追加、平成20年10月27日、平成22年10月1日、平成29年2月27日 変更)

#### **(引直為替評価損益)**

第90条の4 取引によりあらたに成立した取引所為替証拠金取引についてロールオーバーがなされた場合において、当該取引が成立した取引日の為替清算価格と当該取引の約定価格とを比較して差が生じているときは、その差に基づいて算出した正または負の計算上の数額である為替評価損益(以下「引直為替評価損益」という。)が発生するものとする。

(平成17年7月1日 追加、平成23年8月1日 変更)

#### **(更新為替評価損益)**

第90条の5 前取引日までの取引により成立した取引所為替証拠金取引についてロールオーバーがなされた場合において、当該ロールオーバーのなされた付合せ時間帯終了時の属する取引日の為替清算価格と当該取引日の前取引日における為替清算価格(以下「前日為替清算価格」という。)とを比較して差が生じているときは、その差に基づいて算出した正又は負の計算上の数額である為替評価損益(以下「更新為替評価損益」という。)が発生するものとする。

(平成17年7月1日 追加、平成23年8月1日 変更)

#### **(スワップポイント)**

第90条の6 取引所為替証拠金取引に係る建玉について、ロールオーバーがなされたことにより当該建玉に係る為替差金決済の決済期日が繰り延べられた場合には、当該建玉に係る2通貨間における金利差等の調整を目的として、当該繰り延べられた期間に応じ、取引所為替証拠金取引の種類ごとに、本取引所が別に定める方法により算出した正又は負の計算上の数額(以下「スワップポイント」という。)が発生するものとする。

(平成17年7月1日 追加、平成20年10月27日、平成23年8月1日 変更)

### **第3節 取引所為替証拠金取引に係る決済**

(平成 17 年 7 月 1 日 追加)

### (取引所為替証拠金取引における決済)

第 90 条の 7 取引所為替証拠金取引における売建玉又は買建玉の決済は、転売・買戻しの申告又は転売・買戻し（以下この章において「転売・買戻しの申告等」という。）によって、転売・買戻しの申告等の対象となる建玉に係る為替差金（次条第 1 項に規定する為替差金をいう。）が、為替取引証拠金へ振替えられることによる決済（「為替差金決済」という。）とする。

2 転売・買戻しの申告等により、次の各号に掲げる場合について当該各号に定める差が生じるときは、その差に基づいて算出した正又は負の計算上の数額である為替評価損益（以下「決済為替評価損益」という。）が発生するものとする。

(1) 転売・買戻しの申告が行われた場合 次のイ又はロの差

イ 決済の対象となる売建玉及び買建玉の双方が転売・買戻しの申告が行われた取引日における取引により発生しているときは、双方の取引に係る約定価格の差

ロ 決済の対象となる売建玉及び買建玉の一方が転売・買戻しの申告が行われた取引日における取引により発生し、他方がロールオーバーにより発生しているときは、転売・買戻しの申告が行われた取引日における取引に係る約定価格と転売・買戻しの申告が行われた取引日の前取引日における為替清算価格の差

(2) 転売・買戻しが行われた場合 転売・買戻しに係る取引の約定価格と、次のイ又はロの価格との差

イ 決済の対象となる建玉が当該転売・買戻しが行われた取引日における取引により発生しているときは、当該取引の約定価格

ロ 決済の対象となる建玉がロールオーバーにより発生しているときは、転売・買戻しが行われた取引日の前取引日における為替清算価格

(平成 17 年 7 月 1 日 追加、平成 20 年 10 月 27 日、平成 22 年 10 月 1 日 変更)

### (為替差金)

第 90 条の 8 前条第 1 項に規定する為替差金決済の対象となる為替差金とは、取引所為替証拠金取引に係る建玉について発生した以下に掲げる計算上の数額の合計額をいう。

- (1) 引直為替評価損益の数額
- (2) 更新為替評価損益の数額の累計額
- (3) 決済為替評価損益の数額
- (4) スワップポイントの数額の累計額

2 クロスカレンシー取引（為替特例第 2 条第 20 号に規定するクロスカレンシー取引をいう。以下この項及び次項において同じ。）に係る前項各号の数額については、当該クロスカレンシー取引における計算通貨（為替特例第 2 条第 22 号に規定する計算通貨をいう。以下この項及び次項において同じ。）により算出されるものを、ロールオーバーが生じる取引日においては当該ロールオーバーが生じる取引日における当該計算通貨に係る対円取引（為替特例第 2 条

第 19 号に規定する対円取引であって、当該クロスカレンシー取引がラージ取引（為替特例第 2 条第 23 号に規定するラージ取引をいう。以下この項において同じ。）であるときは当該計算通貨に係るラージ取引の対円取引をいい、当該クロスカレンシー取引が非ラージ取引（為替特例第 2 条第 24 号に規定する非ラージ取引をいう。以下この項において同じ。）であるときは当該計算通貨に係る非ラージ取引の対円取引をいう。以下この項において同じ。）の為替清算価格により、転売・買戻しの申告等が行われた取引日においては当該取引日における当該計算通貨に係る対円取引の為替清算価格により、円通貨に換算する。

- 3 前項の規定にかかわらず、特定マーケットメイカー（為替特例第 17 条の 2 第 1 項に規定する特定マーケットメイカーをいう。）がマーケットメイク呼び値を提示する義務に基づいて行うクロスカレンシー取引においては、前条第 1 項に規定する振替は、当該クロスカレンシー取引における計算通貨により行う。

（平成 17 年 7 月 1 日 追加、平成 20 年 10 月 27 日、平成 27 年 7 月 3 日、平成 27 年 11 月 30 日 変更）

### （建玉の決済方法）

第 90 条の 9 証拠金清算参加者が取引所為替証拠金取引の建玉を有する場合において、当該建玉を決済する方法は、次に掲げる方法のいずれかによる。

- (1) 転売・買戻しの申告（同一種類の取引所為替証拠金取引に係る売建玉及び買建玉を同時に有し、本取引所への申告により同一数量の売建玉及び買建玉を減じる方法をいう。）
  - (2) 転売・買戻し（同一種類の取引所為替証拠金取引について、売建玉を有している場合に買付取引を行い、又は買建玉を有している場合に売付取引を行って、直ちに対当する売建玉と買付取引のいずれか小さい数量又は買建玉と売付取引のいずれか小さい数量について、当該売建玉又は買建玉を減じる方法をいう。）
- 2 転売・買戻しの申告においては、証拠金清算参加者の自己取引及びその顧客ごとの取引について、次条に規定する転売・買戻しの申告が行われた取引日に、申告された内容にしたがって特定の売建玉及び買建玉を減じるものとする。
  - 3 転売・買戻しにおいては、あらたに以下の各号に規定する取引所為替証拠金取引を行ったときは、本取引所が別に定める場合を除き、当該取引は当該証拠金清算参加者の有する売建玉又は買建玉の買戻し又は転売に係る取引として、当該取引の数量を、その有する売建玉又は買建玉について成立が先の建玉から順番に減じるものとする。
    - (1) 証拠金清算参加者が自己取引に係る取引所為替証拠金取引の売建玉を有している場合に、あらたに自己取引に係る取引所為替証拠金取引の買付取引をなしたとき
    - (2) 証拠金清算参加者が自己取引に係る取引所為替証拠金取引の買建玉を有している場合に、あらたに自己取引に係る取引所為替証拠金取引の売付取引をなしたとき
    - (3) 証拠金清算参加者が取引所為替証拠金取引に係る顧客（以下「為替証拠金取引顧客」という。）の委託に係る取引所為替証拠金取引の売建玉を有している場合に、あらたに当該為替証拠金取引顧客の委託に基づき、当該為替証拠金取引顧客の計算による取引所為替証拠金取引の買付取引をなしたとき



(4) 証拠金清算参加者が為替証拠金取引顧客の委託に係る取引所為替証拠金取引の買建玉を有している場合に、あらたに当該為替証拠金取引顧客の委託に基づき、当該為替証拠金取引顧客の計算による取引所為替証拠金取引の売付取引をなしたとき

4 第1項各号に規定する建玉の決済方法は、証拠金清算参加者が自己取引及びその顧客ごとに選択するものとする。ただし、マーケットメイカー（為替特例第2条第4号に規定するマーケットメイカーをいう。）がマーケットメイク呼び値を提示する義務に基づいて行った取引所為替証拠金取引によって有する建玉の決済は、転売・買戻しによってのみ行うものとする。

（平成17年7月1日 追加、平成20年10月27日、平成27年7月3日、平成29年2月27日 変更）

### （取引所為替証拠金取引に係る非清算参加者による建玉の決済方法）

第90条の9の2 取引所為替証拠金取引に係る非清算参加者（以下「為替証拠金非清算参加者」という。）が、自己のなした呼び値によりその指定清算参加者の名において成立した取引所為替証拠金取引の建玉を決済する方法は、次に掲げる方法のいずれかによる。

(1) 転売・買戻しの申告

(2) 転売・買戻し

2 転売・買戻しの申告においては、為替証拠金非清算参加者の自己取引及びその顧客ごとの取引について、転売・買戻しの申告が行われた取引日に、申告された内容に従って特定の売建玉及び買建玉を減じるものとする。

3 転売・買戻しにおいては、新たに以下の各号に規定する取引所為替証拠金取引を行ったときは、本取引所が別に定める場合を除き、当該取引は当該為替証拠金非清算参加者の有する売建玉の買戻し又は買建玉の転売に係る取引として、当該取引の数量を、その有する売建玉又は買建玉について成立が先のものから順番に減じるものとする。

(1) 為替証拠金非清算参加者が自己取引に係る取引所為替証拠金取引の売建玉を有している場合の、新たな自己取引に係る取引所為替証拠金取引の買付取引

(2) 為替証拠金非清算参加者が自己取引に係る取引所為替証拠金取引の買建玉を有している場合の、新たな自己取引に係る取引所為替証拠金取引の売付取引

(3) 為替証拠金非清算参加者が顧客の委託に係る取引所為替証拠金取引の売建玉を有している場合の、新たに当該顧客の委託に基づく、当該顧客の計算による取引所為替証拠金取引の買付取引

(4) 為替証拠金非清算参加者が顧客の委託に係る取引所為替証拠金取引の買建玉を有している場合の、新たに当該顧客の委託に基づく、当該顧客の計算による取引所為替証拠金取引の売付取引

4 第1項各号に規定する建玉の決済方法は、為替証拠金非清算参加者が自己取引及びその顧客ごとに選択するものとする。ただし、マーケットメイカーがマーケットメイク呼び値を提示する義務に基づいて行った取引所為替証拠金取引によって有する建玉の決済は、転売・買戻しによってのみ行うものとする。

(平成 29 年 2 月 27 日 追加)

### **(取引所為替証拠金取引に係る転売・買戻しの申告)**

第 90 条の 9 の 3 転売・買戻しの申告は、売建玉及び買建玉の双方を同時に有する場合において、本取引所が別に定める時限に行うことができる。

2 転売・買戻しの申告により建玉を減じようとする証拠金清算参加者は、自己取引又はその顧客ごとに、次に掲げる事項を本取引所に申告しなければならない。

- (1) 転売・買戻しの申告により売建玉及び買建玉を減じる旨
- (2) 複数の売付取引に基づく売建玉又は複数の買付取引に基づく買建玉を有する場合は、減じようとする売建玉に係る売付取引又は買建玉に係る買付取引
- (3) 減じようとする売建玉及び買建玉の数量

3 転売・買戻しの申告により建玉を減じようとする為替証拠金非清算参加者は、自己取引又はその顧客ごとに、次に掲げる事項をその指定清算参加者に代わって本取引所に申告しなければならない。ただし、当該指定清算参加者が自ら申告することを妨げない。

- (1) 転売・買戻しの申告により売建玉及び買建玉を減じる旨
- (2) 複数の売付取引に基づく売建玉又は複数の買付取引に基づく買建玉を有する場合は、減じようとする売建玉に係る売付取引又は買建玉に係る買付取引
- (3) 減じようとする売建玉及び買建玉の数量

(平成 20 年 10 月 27 日 追加、平成 29 年 2 月 27 日 変更)

### **(取引所為替証拠金取引に関する金銭の授受)**

第 90 条の 10 証拠金清算参加者が取引所為替証拠金取引に関して本取引所と金銭の授受をなす場合には、為替証拠金規則及び為替取引証拠金決済規則に規定する時限までに、取引所為替証拠金取引に係る決済銀行（「為替取引証拠金決済銀行」という。）の指定営業所に開設した預金口座を通じ、本取引所との間で金銭の授受をするものとする。

(平成 17 年 7 月 1 日 追加、平成 29 年 2 月 27 日 変更)

### **(取引所為替証拠金取引に係る金融商品債務引受業に関する細則)**

第 90 条の 11 この方法書に定めるもののほか、本取引所が行う取引所為替証拠金取引に係る金融商品債務引受業及びこれに付帯する業務の方法については、本取引所が定める。

(平成 17 年 7 月 1 日 追加、平成 19 年 9 月 30 日 変更)

## 第 13 章の 2 取引所株価指数証拠金取引に係る特例

(平成 22 年 10 月 1 日 追加)

### 第 1 節 株価指数清算価格

(平成 22 年 10 月 1 日 追加)

#### (株価指数清算価格)

第 90 条の 12 本取引所は、取引所株価指数証拠金取引について、各取引日（株価指数特例第 2 条第 15 号に規定する取引日をいう。以下この章において同じ。）の付合せ時間帯終了後、第 90 条の 14 に規定する引直株価指数差金、当該取引日における第 90 条の 15 に規定する更新株価指数差金及び第 90 条の 18 第 2 項に規定する解消株価指数差金の算出基準となる価格（以下「株価指数清算価格」という。）を定め、取引所株価指数証拠金取引に係る清算業務を行う証拠金清算参加者に通知するものとする。

- 2 株価指数清算価格は、各取引日の付合せ時間帯終了前の本取引所が別に定める時間帯において、マーケットメイク方式により成立した取引所株価指数証拠金取引の約定価格により算出した価格とする。ただし、本取引所は、当該価格が適正でないと判断した場合には、本取引所が適正であると認める価格を株価指数清算価格とする。
- 3 前項に規定する時間帯において約定価格がない場合には、本取引所が別に定めるところによるものとする。

(平成 22 年 10 月 1 日 追加、平成 22 年 11 月 1 日、平成 26 年 9 月 20 日、平成 29 年 2 月 27 日 変更)

### 第 2 節 ロールオーバー

(平成 22 年 10 月 1 日 追加)

#### (ロールオーバー)

第 90 条の 13 取引所株価指数証拠金取引における売建玉又は買建玉について、その建玉が存する取引日において転売・買戻しの申告（第 90 条の 20 第 1 項第 1 号に規定する転売・買戻しの申告をいう。以下同じ。）又は転売・買戻し（同項第 2 号に規定する転売・買戻しをいう。以下同じ。）が行われなるときは、当該取引日を限日とする建玉は当該付合せ時間帯終了時に

消滅し、同時に、翌取引日を限日とすることを除き消滅した建玉と同一内容を有する建玉が、本取引所と消滅した建玉を有していた証拠金清算参加者との間に新たに発生するものとする。この場合における当該建玉の消滅及び発生をこの章においてロールオーバーという。

(平成 22 年 10 月 1 日 追加、平成 29 年 2 月 27 日 変更)

### **(引直株価指数差金)**

第 90 条の 14 取引により新たに成立した取引所株価指数証拠金取引についてロールオーバーがなされた場合において、当該取引が成立した取引日の株価指数清算価格と当該取引の約定価格とを比較して差が生じているときは、その差に基づいて算出した正又は負の計算上の数額である株価指数差金（以下「引直株価指数差金」という。）が発生するものとする。

(平成 22 年 10 月 1 日 追加)

### **(更新株価指数差金)**

第 90 条の 15 前取引日までの取引により成立した取引所株価指数証拠金取引についてロールオーバーがなされた場合において、当該ロールオーバーのなされた付合せ時間帯終了時の属する取引日の株価指数清算価格と当該取引日の前取引日における株価指数清算価格とを比較して差が生じているときは、その差に基づいて算出した正又は負の計算上の数額である株価指数差金（以下「更新株価指数差金」という。）が発生するものとする。

(平成 22 年 10 月 1 日 追加)

### **(金利相当額)**

第 90 条の 16 取引所株価指数証拠金取引に係る建玉について、ロールオーバーがなされたことにより当該建玉に係る第 90 条の 18 第 1 項の決済の決済期日が繰り延べられた場合には、当該繰り延べられた期間に応じ、取引所株価指数証拠金取引の種類ごとに、本取引所が別に定める方法により算出した正又は負の計算上の数額（以下「金利相当額」という。）が発生するものとする。

2 取引日の終了時において、取引所株価指数証拠金取引の売建玉を保有する者にあつては金利相当額は正となり、買建玉を保有する者にあつては金利相当額は負となる。

(平成 22 年 10 月 1 日 追加)

### **(配当相当額)**

第 90 条の 17 取引所株価指数証拠金取引に係る建玉について、その取引対象である株価指数を構成する銘柄について配当金の支払いが見込まれる場合は、予想される配当金の支払いが株価指数に与える理論上の影響値に相当するものとして、本取引所が別に定めるところにより

算出した正又は負の計算上の数額（以下「配当相当額」という。）が発生するものとする。

- 2 前項に規定する配当金の支払いが見込まれる場合は、当該配当金を受け取る権利を得ることができる最終の売買日と同じ取引日の終了時において、当該配当金の支払いが見込まれる銘柄が構成する株価指数を取引対象とする取引所株価指数証拠金取引の買建玉を保有する者にあつては配当相当額は正となり、売建玉を保有する者にあつては配当相当額は負となる。
- 3 前項に規定する場合において、同項の最終の売買日が同項の取引所株価指数証拠金取引の取引日でないときは、同項中「最終の売買日と同じ取引日」とあるのは、「最終の売買日の直前の取引日」と読み替えて、同項の規定を適用する。
- 4 前3項の規定は、DAX<sup>®</sup>証拠金取引については、適用しない。

（平成22年10月1日 追加、平成22年11月22日 変更）

### 第3節 取引所株価指数証拠金取引に係る決済

（平成22年10月1日 追加）

#### （取引所株価指数証拠金取引における決済方法）

第90条の18 取引所株価指数証拠金取引における売建玉又は買建玉の決済は、転売・買戻しの申告又は転売・買戻し（以下この章において「転売・買戻しの申告等」という。）によって、転売・買戻しの申告等の対象となる建玉に係る株価指数差金（次条に規定する株価指数差金をいう。）を、利益であれば株価指数取引証拠金に加え、損失であれば株価指数取引証拠金から差し引くことによる決済とする。

- 2 転売・買戻しの申告等により、次の各号に掲げる場合について当該各号に定める差が生じるときは、その差に基づいて算出した正又は負の計算上の数額である解消株価指数差金が発生するものとする。

(1) 転売・買戻しの申告が行われた場合 次のイ又はロの差

イ 決済の対象となる売建玉及び買建玉の双方が転売・買戻しの申告が行われた取引日における取引により成立しているときは、双方の取引に係る約定価格の差

ロ 決済の対象となる売建玉及び買建玉の一方が転売・買戻しの申告が行われた取引日における取引により成立し、他方がロールオーバーにより発生しているときは、転売・買戻しの申告が行われた取引日における取引に係る約定価格と転売・買戻しの申告が行われた取引日の前取引日における株価指数清算価格の差

(2) 転売・買戻しが行われた場合 転売・買戻しに係る取引の約定価格と、次のイ又はロの価格との差

イ 決済の対象となる建玉が当該転売・買戻しが行われた取引日における取引により成立しているときは、当該取引の約定価格

- ロ 決済の対象となる建玉がロールオーバーにより発生しているときは、転売・買戻しが行われた取引日の前取引日における株価指数清算価格

(平成 22 年 10 月 1 日 追加)

### **(株価指数差金)**

第 90 条の 19 株価指数差金とは、取引所株価指数証拠金取引に係る建玉について発生した以下に掲げる計算上の数額の合計額をいう。

- (1) 引直株価指数差金の数額
- (2) 更新株価指数差金の数額の累計額
- (3) 解消株価指数差金の数額
- (4) 金利相当額の数額の累計額
- (5) 配当相当額の数額の累計額

(平成 22 年 10 月 1 日 追加)

### **(証拠金清算参加者による建玉の決済方法)**

第 90 条の 20 証拠金清算参加者が自己のなした呼び値により自己の名において成立した取引所株価指数証拠金取引の建玉を決済する方法は、次に掲げる方法のいずれかによる。

- (1) 転売・買戻しの申告（同一種類の取引所株価指数証拠金取引に係る売建玉及び買建玉を同時に有し、本取引所への申告により同一数量の売建玉及び買建玉を減じる方法をいう。）
  - (2) 転売・買戻し（同一種類の取引所株価指数証拠金取引について、売建玉を有している場合に買付取引を行い、又は買建玉を有している場合に売付取引を行って、直ちに対当する売建玉と買付取引のいずれか小さい数量又は買建玉と売付取引のいずれか小さい数量について、当該売建玉又は買建玉を減じる方法をいう。）
- 2 転売・買戻しの申告においては、証拠金清算参加者の自己取引及びその顧客ごとの取引について、転売・買戻しの申告が行われた取引日に、申告された内容に従って特定の売建玉及び買建玉を減じるものとする。
- 3 転売・買戻しにおいては、新たに以下の各号に規定する取引所株価指数証拠金取引を行ったときは、本取引所が別に定める場合を除き、当該取引は当該証拠金清算参加者の有する売建玉の買戻し又は買建玉の転売に係る取引として、当該取引の数量を、その有する売建玉又は買建玉について成立が先のものから順番に減じるものとする。
- (1) 証拠金清算参加者が自己取引に係る取引所株価指数証拠金取引の売建玉を有している場合の、新たな自己取引に係る取引所株価指数証拠金取引の買付取引
  - (2) 証拠金清算参加者が自己取引に係る取引所株価指数証拠金取引の買建玉を有している場合の、新たな自己取引に係る取引所株価指数証拠金取引の売付取引
  - (3) 証拠金清算参加者が顧客の委託に係る取引所株価指数証拠金取引の売建玉を有してい

る場合の、新たに当該顧客の委託に基づく、当該顧客の計算による取引所株価指数証拠金取引の買付取引

- (4) 証拠金清算参加者が顧客の委託に係る取引所株価指数証拠金取引の買建玉を有している場合の、新たに当該顧客の委託に基づく、当該顧客の計算による取引所株価指数証拠金取引の売付取引

- 4 第1項各号に規定する建玉の決済方法は、証拠金清算参加者が自己取引及びその顧客ごとに選択するものとする。ただし、マーケットメイカー（株価指数特例第2条第1項第4号に規定するマーケットメイカーをいう。第90条の21第4項において同じ。）がマーケットメイク呼び値を提示する義務に基づいて行った取引所株価指数証拠金取引によって有する建玉の決済は、転売・買戻しによってのみ行うものとする。

（平成22年10月1日 追加、平成27年7月3日、平成29年2月27日 変更）

### （取引所株価指数証拠金取引に係る非清算参加者による建玉の決済方法）

第90条の21 取引所株価指数証拠金取引に係る非清算参加者（以下「株価指数証拠金非清算参加者」という。）が、自己のなした呼び値によりその指定清算参加者の名において成立した取引所株価指数証拠金取引の建玉を決済する方法は、次に掲げる方法のいずれかによる。

- (1) 転売・買戻しの申告  
(2) 転売・買戻し
- 2 転売・買戻しの申告においては、株価指数証拠金非清算参加者の自己取引及びその顧客ごとの取引について、転売・買戻しの申告が行われた取引日に、申告された内容に従って特定の売建玉及び買建玉を減じるものとする。
- 3 転売・買戻しにおいては、新たに以下の各号に規定する取引所株価指数証拠金取引を行ったときは、本取引所が別に定める場合を除き、当該取引は当該株価指数証拠金非清算参加者の有する売建玉の買戻し又は買建玉の転売に係る取引として、当該取引の数量を、その有する売建玉又は買建玉について成立が先のものから順番に減じるものとする。

- (1) 株価指数証拠金非清算参加者が自己取引に係る取引所株価指数証拠金取引の売建玉を有している場合の、新たな自己取引に係る取引所株価指数証拠金取引の買付取引  
(2) 株価指数証拠金非清算参加者が自己取引に係る取引所株価指数証拠金取引の買建玉を有している場合の、新たな自己取引に係る取引所株価指数証拠金取引の売付取引  
(3) 株価指数証拠金非清算参加者が顧客の委託に係る取引所株価指数証拠金取引の売建玉を有している場合の、新たに当該顧客の委託に基づく、当該顧客の計算による取引所株価指数証拠金取引の買付取引  
(4) 株価指数証拠金非清算参加者が顧客の委託に係る取引所株価指数証拠金取引の買建玉を有している場合の、新たに当該顧客の委託に基づく、当該顧客の計算による取引所株価指数証拠金取引の売付取引

- 4 第1項各号に規定する建玉の決済方法は、株価指数証拠金非清算参加者が自己取引及びその

顧客ごとに選択するものとする。ただし、マーケットメイカーがマーケットメイク呼び値を提示する義務に基づいて行った取引所株価指数証拠金取引によって有する建玉の決済は、転売・買戻しによってのみ行うものとする。

(平成 22 年 10 月 1 日 追加)

#### **(取引所株価指数証拠金取引に係る転売・買戻しの申告)**

第 90 条の 22 転売・買戻しの申告は、売建玉及び買建玉の双方を同時に有する場合において、本取引所が別に定める時限に行うことができる。

2 転売・買戻しの申告により建玉を減じようとする証拠金清算参加者は、自己取引又はその顧客ごとに、次に掲げる事項を本取引所に申告しなければならない。

- (1) 転売・買戻しの申告により売建玉及び買建玉を減じる旨
- (2) 複数の売付取引に基づく売建玉又は複数の買付取引に基づく買建玉を有する場合は、減じようとする売建玉に係る売付取引又は買建玉に係る買付取引
- (3) 減じようとする売建玉及び買建玉の数量

3 転売・買戻しの申告により建玉を減じようとする株価指数証拠金非清算参加者は、自己取引又はその顧客ごとに、次に掲げる事項をその指定清算参加者に代わって本取引所に申告しなければならない。ただし、当該指定清算参加者が自ら申告することを妨げない。

- (1) 転売・買戻しの申告により売建玉及び買建玉を減じる旨
- (2) 複数の売付取引に基づく売建玉又は複数の買付取引に基づく買建玉を有する場合は、減じようとする売建玉に係る売付取引又は買建玉に係る買付取引
- (3) 減じようとする売建玉及び買建玉の数量

(平成 22 年 10 月 1 日 追加、平成 29 年 2 月 27 日 変更)

#### **(取引所株価指数証拠金取引に関する金銭の授受)**

第 90 条の 23 証拠金清算参加者が取引所株価指数証拠金取引に関して本取引所と金銭の授受をなす場合には、株価指数証拠金規則及び株価指数取引証拠金決済規則に規定する時限までに、取引所株価指数証拠金取引に係る決済銀行の指定営業所に開設した預金口座を通じ、本取引所との間で金銭の授受をするものとする。

(平成 22 年 10 月 1 日 追加、平成 29 年 2 月 27 日 変更)

#### **(取引所株価指数証拠金取引に係る金融商品債務引受業に関する細則)**

第 90 条の 24 この規則で定めるもののほか、本取引所が行う取引所株価指数証拠金取引に係る金融商品債務引受業及びこれに付帯する業務の方法に関して必要な事項については、本取引所が別に定める。



(平成 22 年 10 月 1 日 追加)

## 第 14 章 建玉移管

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 17 年 7 月 1 日 変更)

### (建玉移管)

第 91 条 建玉移管とは、金利先物等取引に関して清算参加者若しくは非清算参加者のなした呼び値により成立させた未決済の金利先物等取引又は清算参加者若しくは非清算参加者の計算により発生させた未決済の清算建玉（以下「未決済取引」という。）を、当該未決済取引に関する清算資格に係る他の清算参加者又は非清算参加者に引継がせることをいう。

2 取引所為替証拠金取引及び取引所株価指数証拠金取引に係る建玉については、この章に規定する建玉移管はできないものとする。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 17 年 7 月 1 日、平成 19 年 9 月 30 日、平成 22 年 10 月 1 日 変更)

### (建玉移管手数料)

第 92 条 建玉移管により未決済取引を引継がせる清算参加者又は非清算参加者（以下「移管元参加者」という。）及び当該未決済取引を引継ぐ清算参加者又は非清算参加者（以下「移管先参加者」という。）は、建玉移管手数料を本取引所に納入しなければならない。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 17 年 7 月 1 日、平成 19 年 9 月 30 日 変更)

### (建玉移管の効力)

第 93 条 本取引所が第 95 条第 1 項第 1 号に規定する建玉移管の承認の通知を行った場合には、移管先参加者（移管先参加者が非清算参加者である場合は、その指定清算参加者）は、本取引所が当該承認を行った取引日の日中取引時間帯が属する営業日の午前 11 時（以下「移管時刻」という。）をもって、移管元参加者（移管元参加者が非清算参加者である場合は、その指定清算参加者。以下本条において同じ。）が有する移管建玉について、移管時刻以降に生ずる当該移管元参加者の本取引所に対する一切の債務を免責的に引き受け、当該移管時刻以降に生ずる当該移管元参加者の本取引所に対する一切の債権を取得するものとする。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 17 年 7 月 1 日 変更)

### (建玉移管申告)

第 94 条 清算参加者又は非清算参加者が建玉移管を行おうとする場合には、移管元参加者及び

移管先参加者が合同して、本取引所が定める方法により、移管建玉の内容その他本取引所が定める事項を本取引所に申告（以下「建玉移管申告」という。）するものとする。ただし、移管時刻が属する取引日に成立した金利先物等取引又は発生した清算建玉を移管建玉として申告することはできない。

- 2 前項において、移管元参加者又は移管先参加者が非清算参加者である場合は、当該非清算参加者は、本取引所が定める方法により、その指定清算参加者と合同して建玉移管申告を行わなければならない。

（平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 19 年 9 月 30 日 変更）

### （本取引所による承認）

第 95 条 本取引所は、清算参加者又は非清算参加者からの建玉移管申告を受けた場合には、当該建玉移管申告を行ったすべての清算参加者及び非清算参加者に、次の各号に定めるいずれかの通知を行うものとする。

- (1) 当該申告に係る建玉移管を承認する場合にはその旨の通知
- (2) 当該申告に係る建玉移管を承認しない場合にはその旨の通知

（平成 16 年 4 月 1 日 追加）

### （移管価格）

第 96 条 建玉移管により移管先参加者が引き継ぐ未決済取引の価格又はオプション特例に定める値段（以下「移管価格」という。）は、移管時刻が属する取引日の前取引日における第 45 条に定める清算価格とする。ただし、オプション特例に定める売建玉及び買建玉に係る移管価格は、零とする。この場合、オプション特例第 2 条第 8 号の規定は適用しない。

（平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 17 年 7 月 1 日 変更）

### （建玉移管に関する事項）

第 97 条 この方法書に定めるもののほか、建玉移管に係る申告の時限等に関し必要な事項は、本取引所が別に定めるところによる。

（平成 16 年 4 月 1 日 追加）

## 第 15 章 雑則

（平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 17 年 7 月 1 日 変更）

### **(決済銀行)**

第 98 条 清算参加者は、本取引所の市場において成立した市場デリバティブ取引及び発生した清算建玉の清算を、本取引所が定める金融機関を通じて本取引所との間で行わなければならない。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 19 年 9 月 30 日 変更)

### **(システム障害時等における決済日の繰延べ)**

第 99 条 本取引所は、市場デリバティブ取引又は清算建玉に係る本取引所と清算参加者の間の決済を行うために必要な取引所システム又は本取引所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、当該システムを利用して市場デリバティブ取引又は清算建玉の決済を行うことが不可能又は困難であると認める場合は、当該決済の全部又は一部につき決済日をその翌日以降に繰り延べることができる。この場合においては、あらかじめその旨を清算参加者に通知する。

2 前項に規定する決済日の繰延べに関し必要な事項は、本取引所がその都度定める。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 19 年 9 月 30 日 変更)

### **(天災地変等の場合における非常措置)**

第 100 条 本取引所は、本取引所の市場において成立した市場デリバティブ取引又は発生した清算建玉の清算が、天災地変、経済事情の激変、その他やむを得ない理由に基づいて、不可能又は著しく困難であると認められるに至ったときは、取締役会の決議により、当該市場デリバティブ取引又は当該清算建玉について、改めて清算の条件を定める等必要な措置を行うことができる。

2 前項の場合において、本取引所が緊急の必要があると認めるときは、本取引所は、取締役会の決議を経ずに、改めて清算の条件を定める等必要な措置を行うことができる。

3 前 2 項の規定により本取引所が清算の条件を定める等必要な措置を行ったときは、清算参加者は、これに従わなければならない。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 19 年 9 月 30 日、平成 25 年 3 月 11 日 変更)

### **第 101 条 (削除)**

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、平成 17 年 12 月 20 日、平成 20 年 4 月 28 日 変更)

### **(標準時等)**

第 102 条 この方法書における時刻の表示は、日本標準時によるものとする。

2 この方法書における月日及び曜日の表示は、日本の暦によるものとする。

(平成 20 年 4 月 28 日 追加)

### (決済方法の変更等)

第 103 条 本取引所は、第 99 条又は第 100 条の規定に基づき、市場デリバティブ取引又は清算建玉の決済日の繰延べ又は清算の条件を定めることとしたときは、第 46 条から第 49 条までに規定する差額に相当する金銭の授受、証拠金規則第 7 条から第 12 条までに規定する取引証拠金の預託、証拠金規則第 11 条に規定する非清算参加者証拠金の預託、為替証拠金規則第 5 条から第 7 条までに規定する為替取引証拠金の預託、為替証拠金規則第 9 条に規定する為替取引証拠金の引出し、為替証拠金規則第 10 条に規定する為替取引証拠金の払出し、株価指数証拠金規則第 6 条から第 8 条までに規定する株価指数取引証拠金の預託、株価指数証拠金規則第 11 条に規定する株価指数取引証拠金の引出し、株価指数証拠金規則第 12 条に規定する株価指数取引証拠金の払出し並びに第 54 条、第 69 条、第 71 条、第 73 条、第 75 条、第 76 条の 2 及び第 76 条の 6 に規定する最終決済に関して、それらの履行の時限及び期日の変更並びに当該変更に伴う必要な措置を行うことができる。

2 本取引所は、第 99 条又は第 100 条の規定に基づき、ユーロ円 3 ヶ月金利先物オプション取引の決済日の繰延べ又は清算の条件を定めることとしたときは、第 77 条から第 79 条までに規定するオプション料の授受に関して、それらの履行の時限及び期日の変更並びに当該変更に伴う必要な措置を行うことができる。

3 本取引所は、第 99 条又は第 100 条の規定に基づき、取引所為替証拠金取引の決済日の繰延べ又は清算の条件を定めることとしたときは、為替証拠金規則第 11 条及び第 25 条に規定する為替差金の為替取引証拠金への振替えに関して、それらの履行の時限及び期日の変更並びに当該変更に伴う必要な措置を行うことができる。

4 本取引所は、第 99 条又は第 100 条の規定に基づき、取引所株価指数証拠金取引の決済日の繰延べ又は清算の条件を定めることとしたときは、株価指数証拠金規則第 13 条及び第 22 条に規定する決済株価指数差金に係る金銭の授受に関して、それらの履行の時限及び期日の変更並びに当該変更に伴う必要な措置を行うことができる。

(平成 16 年 4 月 1 日 追加、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 19 年 12 月 3 日、平成 22 年 10 月 1 日、平成 22 年 11 月 22 日、平成 24 年 4 月 23 日 変更)

### (清算資格取得料等の額)

第 104 条 第 4 条第 3 項の清算資格取得料、第 14 条の 2 の 2 第 3 項の名義書換手数料、第 14 条の 2 の 3 の清算資格喪失手数料及び第 92 条の建玉移管手数料の額は、本取引所が別に定める。

(平成 19 年 9 月 30 日 追加、平成 20 年 4 月 28 日、平成 22 年 10 月 1 日 変更)

### **(株価指数の算出が不能等の場合の責任の所在)**

第 105 条 株価指数証拠金清算参加者及び株価指数証拠金非清算参加者は、株価指数特例第 3 条第 1 項各号に掲げる株価指数の算出又は配信に関して、不能、遅延又は誤りにより取引所株価指数証拠金取引について損害を被った場合は、本取引所及び当該株価指数を算出する者（当該株価指数の算出に関して業務の委託を受けた者を含む。）に対してその損害の賠償を請求することができない。

(平成 22 年 10 月 1 日 追加)

### **(金融商品債務引受業等に関する責任)**

第 106 条 本取引所は、本取引所が業務規程第 86 条に列挙する行為を行ったこと、この方法書の第 99 条に基づき決済日を繰り延べたこと、第 100 条に基づき清算の条件を定める等必要な措置を行ったこと、第 103 条に基づき必要な措置を行ったこと、その他本取引所が金融商品債務引受業及びこれに付帯する業務上必要と認める行為を行ったことによって、清算参加者及び第三者に損害が生じることがあっても、これを賠償する責めに任じない。

(平成 25 年 3 月 11 日 追加)

### **(休止清算参加者)**

第 107 条 金利先物等清算参加者は、本取引所が定める方法により清算参加者としての権利及び義務の停止を申請することができ、本取引所が当該停止の申請を承認した場合には、本取引所が指定する日時より清算参加者としての権利及び義務が停止するものとする。

2 前項の規定に基づき権利及び義務の停止が行われている清算参加者（以下「休止清算参加者」という。）は、本取引所が定めるところに従い、当該停止に係る休止手数料を本取引所に納入しなければならない。

3 休止清算参加者は、本取引所の定める方法により第 1 項の規定に基づく停止の解除を申請することができ、本取引所が当該解除の申請を承認した場合には、本取引所が指定する日時より清算参加者としての権利及び義務の効力が発生するものとする。

(平成 25 年 4 月 1 日 追加)

## **附則**

この業務方法書は、平成 15 年 1 月 6 日から施行する。

## 附則

この変更規則は、本取引所が定める日から施行する。

(注)「本取引所が定める日」は平成 15 年 4 月 28 日

## 附則

- 1 この変更規則は、平成 16 年 4 月 1 日から施行する。
- 2 この変更規則施行の日（以下「施行日」という。）の前日において、現に清算会員である者は、施行日において、第 6 条第 1 項の規定に基づき、清算資格の付与を受けた者とみなす。  
この場合において、同条第 2 項の規定は、適用しない。
- 3 施行日の前日現在清算会員である者のうち、本取引所が定める方法により清算参加者としての権利及び義務の停止を申請し、本取引所が承認した者については、本取引所が定めるところに従い、清算参加者としての権利又は義務を停止することができる。
- 4 前項の申請をした者が、施行日以降において、本取引所が定める方法により前項に定める停止措置の解除を申請し、本取引所が承認をした場合は、本取引所が指定する日時より清算参加者としての権利及び義務の効力が発生するものとする。
- 5 第 2 項の規定により清算資格の付与を受けた者とみなされる者については、施行日の前日において現に取引参加者規程第 8 条の規定により届出されている取引参加者代表者を、第 9 条の規定により届出した清算参加者代表者とみなす。
- 6 施行日前に成立した第 2 条各号に掲げる取引であって施行日において未決済のものについても、この業務方法書を適用する。

## 附則

- 1 この変更規則は、平成 17 年 7 月 1 日から施行する。
- 2 平成 17 年 7 月 31 日までに為替証拠金清算資格の取得の承認を受けた者が預託すべき為替証拠金清算預託金の額は、第 32 条の規定にかかわらず、1000 万円とする。

## 附則

この変更規定は、平成 17 年 10 月 24 日から施行する。

## 附則

この変更規定は、平成 17 年 12 月 20 日から施行する。

**附則**

この変更規定は、平成 18 年 7 月 3 日から施行する。

**附則**

この変更規定は、平成 19 年 2 月 15 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**

この改正規定は、平成 19 年 12 月 3 日から施行する。

**附則**

この改正規定は、平成 20 年 1 月 1 日から施行する。

**附則**

この改正規定は、平成 20 年 4 月 28 日から施行する。

**附則**

この改正規定は、平成 20 年 6 月 2 日から施行する。

**附則**

この改正規定は、平成 20 年 7 月 14 日から施行する。

#### 附則

- 1 この改正規定は、平成 20 年 7 月 31 日から施行する。
- 2 この改正規定の施行の際現にマーケットメイカーである為替証拠金清算参加者が預託する為替証拠金清算預託金の額については、改正後の第 31 条第 3 項第 1 号ロの規定中「算出基準日における為替証拠金清算参加者の数」とあるのは「20」と、「算出基準日におけるマーケットメイカーの数」とあるのは「6」と読み替えて、改正後の同号の規定により算出した額とする。この場合において、改正後の同条第 5 項中算出基準日に係る部分の規定は適用しない。
- 3 この改正規定の施行の際現に非マーケットメイカーである為替証拠金清算参加者が預託する為替証拠金清算預託金の額については、改正後の第 31 条第 3 項第 2 号ロの規定中「算出基準日における為替証拠金清算参加者の数」とあるのは「20」と、「算出基準日が属する月」とあるのは「平成 20 年 5 月」と読み替えて、改正後の同号の規定により算出した額とする。この場合において、改正後の同条第 5 項中算出基準日に係る部分の規定は適用しない。

#### 附則

- 1 この改正規定は、平成 20 年 10 月 27 日から施行する。
- 2 この改正規定の施行の際現に為替証拠金清算参加者である者の自己取引及び顧客の取引に係る建玉の決済方法については、改正後の第 90 条の 9 第 4 項本文の規定にかかわらず、この改正規定の施行の時に、自己取引及びすべての顧客について改正後の同条第 1 項第 2 号の決済方法を選択したものとみなす。

#### 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 7 月 3 日から施行する。

#### 附則



この改正規定は、平成 21 年 9 月 30 日から施行する。

**附則**

この改正規定は、平成 22 年 4 月 1 日から施行する。

**附則**

この改正規定は、平成 22 年 6 月 28 日から施行する。

**附則**

この改正規定は、平成 22 年 10 月 1 日から施行する。

**附則**

この改正規定は、平成 22 年 11 月 1 日から施行する。

**附則**

この改正規定は、平成 22 年 11 月 22 日から施行する。

**附則**

この変更規則は、平成 23 年 6 月 1 日から施行する。

**附則**

この変更規則は、平成 23 年 7 月 1 日から施行する。

## 附則

この変更規則は、平成 23 年 8 月 1 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 24 年 4 月 23 日から施行する。

## 附則

この変更規則は、平成 24 年 6 月 18 日から施行する。

## 附則

この変更規則は、平成 25 年 3 月 11 日から施行する。

## 附則

- 1 この変更規則は、平成 25 年 3 月 31 日から施行する。
- 2 この変更規則の施行の日から起算して二年を経過する日までの間は、第 5 条第 7 項第 5 号へ、第 8 項第 5 号へ、第 10 項第 4 号へ、第 11 項第 4 号へ、第 12 項第 4 号へ及び第 13 項第 4 号へに規定する国際統一基準に係る連結自己資本規制比率についての連結普通株式等 Tier1 比率、連結 Tier1 比率及び連結総自己資本規制比率の要件は、次の表の左欄に掲げる期間に応じ、同表右欄に掲げるとおりとする。

期間	要件
施行の日から起算して一年を経過する日までの間	連結普通株式等 Tier1 比率が 3.5 パーセント以上、かつ、連結 Tier1 比率が 4.5 パーセント以上、かつ、連結総自己資本規制比率が 8 パーセント以上

	であること
平成 26 年 3 月 31 日から起算して一年を経過する日までの間	連結普通株式等 Tier1 比率が 4 パーセント以上、かつ、連結 Tier1 比率が 5.5 パーセント以上、かつ、連結総自己資本規制比率が 8 パーセント以上であること

#### 附則

- 1 この変更規則は、平成 25 年 4 月 1 日から施行する。
- 2 この変更規則施行の日において、平成 16 年 4 月 1 日付施行の附則第 3 項の規定に基づく権利及び義務の停止が行われている金利先物等清算参加者は、本取引所が定めるところに従い、当該停止の継続の可否を申請するものとする。この場合、停止の継続を申請する金利先物等清算参加者については、第 107 条第 1 項の規定を適用する。

#### 附則

この変更規則は、平成 26 年 3 月 6 日から施行する。

#### 附則

この変更規則は、平成 26 年 4 月 30 日から施行する。

#### 附則

この変更規則は、平成 26 年 9 月 20 日から施行する。

#### 附則

この変更規則は、平成 27 年 7 月 3 日から施行する。

#### 附則

この変更規則は、平成 27 年 11 月 2 日から施行する。

#### 附則

この変更規則は、平成 27 年 11 月 30 日から施行する。

## 附則

この変更規則は、平成 27 年 12 月 14 日から施行する。

## 附則

この変更規則は、平成 27 年 12 月 24 日から施行する。

## 附則

- 1 この変更規則は、平成 29 年 2 月 27 日から施行する。
- 2 この変更規則施行の日（以下「施行日」という。）の前日において、現に次の各号に該当する清算参加者である者は、施行日以降において、当該各号に掲げる清算参加者とみなす。
  - (1) 変更前の第 5 条第 7 項に定める為替証拠金清算参加者 変更後の第 5 条第 9 項に定める証拠金自社清算参加者
  - (2) 変更前の第 5 条第 8 項に定める為替証拠金清算参加者 変更後の第 5 条第 10 項に定める証拠金自社清算参加者
  - (3) 変更前の第 5 条第 10 項に定める株価指数証拠金他社清算参加者 変更後の第 5 条第 7 項に定める証拠金他社清算参加者
  - (4) 変更前の第 5 条第 11 項に定める株価指数証拠金他社清算参加者 変更後の第 5 条第 8 項に定める証拠金他社清算参加者
  - (5) 変更前の第 5 条第 12 項に定める株価指数証拠金自社清算参加者 変更後の第 5 条第 9 項に定める証拠金自社清算参加者
  - (6) 変更前の第 5 条第 13 項に定める株価指数証拠金自社清算参加者 変更後の第 5 条第 10 項に定める証拠金自社清算参加者
- 3 この変更規則の施行日の前日において、現に為替証拠金清算参加者が本取引所へ預託した為替証拠金清算預託金及び現に株価指数証拠金清算参加者が本取引所へ預託した株価指数証拠金清算預託金は、施行日以降において、証拠金清算参加者が本取引所へ預託した証拠金取引清算預託金とみなす。

## 附則

この変更規則は、平成 29 年 6 月 9 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。