

業務方法書施行規則

(目的)

第1条 この規則は、業務方法書（以下「方法書」という。）に基づき、本取引所が定める事項について規定する。

(提携市場デリバティブ取引)

第2条 方法書第2条第2号に規定する金融指標は、業務規程第3条第1号に規定する金融指標とする。

(平成19年9月30日 変更)

(提携外国清算機関に支払う金銭)

第3条 方法書第28条第2項に規定する本取引所が別に定める金銭は次のとおりとする。

本取引所は、提携契約に従い、外国建玉につき提携外国清算機関が提携外国取引所の会員から受け取る金銭の総額と提携外国取引所の会員に支払う金銭の総額の差額を、提携外国清算機関と授受する。このとき、本取引所は、当該受け取る金銭から当該支払う金銭を差し引いた差額が、負の数となるときは、当該差額に係る金銭を提携外国清算機関に支払わなければならない。

(平成19年9月30日 変更)

第4条 (削除)

(平成17年12月20日 変更)

(届出事項)

第5条 方法書第9条の2及び第14条の3に規定する本取引所への届出は、所定の届出書に本取引所が必要と認める書類を添付して行うものとする。

(平成19年9月30日 変更)

(報告事項)

第6条 方法書第14条の4に規定する本取引所への報告は、所定の報告書に本取引所が必要と認める書類を添付して行うものとする。

(平成19年9月30日 変更)

(特別金融商品取引業者等に係る報告事項)

第6条の2 方法書第14条の4第5項に規定する本取引所が別に定める場合は、次に掲げる場合とする。

- (1) 法第57条の2第1項又は第6項第2号の規定により届出を行った場合
- (2) その親会社（取引参加者の総株主の議決権の過半数を有する法人をいう。）が法第57条の12第1項に規定する指定を受けた場合
- (3) その指定親会社（法第57条の12第3項に規定する指定親会社をいう。以下同じ。）が法第57条の13第1項第6号に掲げる事項について法第57条の14の届出を行ったことを知った場合
- (4) その指定親会社に破産手続開始、再生手続開始、更生手続開始、清算開始又は特別清算開始の申立ての事実があったことを知った場合
- (5) その指定親会社が支払不能となり、又は支払不能となるおそれがある状態となったことを知った場合
- (6) その指定親会社が市場デリバティブ取引にかかる法令の規定（指定親会社が外国法人である場合にあっては、法令に相当する外国の法令の規定を含む。）により処分若しくは処罰を受けたことを知った場合又は市場デリバティブ取引にかかる法令の規定による処分に係る聴聞若しくは弁明の機会の付与が行われたことを知った場合
- (7) その親会社について、指定親会社としての指定が解除されたこと又は当該指定が効力を失ったことを知った場合
- (8) その指定親会社が他の法人と合併したことを知った場合（当該指定親会社が合併により消滅したときを除く。）
- (9) その指定親会社が内閣総理大臣、金融庁長官又は証券取引等監視委員会に申請、届出等を行ったことを知った場合その他の場合で、本取引所がその内容について報告の必要があると認めたとき。
- (10) その株主について、特定主要株主（法第32条第4項に規定する特定主要株主をいう。）に該当したこと又は該当しなくなったことを知った場合

（平成23年6月1日 追加）

(財務報告)

第7条 方法書第14条の5第1項及び第2項に規定する財務報告は、単体及び連結決算ベースの本取引所が必要と認める書類により毎事業年度経過後3か月以内に行うものとする。ただし、清算参加者が外国の法令に準拠して設立されたもので、かつ、行政官庁より事業報告書の提出期間の延長の承認を受けた場合において、当該清算参加者が本取引所へその内容等を届け出たときは、当該財務報告をその承認を受けた期間内に行うものとする。

2 前項の規定にかかわらず、清算参加者又は親会社等が保険業法に準拠して設立された法人であるときは、当該清算参加者又は当該親会社等の財務報告を毎事業年度経過後4か月以内に行うものとする。

- 3 第1項の規定にかかわらず、清算参加者の親会社等が外国の法令に準拠して設立されたもので、当該清算参加者が、当該親会社等のその本国の会計帳簿の作成に関する法令又は慣行により、第1項に定める日までに当該親会社等の財務報告を行うことができない場合には、本取引所が定めるところにより、本取引所の承認を受けた期間内に行うものとする。

(平成18年7月3日、平成19年9月30日、平成20年4月28日、平成23年6月1日、平成23年8月1日 変更)

(清算資格の取得申請)

第8条 方法書第4条第1項又は第3項に規定する清算資格の取得申請は、所定の申請書に本取引所が必要と認める書類を添付して行うものとする。

(平成26年3月6日 変更)

(清算委託契約の締結の届出)

第9条 方法書第16条第6項に規定する清算委託契約の締結の届出は、所定の届出書に本取引所が必要と認める書類を添付して行うものとする。なお、清算委託契約の締結は、非清算参加者1人につき清算参加者1人を原則とする。

(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)

第10条 方法書第11条第1項に規定する清算資格の喪失申請は、所定の申請書に本取引所が必要と認める書類を添付して行うものとする。

(清算委託契約の解約の承認申請)

第11条 方法書第19条第1項に規定する清算委託契約の解約の承認申請は、当該清算委託契約の当事者の双方が当事者である受管契約を解約した後、所定の申請書に本取引所が必要と認める書類を添付して行うものとする。

2 方法書第16条第7項に規定する本取引所が別に定める場合は、次の各号のいずれかに該当するときとする。この場合には、同第19条第1項の規定による清算委託契約の解約の承認申請を要しない。

- (1) 非清算参加者が清算資格を取得し、方法書第7条の規定による引継ぎが終了した後に清算委託契約が合意解約された場合
- (2) 非清算参加者が取引資格を喪失し、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、当該非清算参加者の計算により発生したギブアップに係る市場デリバティブ取引及び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がない場合において、清算委託契約が合意解約されたとき又は本取引所が取引参加者規程第32条の規定により決済を行わせその決済が終了した後

に清算委託契約が合意解約されたとき

- (3) 清算参加者が取引資格を喪失し、当該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金利先物等取引、当該非清算参加者の計算により当該清算参加者の名において発生したギブアップに係る金利先物等取引及び当該非清算参加者の計算により当該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がない場合において、清算委託契約が合意解約されたとき又は取引参加者規程第 33 条第 2 項の規定による整理が終了した後に清算委託契約が合意解約されたとき。

(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)

(清算預託金の追加預託の期限)

- 第 12 条 方法書第 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に不足を生じた清算参加者は、次条第 1 項第 1 号に規定する第一算出基準日及び第二算出基準日から起算してそれぞれ 7 営業日（業務規程第 6 条の 2 に規定する営業日をいう。以下この条、次条及び第 12 条の 3 において同じ。）目の日までのいずれかの営業日の午前 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清算預託金として本取引所に預託しなければならない。ただし、本取引所が必要と認めるときは、別に預託期限を定めることができる。
- 2 方法書第 31 条第 3 項に規定する預託すべき証拠金取引清算預託金の額に不足を生じた清算参加者は、第 12 条の 3 第 1 項第 1 号に規定する第一算出基準日及び第二算出基準日から起算してそれぞれ 7 営業日目の日までのいずれかの営業日の午前 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清算預託金として本取引所に預託しなければならない。ただし、本取引所が必要と認めるときは、別に預託期限を定めることができる。
 - 3 前 2 項の規定にかかわらず、方法書第 33 条の規定により本取引所が清算預託金の額を臨時に変更した場合において、預託すべき金利先物等清算預託金又は証拠金取引清算預託金の額に不足を生じた清算参加者は、原則として、当該不足が生じた営業日の翌営業日の本取引所が定める時刻までに、当該不足の額に相当する額以上の金銭又は有価証券を清算預託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 20 年 4 月 28 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 10 月 1 日、平成 27 年 7 月 3 日、平成 29 年 2 月 27 日 変更)

(金利先物等清算預託金の額)

- 第 12 条の 2 方法書第 31 条第 2 項に規定する本取引所が別に定めるところにより算出する預託すべき金利先物等清算預託金の額は、金利先物等清算参加者ごとに、次に掲げるところにより算出する。

- (1) 一の金利先物等清算参加者について、金利先物等取引の種類ごとに次の算式により PML (Probable Maximum Loss) 基礎額を得る。

PML 基礎額 = 第一算出基準日（毎月第一営業日の 6 営業日前の営業日をいう。）及び第二算出基準日（毎月 15 日（この日が日本の銀行休業日にあたる場合は、順次繰り下げる。）の 6 営業日前の営業日をいう。）の各算出基準日において当該金利先物等清算参加者が保有する買建玉と売建玉の数量差 × 取引単位 × 当該金利先物等取引に係る価格変動サンプル期間（本取引所が定める開始日から算出基準日までをいう。）における連続する 2 取引日間の清算価格の変動率 × 各算出基準日における清算価格 + (各算出基準日における清算価格 - 各算出基準日の前取引日における清算価格) × 各算出基準日の前取引日において当該金利先物等清算参加者が保有する買建玉と売建玉の数量差 × 取引単位

- (2) 一の金利先物等清算参加者について、金利先物等取引の種類ごとに算出した PML 基礎額を全て合計し、PML 額を得る。

- (3) 一の金利先物等清算参加者について、次の算式により基準 PML 額を得る。

基準 PML 額 = PML 額 - 各算出基準日における自己取引分に係る証拠金預託額 - 各算出基準日の前取引日における受託取引分及び有価証券等清算取次ぎ分に係る証拠金所要額

- (4) 前号で得られた基準 PML 額の各集合について、基準 PML 額が最大となる金利先物等清算参加者、本取引所が定める時点における純資産額が最少の金利先物等清算参加者、純資産額が 2 番目に少ない金利先物等清算参加者及び純資産額が 3 番目に少ない金利先物等清算参加者の基準 PML 額の合計額を算出する。

- (5) 前号で得られた基準 PML 額の合計額のうち最大値を、各算出基準日における損失残額とする。

- (6) 各算出基準日から遡る 6 ヶ月間の各取引日について、第 1 号から前号までに規定する方法と同様にして当該取引日における損失残額を算出し、うち最大値を最大損失残額とする。このとき、各算式中「各算出基準日」とあるのは「当該取引日」と読み替えるものとする。

- (7) 最大損失残額から、金利先物等取引違約損失積立金の額を控除することにより、預託すべき金利先物等取引清算預託金の総額を得る。

- (8) 各算出基準日において一の金利先物等清算参加者が保有する一の金利先物等取引に係る売建玉と買建玉の数量差の絶対値に、当該金利先物等取引に係る取引単位、価格変動サンプル期間の連続する 2 取引日間の清算価格の変動率の絶対値の最大値及び各算出基準日における清算価格を乗じた額を、全ての金利先物等取引について合計した額を得る。

- (9) 前号で得られた額から、各算出基準日における当該金利先物等清算参加者の証拠金所要額を控除し、最大価格変動に対する取引証拠金の不足額を算出する。

- (10) 第 7 号で得た預託すべき金利先物等清算預託金の総額から、金利先物等清算参加者の数に 5,000 万円を乗じた額を控除して得られた額を、前号で得た一の金利先物等清算参加者に係る最大価格変動に対する取引証拠金の不足額に基づき按分する。

- (11) 前号で一の金利先物等清算参加者につき得られた額に 5,000 万円を加えた額を、当該金利先物等清算参加者が預託すべき金利先物等清算預託金の額とする。
- 2 前項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。

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

(証拠金取引清算預託金の額)

第 12 条の 3 方法書第 31 条第 3 項に規定する本取引所が別に定めるところにより算出する預託すべき証拠金取引清算預託金の額は、証拠金清算参加者ごとに、次に掲げるところにより算出する。

- (1) 一の証拠金清算参加者について、次の算式により PML (Probable Maximum Loss) 基礎額を得る。

PML 基礎額 = 第一算出基準日 (毎月第一営業日の 6 営業日前の営業日をいう。) 及び第二算出基準日 (毎月 15 日 (この日が日本の銀行休業日にあたる時は、順次繰り下げる。) の 6 営業日前の営業日をいう。) の各算出基準日において当該証拠金清算参加者が保有する取引所為替証拠金取引の種類ごとの売建玉と買建玉の数量差の絶対値 × 取引単位 × 当該取引所為替証拠金取引に係る価格変動サンプル期間 (本取引所が定める開始日から各算出基準日までをいう。) における連続する 2 取引日間の当該取引所為替証拠金取引に係る為替清算価格の変動率 (価格変動サンプル期間の開始日が当該取引所為替証拠金取引の上場日以前であるときは、価格変動サンプル期間開始日から当該取引所為替証拠金取引の上場日までの間の、当該取引所為替証拠金取引の対象となる金融指標の価格として本取引所が適当と認める数値の連続 2 日間の変動率を含む。第 8 号において同じ。) × 各算出基準日における当該取引所為替証拠金取引に係る為替清算価格 (当該取引所為替証拠金取引がクロスカレンシー取引 (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 20 号に規定するクロスカレンシー取引をいう。) であるときは、さらに各算出基準日における当該取引所為替証拠金取引の計算通貨 (為替特例第 2 条第 22 号に規定する計算通貨をいう。) 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。以下この号において同じ。) 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。以下この号において同じ。) 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。第 35 条の 6 第 1 項及び第 2 項において同じ。) の為替清算価格を乗じる。) + 各算出基準日において当該証拠金清算参加者が保有する取引所株価指数証拠金取引の種類ごとの買建玉と売建玉の数量差の絶対値 × 取引単位 × 当該取引所株価指数証拠金取引に係る価格変動サンプル期間 (本取引所が定める開始日から各算出基準日までをいう。) にお

ける連続する 2 取引日間の当該取引所株価指数証拠金取引に係る株価指数清算価格の変動率（価格変動サンプル期間の開始日が当該取引所株価指数証拠金取引の上場日以前であるときは、価格変動サンプル期間開始日から当該取引所株価指数証拠金取引の上場日までの間の、当該取引所株価指数証拠金取引の対象となる金融指標の価格として本取引所が適当と認める数値の連続 2 日間の変動率を含む。第 8 号において同じ。）×各算出基準日における当該取引所株価指数証拠金取引に係る株価指数清算価格

- (2) 一の証拠金清算参加者について、次の算式により PML 額を得る。

$$\text{PML 額} = \text{PML 基礎額の全ての合計} + \text{各算出基準日における自己取引分に係る為替取引証拠金及び株価指数取引証拠金の不足額} + (\text{各算出基準日における受託取引分及び有価証券等清算取次ぎ分に係る為替取引証拠金及び株価指数取引証拠金の不足額} - \text{各算出基準日における為替取引証拠金及び株価指数取引証拠金に係る立替預託の額 (負の数となるときは零とみなし計算する。)})$$

- (3) 一の証拠金清算参加者について、次の算式により基準 PML 額を得る。

$$\text{基準 PML 額} = \text{PML 額} - \{(\text{各算出基準日における自己取引分に係る為替取引証拠金預託額} \pm \text{為替差金 (業務方法書第 90 条の 8 第 1 項に規定する為替差金をいう。為替差金が正の数ときは当該正の数を当該為替取引証拠金預託額に加算し、負の数ときは減算する。)}) + \text{各算出基準日の前取引日における受託取引分及び有価証券等清算取次ぎ分に係る一の取引所為替証拠金取引の為替証拠金基準額} + \text{保有する当該取引所為替証拠金取引に係る売建玉と買建玉のいずれか多い方の数量 (以下本条において「MAX 建玉数」という。)} \times \text{全ての取引所為替証拠金取引の種類ごとに算出しそれらを合計した数値} + (\text{各算出基準日における自己取引分に係る株価指数証拠金預託額} \pm \text{株価指数差金 (業務方法書第 90 条の 19 に規定する株価指数差金をいう。株価指数差金が正の数ときは当該正の数を当該株価指数取引証拠金預託額に加算し、負の数ときは減算する。)}) + \text{各算出基準日の前取引日における受託取引分及び有価証券等清算取次ぎ分に係る一の取引所株価指数証拠金取引の株価指数証拠金基準額} + \text{保有する当該取引所株価指数証拠金取引に係る売建玉と買建玉の数量差の絶対値 (以下本条において「ネット建玉数」という。)} \times \text{全ての取引所株価指数証拠金取引の種類ごとに算出しそれらを合計した数値}\}$$

- (4) 前号で得られた基準 PML 額の各集合について、基準 PML 額が最大となる証拠金清算参加者、本取引所が定める時点における純資産額が最少の証拠金清算参加者及び純資産額が 2 番目に少ない証拠金清算参加者の基準 PML 額の合計額を算出する。
- (5) 前号で得られた基準 PML 額の合計額のうち、最大となる数値を、各算出基準日における損失残額とする。
- (6) 各算出基準日から遡る 6 ヶ月間の各取引日について、第 1 号から前号までの手順と同様にして、当該取引日における損失残額を算出し、うち最大値を最大損失残額とする。このとき、各算式中「各算出基準日」とあるのは「当該取引日」と読み替えるものとする。
- (7) 前号で得られた最大損失残額から、証拠金取引違約損失積立金を控除して、預託すべき

証拠金取引清算預託金の総額を得る。

- (8) 一の証拠金清算参加者について、次の算式により最大価格変動に対する為替取引証拠金の不足相当額を得る。当該不足相当額は、全ての取引所為替証拠金取引の種類ごとに算出しそれらを合計した額とする。

為替取引証拠金の不足相当額＝（各算出基準日において一の証拠金清算参加者が保有する一の取引所為替証拠金取引に係るネット建玉数×当該取引所為替証拠金取引に係る取引単位×価格変動サンプル期間の連続する2取引日間の為替清算価格の変動率の絶対値の最大値^(注)×各算出基準日における為替清算価格－各算出基準日において当該証拠金清算参加者が保有する一の取引所為替証拠金取引に係るMAX建玉数×当該取引所為替証拠金取引の為替証拠金基準額（ただし、マーケットメイカーにあって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第22条の4第1項の規定に従い算出する額とする。））×本取引所が定めるところにより当該証拠金清算参加者に適用する係数

（注）当該変動率の絶対値について、最大値の次に大きな値（以下本号において「第二位の値」という。）に2を乗じた値が、最大値以下となる場合は、第二位の値を用いる。

- (9) 一の証拠金清算参加者について、次の算式により最大価格変動に対する株価指数取引証拠金の不足相当額を得る。当該不足相当額は、全ての取引所株価指数証拠金取引の種類ごとに算出しそれらを合計した額とする。

株価指数取引証拠金の不足相当額＝（各算出基準日において一の証拠金清算参加者が保有する一の取引所株価指数証拠金取引に係るネット建玉数×当該取引所株価指数証拠金取引に係る取引単位×価格変動サンプル期間の連続する2取引日間の株価指数清算価格の変動率の絶対値の最大値^(注)×各算出基準日における株価指数清算価格－各算出基準日において当該証拠金清算参加者が保有する一の取引所株価指数証拠金取引に係るネット建玉数×当該取引所株価指数証拠金取引の株価指数証拠金基準額（ただし、マーケットメイカーにあって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第4条の2第1項及び第2項の規定に従い算出する額とする。））×本取引所が定めるところにより当該証拠金清算参加者に適用する係数

（注）当該変動率の絶対値について、最大値の次に大きな値（以下本号において「第二位の値」という。）に2を乗じた値が、最大値以下となる場合は、第二位の値を用いる。

- (10) 一の証拠金清算参加者について、第8号及び前号で得た額を合計した額を得る。
- (11) 第7号で得た預託すべき証拠金取引清算預託金の総額から、証拠金清算参加者の数に500万円を乗じた額を控除して得られた額を、前号で得た額に基づき各証拠金清算参加者に按分する。
- (12) 前号で一の証拠金清算参加者につき得られた額に500万円を加えた額を、当該証拠金清算参加者が預託すべき証拠金取引清算預託金の額とする。

- 2 前項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。

(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 27 年 7 月 3 日、平成 27 年 11 月 2 日、平成 27 年 11 月 30 日、平成 29 年 2 月 27 日、平成 30 年 1 月 22 日 変更)

第 12 条の 3 の 2 (削除)

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

第 12 条の 4 (削除)

(平成 22 年 10 月 1 日 追加、平成 27 年 7 月 3 日、平成 27 年 11 月 2 日、平成 29 年 2 月 27 日 変更)

第 12 条の 4 の 2 (削除)

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

(転売又は買戻しの申告数量の修正)

第 13 条 方法書第 42 条第 3 項に規定する転売又は買戻しの申告数量の修正は、次の各号に定める方法により、自己又は委託の別ごとに各限月取引について行うものとする。

- (1) 転売の申告数量が、当該取引日に当該取引参加者のなした呼び値により成立した売付取引の数量に当該取引参加者の計算により発生した清算売建玉の数量を加えて得た数量（以下「当日売付取引数量」という。）を上回る場合には、当該当日売付取引数量の転売の申告が行われたものとみなす。
- (2) 買戻しの申告数量が、当該取引日に当該取引参加者のなした呼び値により成立した買付取引の数量に当該取引参加者の計算により発生した清算買建玉の数量を加えて得た数量（以下「当日買付取引数量」という。）を上回る場合には、当該当日買付取引数量の買戻しの申告が行われたものとみなす。
- (3) 転売及び買戻しの申告数量の合計が、当該転売又は買戻しを行った取引日の前取引日終了時における売建玉数量（当該終了時以降に建玉移管が行われた場合は、移管建玉数量を調整した売建玉数量）及び当日売付取引数量の合計（以下「転売対象数量」という。）又は当該前取引日終了時における買建玉数量（当該終了時以降に建玉移管が行われた場合は、移管建玉数量を調整した買建玉数量）及び当日買付取引数量の合計（以下「買戻し対象数量」という。）を上回る場合には、当該申告後の建玉数量を以下の各号のいずれかとする転売又は買戻しの申告が行われたものとみなす。

イ 買戻し対象数量が転売対象数量を上回る場合は、当該転売又は買戻しを行った取引日における売建玉数量については零とし、買建玉数量については買戻し対象数量から

転売対象数量を減じた数量とする。

ロ 転売対象数量が買戻し対象数量を上回る場合は、当該転売又は買戻しを行った取引日における売建玉数量については転売対象数量から買戻し対象数量を減じた数量とし、買建玉数量については零とする。

- 2 方法書第 43 条第 3 項に規定する転売又は買戻しの申告数量の修正については、前項各号の規定を準用する。この場合において、前項第 1 号中「当該取引参加者の計算により発生した清算売建玉」とあるのは「当該非清算参加者の指定清算参加者の計算により発生した清算受託売建玉」と、前項第 2 号中「当該取引参加者の計算により発生した清算買建玉」とあるのは「当該非清算参加者の指定清算参加者の計算により発生した清算受託買建玉」と、前項第 3 号中「売建玉数量」とあるのは「指定清算参加者の清算受託売建玉数量」と、「買建玉数量」とあるのは「指定清算参加者の清算受託買建玉数量」と読み替えるものとする。

(平成 19 年 9 月 30 日 変更)

(転売又は買戻しの申告の方法)

第 14 条 方法書第 44 条の規定により、本取引所が定める転売又は買戻しの申告の方法は、次の各号に掲げる方法とする。

- (1) 金利先物等取引について、成立した金利先物等取引又は発生した清算建玉ごとに、転売又は買戻しの別を本取引所に申告する方法（以下「個別申告」という。）
- (2) 金利先物等取引について、自己又は委託の別ごとに各限月取引について、当日売付取引数量のうち転売に係る数量及び当日買付取引数量のうち買戻しに係る数量を本取引所に申告する方法（以下「一括申告」という。）
- (3) 取引所為替証拠金取引について、方法書第 90 条の 9 の 2 の規定による転売・買戻しの申告
- (4) 取引所株価指数証拠金取引について、方法書第 90 条の 22 の規定による転売・買戻しの申告

(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)

(転売又は買戻しの申告時限)

第 15 条 方法書第 44 条の規定により、本取引所が定める金利先物等取引に係る転売又は買戻しの申告の時限は、個別申告にあつては当該転売又は買戻しを行ったときから、一括申告にあつては当該転売又は買戻しを行った取引日の日中取引時間帯が属する営業日の前営業日の午後 5 時以降の本取引所が通知を行ったときから、当該日中取引時間帯の属する営業日の午後 5 時までに行うものとする。ただし、取引最終日を迎えた限月取引（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。）については、金融指標等の種類に応じ、次の各号に定める時限までに行うものとする。

- (1) ユーロ円 3 ヶ月金利先物、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

個別申告にあつては当該転売又は買戻しを行ったときから、一括申告にあつては当該転売又は買戻しを行った取引日の日中取引時間帯が属する営業日の前営業日の午後5時以降の本取引所が通知を行ったときから、当該日中取引時間帯の属する営業日の午後4時

(2) ユーロ円LIBOR6ヵ月金利先物

個別申告にあつては当該転売又は買戻しを行ったときから、一括申告にあつては当該転売又は買戻しを行った取引日の夜間取引時間帯が属する営業日の午後5時以降の本取引所が通知を行ったときから、当該営業日の翌営業日の午前11時

2 方法書第90条の9の2第1項に規定する本取引所が定める取引所為替証拠金取引に係る転売・買戻しの申告の時限は、次の各号に掲げる場合により、当該各号に定める時限とする。

- (1) 決済の対象となる建玉の一方又は双方が当該転売・買戻しの申告を行う取引日における取引により発生している場合 当該取引の成立時から当該取引日の当該決済に係る取引所為替証拠金取引の付合せ時間帯の終了時刻を10分経過した時まで
- (2) 決済の対象となる建玉の双方がロールオーバーにより発生している場合 以下に掲げるとおりとする。

イ 当該決済に係る取引所為替証拠金取引の取引日が週の最初の取引日であるとき

当該取引日における中国人民元・日本円取引所為替証拠金取引、韓国ウォン・日本円取引所為替証拠金取引及びインドルピー・日本円取引所為替証拠金取引を除く取引所為替証拠金取引のプレオープン時間帯の開始時から当該決済に係る取引所為替証拠金取引の付合せ時間帯の終了時刻を10分経過した時まで

ロ 当該決済に係る取引所為替証拠金取引の取引日が週の最初の取引日でないとき

当該取引日における中国人民元・日本円取引所為替証拠金取引、韓国ウォン・日本円取引所為替証拠金取引及びインドルピー・日本円取引所為替証拠金取引を除く取引所為替証拠金取引の付合せ時間帯の開始時から当該決済に係る取引所為替証拠金取引の付合せ時間帯の終了時刻を10分経過した時まで

3 方法書第90条の22第1項に規定する本取引所が定める取引所株価指数証拠金取引に係る転売・買戻しの申告の時限は、次の各号に掲げる場合により、当該各号に定める時限とする。

- (1) 決済の対象となる建玉の一方又は双方が当該転売・買戻しの申告を行う取引日における取引により発生している場合 当該取引の成立時から当該取引日の当該決済に係る取引所株価指数証拠金取引の付合せ時間帯の終了時刻を10分経過した時まで
- (2) 決済の対象となる建玉の双方がロールオーバーにより発生している場合 以下に掲げるとおりとする。

イ 当該決済に係る取引所株価指数証拠金取引の取引日が週の最初の取引日であるとき

当該取引日における中国人民元・日本円取引所為替証拠金取引、韓国ウォン・日本円取引所為替証拠金取引及びインドルピー・日本円取引所為替証拠金取引を除く取引所為替証拠金取引のプレオープン時間帯の開始時から当該決済に係る取引所株価指数証拠金取引の付合せ時間帯の終了時刻を10分経過した時まで

- ロ 当該決済に係る取引所株価指数証拠金取引の取引日が週の最初の取引日でないとき
当該取引日における中国人民元・日本円取引所為替証拠金取引、韓国ウォン・日本円取引所為替証拠金取引及びインドルピー・日本円取引所為替証拠金取引を除く取引所為替証拠金取引の付合せ時間帯の開始時から当該決済に係る取引所株価指数証拠金取引の付合せ時間帯の終了時刻を10分経過した時まで
- 4 前2項の規定にかかわらず、本取引所が必要と認める場合は、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係る転売・買戻しの申告の時限を改めて定めることができる。
- 5 前3項の規定による転売・買戻しの申告については、特定の付合せ時間帯終了後に行われた申告は、当該付合せ時間帯の終了時が属する取引日に行われたものとみなす。

(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20年10月27日、平成22年10月1日、平成23年8月1日、平成23年12月1日、平成24年4月23日、平成25年10月28日、平成29年7月24日 変更)

(転売又は買戻しの申告内容の訂正等)

第16条 方法書第44条の規定により、転売又は買戻しの申告内容の訂正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) 転売又は買戻しの申告内容の訂正の申告

真にやむを得ない事由に基づき、転売又は買戻しの申告内容について訂正を行おうとする取引参加者（当該取引参加者が非清算参加者の場合は、事前にその指定清算参加者の承諾を得るものとする。）は、当該転売又は買戻しを行った取引日の日中取引時間帯が属する営業日から次のイ又はロに定める時限までに本取引所に訂正内容を申告しなければならない。ただし、取引最終日を迎えた限月取引に係る転売又は買戻しの申告については、その内容の訂正を行うことはできないものとする。

イ 自己の計算により成立させた市場デリバティブ取引又は清算建玉

翌営業日（ユーロ円先物遠隔地取引参加者にあつては翌々営業日）の午前10時まで

ロ 顧客の委託に基づく市場デリバティブ取引又は清算建玉

3営業日後の午前10時まで

(2) 申告内容の訂正結果の確認

前号に規定する訂正の申告を行った取引参加者は、本取引所が実行した当該申告内容の訂正結果を直ちに確認するものとする。

- 2 前項の規定にかかわらず、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、転売又は買戻しの申告内容の訂正はできないものとする。

(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21年6月1日、平成22年10月1日 変更)

(清算価格の決定方法等)

第17条 方法書第45条第2項に規定する算出基準時間帯は、当該日中取引時間帯の終了時から当該取引日の夜間取引時間帯の開始時までの間で本取引所がその都度必要と認める時間帯

とする。

2 方法書第 45 条第 3 項に規定する算出基準時間帯に約定価格がない場合における清算価格の算出は、次の各号に定める方法による。

- (1) 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の差を当該取引日の直近の限月取引の清算価格に反映させて算出した価格とする。
- (2) 前号における価格が算出できないとき又は前号の方法により算出した価格が適正でないと判断したときは、本取引所は市場実勢その他の事由を勘案し、適正と認める清算価格を決定するものとする。

(平成 23 年 12 月 1 日 変更)

(取引所と清算参加者間の金銭の授受)

第 18 条 方法書第 46 条第 1 項及び第 47 条第 1 項の規定による金銭の授受の時限は、円資金決済規則に定めるところによるものとする。

(平成 17 年 12 月 20 日 変更)

(清算参加者と非清算参加者間の金銭の授受)

第 19 条 方法書第 46 条第 2 項及び第 47 条第 2 項の規定による金銭の授受の時限は、前条に定める時限（非清算参加者がユーロ円先物遠隔地取引参加者である場合は、その指定清算参加者が定める時限）を適用する。

(平成 21 年 6 月 1 日 変更)

第 20 条 (削除)

(平成 17 年 7 月 1 日、平成 17 年 12 月 20 日、平成 20 年 4 月 28 日 変更)

(差金決済数値の決定の基準時点)

第 21 条 取引最終日を迎えた限月取引について、当該取引日に市場デリバティブ取引及びその建玉がないときは、本取引所は当該限月取引の差金決済数値を定めないのである。

(平成 17 年 12 月 20 日、平成 19 年 9 月 30 日 変更)

第 22 条、第 23 条 (削除)

(平成 17 年 12 月 20 日 変更)

(現在価値の算出式等)

第 24 条 方法書第 70 条第 1 項、第 72 条第 1 項、第 74 条第 1 項及び第 76 条第 1 項に規定する算出式は、別表第 1「現在価値の算出式」に定めるものとする。

2 方法書第 70 条第 2 項、第 72 条第 2 項、第 74 条第 2 項及び第 76 条第 2 項に規定する方法は、別表第 2「線形補間の方法」に定めるものとする。

(取引所と清算参加者間のオプション料の授受)

第 25 条 方法書第 77 条第 1 項及び第 3 項の規定によるオプション料の授受の時限は、円資金決済規則に定めるところによるものとする。

(清算参加者と非清算参加者間のオプション料の授受)

第 26 条 方法書第 77 条第 2 項及び第 4 項の規定によるオプション料の授受の時限は、前条に定める時限（非清算参加者がユーロ円先物遠隔地取引参加者である場合は、その指定清算参加者が定める時限）を適用する。

(平成 21 年 6 月 1 日 変更)

第 27 条 (削除)

(平成 20 年 4 月 28 日 変更)

(オプションに係る転売又は買戻しの申告数量の修正)

第 28 条 方法書第 81 条第 3 項に規定する転売又は買戻しの申告数量の修正は、次の各号に定める方法により、自己又は委託の別ごとに各銘柄について行うものとする。

- (1) 転売の申告数量が、当該取引日に当該取引参加者のなした呼び値により成立した売付取引の数量（以下「当日売付取引数量」という。）を上回る場合には、当該当日売付取引数量の転売の申告が行われたものとみなす。
- (2) 買戻しの申告数量が、当該取引日に当該取引参加者のなした呼び値により成立した買付取引の数量（以下本条において「当日買付取引数量」という。）を上回る場合には、当該当日買付取引数量の買戻しの申告が行われたものとみなす。
- (3) 転売及び買戻しの申告数量の合計が、当該転売又は買戻しを行った取引日の前取引日終了時における売建玉数量（当該終了時以降に建玉移管が行われた場合は、移管建玉数量を調整した売建玉数量）及び当日売付取引数量の合計（以下「転売対象数量」という。）又は当該前取引日終了時における買建玉数量（当該終了時以降に建玉移管が行われた場合は、移管建玉数量を調整した買建玉数量）及び当日買付取引数量の合計（以下「買戻し対象数量」という。）を上回る場合には、当該申告後の建玉数量を以下の各号のいずれかとする転売又は買戻しの申告が行われたものとみなす。

イ 買戻し対象数量が転売対象数量を上回る場合は、当該転売又は買戻しを行った取引日

における売建玉数量については零とし、買建玉数量については買戻し対象数量から転売対象数量を減じた数量とする。

ロ 転売対象数量が買戻し対象数量を上回る場合は、当該転売又は買戻しを行った取引日における売建玉数量については転売対象数量から買戻し対象数量を減じた数量とし、買建玉数量については零とする。

- 2 方法書第 82 条第 3 項に規定する転売又は買戻しの申告数量の修正については、前項各号の規定を準用する。この場合において、前項第 3 号中「売建玉数量」とあるのは「指定清算参加者の清算受託売建玉数量」と、「買建玉数量」とあるのは「指定清算参加者の清算受託買建玉数量」と読み替えるものとする。

(平成 19 年 9 月 30 日 変更)

(オプションに係る転売又は買戻しの申告の方法)

第 29 条 方法書第 83 条の規定により、本取引所が定める転売又は買戻しの申告の方法は、次の各号に掲げる方法とする。

- (1) 成立したユーロ円 3 ヶ月金利先物オプション取引ごとに、転売又は買戻しの別を本取引所に申告する方法（以下「個別申告」という。）
- (2) 自己又は委託の別ごとに各銘柄について、当日売付取引数量のうち転売に係る数量及び当日買付取引数量のうち買戻しに係る数量を本取引所に申告する方法（以下「一括申告」という。）

(平成 17 年 7 月 1 日、平成 19 年 9 月 30 日 変更)

(オプションに係る転売又は買戻しの申告時限及び申告内容の訂正等)

第 30 条 方法書第 83 条の規定により、本取引所が定める転売又は買戻しの申告の時限及び申告内容の訂正は、次の各号に掲げるとおりとする。

- (1) 転売又は買戻しの申告時限

方法書第 81 条及び第 82 条に規定する転売又は買戻しの申告は、個別申告にあつては当該転売又は買戻しを行ったときから、一括申告にあつては当該転売又は買戻しを行った取引日の日中取引時間帯が属する営業日の前営業日の午後 5 時以降の本取引所が通知を行ったときから、当該日中取引時間帯の属する営業日の午後 5 時までに行うものとする。ただし、取引最終日を迎えた限月取引については、当該取引最終日の日中取引時間帯の属する営業日の午後 2 時 45 分までに行うものとする。

- (2) 転売又は買戻しの申告内容の訂正の申告

真にやむを得ない事由に基づき、ユーロ円 3 ヶ月金利先物オプション取引に係る転売又は買戻しの申告内容について訂正を行おうとする取引参加者（当該取引参加者が非清算参加者の場合は、事前にその指定清算参加者の承諾を得るものとする。）は、当該転売又は買戻しを行った取引日の日中取引時間帯が属する営業日から次のイ又はロに定める時限まで

に本取引所に訂正内容を申告しなければならない。

- イ 自己の計算により成立させたユーロ円3ヵ月金利先物オプション取引
翌営業日（ユーロ円先物遠隔地取引参加者にあつては翌々営業日）の午前10時まで
- ロ 顧客の委託に基づくユーロ円3ヵ月金利先物オプション取引
3営業日後の午前10時まで

(3) 転売又は買戻しの申告内容の訂正ができないもの

前号の規定にかかわらず、次のイ及びロに掲げる申告内容の訂正を行うことはできないものとする。

- イ 取引最終日を迎えた限月取引に係る申告内容の訂正
- ロ 当該取引参加者が転売又は買戻しの申告を行った後に当該取引参加者が割当を受けた売建玉（当該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の清算受託売建玉。以下本条において同じ。）又は権利行使を行った買建玉（当該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の清算受託買建玉。以下本条において同じ。）について、当該売建玉又は買建玉を転売若しくは買戻し又は転売若しくは買戻しの対象となる売建玉若しくは買建玉とする申告内容の訂正

(4) 申告内容の訂正結果の確認

第2号に規定する訂正の申告を行った取引参加者は、本取引所が実行した当該申告内容の訂正結果を直ちに確認するものとする。

（平成17年7月1日、平成19年9月30日、平成21年6月1日、平成29年7月24日 変更）

（権利行使の申告時限等）

第31条 方法書第85条第1項に規定する権利行使の申告は、権利行使日の前営業日の午後5時以降の本取引所が通知を行ったときから当該権利行使日の午後5時までに行うものとする。ただし、権利行使期間満了の日を迎えた銘柄については、当該権利行使期間満了の日の午後2時45分までに行うものとする。

2 方法書第86条第1項に規定する権利行使を行わない旨の申告は、権利行使期間満了の日の日中取引時間帯終了時から午後2時45分までに行うものとする。

（平成29年7月24日 変更）

（割当の方法）

第32条 方法書第87条第1項に規定する割当は、各取引参加者（当該取引参加者が非清算参加者である場合には、その指定清算参加者）の有する権利行使の対象となる売建玉を最小取引単位に細分化して行うものとする。

（権利行使に伴う建玉の消滅時限）

第33条 方法書第88条各項に規定する権利行使又は割当に係る数量を本取引所が取引参加者

の建玉から減じる時刻は、権利行使日又は本取引所が割当を行った日の午後 5 時とする。ただし、権利行使期間満了の日においては、当該権利行使期間満了の日の午後 2 時 45 分（権利行使に伴うユーロ円 3 ヶ月金利先物の成立時限）とする。

（平成 29 年 7 月 24 日 変更）

（権利行使に伴うユーロ円 3 ヶ月金利先物の成立時限）

第 34 条 方法書第 89 条各項に規定する権利行使又は割当に伴う権利行使対象先物限月取引の成立の時刻は、権利行使日又は本取引所が割当を行った日の午後 5 時とする。ただし、権利行使期間満了の日においては、当該権利行使期間満了の日の午後 2 時 45 分とする。

（平成 29 年 7 月 24 日 変更）

（清算値段の決定方法）

第 35 条 方法書第 90 条第 2 項に規定する清算値段の算出は、別表第 3「オプション理論価格算出式」に定める方法による。ただし、算出された清算値段を適当でないと本取引所が認める場合は、本取引所が都度定める数値を清算値段とする。

（為替清算価格の決定方法等）

第 35 条の 2 方法書第 90 条の 2 第 2 項に規定する算出基準時間帯は、当該取引日の付合せ時間帯の終了時に近接する時間帯で、本取引所がその都度必要と認める時間帯とする。

2 方法書第 90 条の 2 第 3 項に規定する算出基準時間帯に約定価格がない場合における為替清算価格の算出に関して、本取引所は当該付合せ時間帯終了時点における呼び値の価格等を勘案し、適正と認める為替清算価格を決定するものとする。

（平成 17 年 7 月 1 日 追加）

（スワップポイントの算出方法）

第 35 条の 3 方法書第 90 条の 6 に規定するスワップポイントの算出方法は、次のとおりとする。

- （1）一種類の取引所為替証拠金取引に関してすべてのマーケットメイカーの有する MM 売建玉（為替特例第 26 条第 1 項に規定する MM 売建玉をいう。以下同じ。）の数量の合計と MM 買建玉（為替特例第 26 条第 1 項に規定する MM 買建玉をいう。以下同じ。）の数量の合計を比較しどちらかの数量が多い場合は、多い方の建玉に関して各マーケットメイカーが本取引所に提示したスワップポイント参考値（為替特例第 11 条第 4 項に規定するスワップポイント参考値をいう。以下同じ。）について、次の表の左欄に掲げるスワップポイント参考値の数により、同表右欄に掲げる値をスワップポイントとする。

提示されたスワップポイント参考値の数	スワップポイントの値
--------------------	------------

3 以下	提示されたスワップポイント参考値の平均値
4 又は 5	提示されたスワップポイント参考値のうち最大のもの及び最小のものを除いた残りの数値の平均値
6 以上	提示されたスワップポイント参考値のうち最大のもの及び2番目に大きいもの並びに最小のもの及び2番目に小さいものを除いた残りの数値の平均値

- (2) 前号に規定するMM 売建玉の数量の合計とMM 買建玉の数量の合計が等しい場合には、各マーケットメイカーが本取引所に提示した売建玉に関するスワップポイント参考値と買建玉に関するスワップポイント参考値について、次の表の左欄に掲げるスワップポイント参考値の数により、同表右欄に掲げる値をスワップポイントとする。

提示されたスワップポイント参考値の数	スワップポイントの値
6	提示されたスワップポイント参考値のうち最大のもの及び2番目に大きいもの並びに最小のもの及び2番目に小さいものを除いた残りの数値の平均値
7 から 11 まで	提示されたスワップポイント参考値のうち 1 番目から 3 番目までに大きいもの及び1番目から 3 番目までに小さいものを除いた残りの数値の平均値
12 以上	提示されたスワップポイント参考値のうち 1 番目から 4 番目までに大きいもの及び1番目から 4 番目までに小さいものを除いた残りの数値の平均値

- 2 前項の規定にかかわらず、他のマーケットメイカーと比較して著しく乖離したスワップポイント参考値を提示したマーケットメイカーが存在すると本取引所が認めたときには、本取引所は当該スワップポイント参考値を前項に定めるスワップポイント算出の基礎から除外することができる。
- 3 第1項に規定するスワップポイントの算出により、スワップポイントに小数点以下の端数が生じた場合は、小数点以下第1位において四捨五入したものをスワップポイントとする。
- 4 本取引所が前3項に規定する方法により算出したスワップポイントが適正でない判断したとき、又は提示されたスワップポイント参考値の数が第1項第2号の表に掲げるスワップポイント参考値の数の満たないときは、本取引所は市場実勢等を勘案し、適正と認めるスワップポイントを決定するものとする。

(平成 17 年 7 月 1 日 追加、平成 20 年 10 月 27 日、平成 22 年 4 月 1 日、平成 23 年 8 月 1 日、平成 25 年 10 月 28 日 変更)

(取引所為替証拠金取引に係る転売・買戻しの例外)

第 35 条の 4 方法書第 90 条の 9 第 3 項に規定する本取引所が別に定める場合は、同一の証拠金清算参加者が取引所為替証拠金取引に係る自己取引について複数の勘定を設けてこれらに個

別に為替取引証拠金を預託し、売建玉を有する勘定と異なる勘定を用いた買付取引を行う場合又は買建玉を有する勘定と異なる勘定を用いた売付取引を行う場合とする。

- 2 方法書第 90 条の 9 の 2 第 3 項に規定する本取引所が別に定める場合は、同一の為替証拠金非清算参加者が取引所為替証拠金取引に係る自己取引について複数の勘定を設けてこれらに個別に為替取引証拠金を預託し、売建玉を有する勘定と異なる勘定を用いた買付取引を行う場合又は買建玉を有する勘定と異なる勘定を用いた売付取引を行う場合とする。

(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)

(クロスカレンシー取引の損益に係る端数の処理)

第 35 条の 5 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。以下この条及び次条において同じ。)における損益の算出においては、一種類のクロスカレンシー取引について、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。次条において同じ。)を単位として各種の損益をそれぞれ算出して日本円に換算する時に 1 円未満の端数が生じた場合は、これを四捨五入したものを日本円における各種の損益とする。

(平成 20 年 10 月 27 日 追加)

(クロスカレンシー取引に係る手続)

第 35 条の 6 本取引所は、クロスカレンシー取引について、証拠金清算参加者の自己取引及びその顧客ごとに、計算通貨を単位とする正の為替差金が生じる場合は、その為替差金を証拠金清算参加者から受け取り、その為替差金を当該計算通貨に係る対円取引の為替清算価格により日本円に換算した額を証拠金清算参加者に支払う。

- 2 本取引所は、クロスカレンシー取引について、証拠金清算参加者の自己取引及びその顧客ごとに、計算通貨を単位とする負の為替差金が生じる場合は、その為替差金を証拠金清算参加者に支払い、その為替差金を当該計算通貨に係る対円取引の為替清算価格により日本円に換算した額を証拠金清算参加者から受け取る。
- 3 本取引所は、第 1 項に規定する手続を行うときは、証拠金清算参加者から受け取った額と同額を特定マーケットメイカーである証拠金清算参加者に支払い、証拠金清算参加者に支払った額と同額を特定マーケットメイカーである証拠金清算参加者から受け取る。
- 4 本取引所は、第 2 項に規定する手続を行うときは、証拠金清算参加者に支払った額と同額を特定マーケットメイカーである証拠金清算参加者から受け取り、証拠金清算参加者から受け取った額と同額を特定マーケットメイカーである証拠金清算参加者に支払う。
- 5 本取引所が特に必要と認めるときは、特定マーケットメイカーである証拠金清算参加者に対し、本取引所が指定するクロスカレンシー取引について、前 2 項に規定する手続を適用しない。

(平成 20 年 10 月 27 日 追加、平成 27 年 11 月 30 日、平成 29 年 2 月 27 日 変更)

(株価指数清算価格の決定方法等)

- 第 36 条 方法書第 90 条の 12 第 2 項に規定する本取引所が別に定める時間帯は、当該取引日の付合せ時間帯の終了時に近接する時間帯で、本取引所がその都度必要と認める時間帯とする。
- 2 方法書第 90 条の 12 第 3 項に規定する本取引所が別に定める時間帯に約定価格がない場合における株価指数清算価格の算出に関して、本取引所は当該付合せ時間帯終了時点における呼び値の価格等を勘案し、適正と認める株価指数清算価格を決定するものとする。

(平成 22 年 10 月 1 日 追加)

(金利相当額の決定方法)

- 第 37 条 方法書第 90 条の 16 第 1 項に規定する本取引所が別に定める算出方法は、取引所株価指数証拠金取引の種類ごとに、一取引日の終了時において次の算式により算出する方法とする。

$$I = S \times 100 \times (\text{利率}) \times (d / 365)$$

I : 取引所株価指数証拠金取引に係る建玉 1 枚当たりのロールオーバーにより発生する金利相当額

S : 当該ロールオーバーがなされた付合せ時間帯終了時の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株価指数清算価格

d : ロールオーバーにより繰り延べられた決済期日の日数

(注) I の数値において、1 円未満の端数が生じた場合は、これを切り捨てる。

- 2 前項の利率は、取引所株価指数証拠金取引の種類ごとに、以下の各号に掲げる利率とする。
- (1) 日経 225 証拠金取引 取引日の終了時における、日本銀行金融政策決定会合により決定された無担保コール翌日物誘導目標。ただし、この場合において、無担保コール翌日物誘導目標が一定の数値の幅をもって決定されているときは、その最小の数値と最大の数値の平均値を第 1 項の利率とする。
- (2) FTSE100 証拠金取引、DAX®証拠金取引及び NY ダウ証拠金取引 前項に規定する取引日が属する週（以下「適用週」という。）の前の週における各取引日について、次の算式により算出する利率の平均値を第 1 項の利率とし、当該平均値を適用週の各取引日における利率とする。ただし、本取引所が当該利率が適正でない判断したときは、本取引所が適正と認める利率とする。

$$\text{利率} = \{(F + D - S) \div (d / 360)\} / S$$

F : その対象とする金融指標を原資産とする先物取引 (FTSE100 証拠金取引にあつては連合王国、DAX®証拠金取引にあつてはドイツ連邦共和国、NY ダウ証拠金取引にあつてはアメリカ合衆国にそれぞれ所在する外国金融商品市場に上場される先物取引をいう。) の本取引所が定める時点における価格

D : その対象とする金融指標である株価指数に係る d の期間における配当落ちの指数

換算値。ただし、DAX®証拠金取引にあっては零とする。

S：その対象とする金融指標である株価指数の本取引所が定める時点における価格

d：当該先物取引の取引最終日までの日数

- 3 本取引所が前 2 項に規定する方法により算出した金利相当額が適正でないと判断したときは、本取引所が適正と認める金利相当額を決定するものとする。

(平成 22 年 10 月 1 日 追加、平成 22 年 11 月 1 日、平成 29 年 12 月 18 日 変更)

(配当相当額の算出方法)

第 38 条 方法書第 90 条の 17 第 1 項の規定により日経 225 証拠金取引について本取引所が別に定める配当相当額の算出方法は、次の算式により算出する方法とする。

$$B_D = \{(D_1 \times 50 / M_1) + (D_2 \times 50 / M_2) + \dots + (D_N \times 50 / M_N)\} / V \times 100$$

B_D：日経 225 証拠金取引に係る建玉 1 枚当たりの配当相当額

D₁：配当金の支払いが見込まれる N 種類の銘柄のうち、1 番目の銘柄について予想される配当金の額

M₁：配当金の支払いが見込まれる N 種類の銘柄のうち、1 番目の銘柄のみなし額面

D₂：配当金の支払いが見込まれる N 種類の銘柄のうち、2 番目の銘柄について予想される配当金の額

M₂：配当金の支払いが見込まれる N 種類の銘柄のうち、2 番目の銘柄のみなし額面

D_N：配当金の支払いが見込まれる N 種類の銘柄のうち、N 番目の銘柄について予想される配当金の額

M_N：配当金の支払いが見込まれる N 種類の銘柄のうち、N 番目の銘柄のみなし額面

V：株式会社日本経済新聞社が日経平均株価の算出において定める除数

(注) B_Dの数値において、1 円未満の端数が生じた場合には小数点以下第 1 位を四捨五入する。

- 2 前項の「みなし額面」とは、2001 年 10 月施行の商法改正で廃止された株式の額面制度が現在まで引き継がれたと想定した場合に、現在の額面として見なされる値として株式会社日本経済新聞社が銘柄ごとに定める数値をいう。

- 3 方法書第 90 条の 17 第 1 項の規定により FTSE100 証拠金取引について本取引所が定める配当相当額の算出方法は、取引所株価指数証拠金取引の種類ごとに、次の算式により算出する方法とする。

$$B_D = C \times 100$$

B_D：FTSE100 証拠金取引に係る建玉 1 枚当たりの配当相当額

C：配当金の支払いによって変動する株価指数を調整するものとして FTSE International Limited が算出する数値

(注) B_Dの数値において、1 円未満の端数が生じた場合には小数点以下第 1 位を四捨五入する。

- 4 方法書第 90 条の 17 第 1 項の規定により NY ダウ証拠金取引について本取引所が別に定める

配当相当額の算出方法は、次の算式により算出する方法とする。

$$B_D = (D_1 + D_2 + \dots + D_N) / V \times 100$$

B_D : NY ダウ証拠金取引に係る建玉 1 枚当たりの配当相当額

D_1 : 配当金の支払いが見込まれる N 種類の銘柄のうち、1 番目の銘柄について予想される配当金の額

D_2 : 配当金の支払いが見込まれる N 種類の銘柄のうち、2 番目の銘柄について予想される配当金の額

D_N : 配当金の支払いが見込まれる N 種類の銘柄のうち、N 番目の銘柄について予想される配当金の額

V : S&P Dow Jones Indices LLC がダウ・ジョーンズ工業株価平均の算出において定める除数

(注) B_D の数値において、1 円未満の端数が生じた場合には小数点以下第 1 位を四捨五入する。

- 5 本取引所は、第 1 項、第 3 項又は前項の規定に基づいて配当相当額を算出した後、当該配当相当額を算出した取引所株価指数証拠金取引の対象である株価指数を構成する銘柄の権利付最終日後に予定される配当金の額に変更があっても、配当相当額の数値を変更しない。
- 6 前項の権利付最終日とは、配当を受け取る権利を確定させる最終売買日をいう。
- 7 本取引所は、第 1 項、第 3 項及び第 4 項に規定する方法により算出した配当相当額が適正でないと判断した場合その他必要があると認める場合は、本取引所が適正と認める額を配当相当額とする。

(平成 22 年 10 月 1 日 追加、平成 22 年 11 月 1 日、平成 22 年 11 月 22 日、平成 26 年 9 月 20 日、平成 28 年 6 月 27 日 変更)

(取引所株価指数証拠金取引に係る転売・買戻しの例外)

- 第 39 条 方法書第 90 条の 20 第 3 項に規定する本取引所が別に定める場合は、同一の証拠金清算参加者が取引所株価指数証拠金取引に係る自己取引について複数の勘定を設けてこれらに個別に株価指数取引証拠金を預託し、売建玉を有する勘定と異なる勘定を用いた買付取引を行う場合又は買建玉を有する勘定と異なる勘定を用いた売付取引を行う場合とする。
- 2 方法書第 90 条の 21 第 3 項に規定する本取引所が別に定める場合は、同一の株価指数証拠金非清算参加者が取引所株価指数証拠金取引に係る自己取引について複数の勘定を設けてこれらに個別に株価指数取引証拠金を預託し、売建玉を有する勘定と異なる勘定を用いた買付取引を行う場合又は買建玉を有する勘定と異なる勘定を用いた売付取引を行う場合とする。

(平成 22 年 10 月 1 日 追加)

(建玉移管申告の時限)

- 第 40 条 方法書第 97 条の規定により、方法書第 94 条に定める建玉移管申告の時限は、移管時

刻が属する営業日の前営業日の午後 5 時以降の本取引所が通知を行ったときから当該営業日の午前 10 時までとする。

(平成 22 年 10 月 1 日 変更)

(審問に関する手続き)

第 41 条 方法書第 14 条の 8、第 15 条の 2、第 15 条の 2 の 2、第 15 条の 2 の 3 及び第 15 条の 3 の審問の手続きは、次の各号に定めるところによる。

- (1) 本取引所は、あらかじめ審問の事項及び期日とその対象とする清算参加者に対して通知するものとする。
- (2) 当該清算参加者は、審問の際に陳述を行うことができるものとし、本取引所は、審問の事項、陳述内容その他の事項について記録を作成するものとする。

(平成 27 年 11 月 2 日 追加)

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

この改正規定は、平成 19 年 12 月 3 日から施行する。

附則

- 1 この改正規定は、平成 20 年 4 月 28 日から施行する。
- 2 第 7 条第 1 項の規定にかかわらず、清算参加者又は親会社等が外国の法令に準拠して設立されたものであり、かつ、その事業年度が平成 19 年 12 月 31 日に終了したときは、当該事業年度に係る財務報告を平成 20 年 5 月 30 日までに行うものとする。

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

- 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為替証拠金清算参加者である者が預託する為替証拠金清算預託金の額の算出に関する為替証拠金清算預託金所要額の算出については、改正後の第 12 条の 2 第 2 項の規定にかかわらず、平成 20 年 5 月 31 日を算出基準日として改正後の同条第 1 項の規定を適用する。

附則

この改正規定は、平成 20 年 10 月 27 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 7 月 3 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 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 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 25 年 10 月 28 日から施行する。

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

- 1 この変更規則は、平成 27 年 7 月 3 日から施行する。
- 2 第 12 条の 3 の 2 第 1 項第 1 号の規定にかかわらず、平成 27 年度にあつては為替証拠金清算参加者があらかじめ預託すべき第二為替証拠金清算預託金の総額は想定損失額に零を乗じた額とし、本取引所は、平成 32 年度中までに為替証拠金清算参加者があらかじめ預託すべき第二為替証拠金清算預託金の総額を想定損失額に 0.4 を乗じた額に変更を行うものとする。
- 3 第 12 条の 4 の 2 第 1 項第 1 号の規定にかかわらず、平成 27 年度にあつては株価指数証拠金清算参加者があらかじめ預託すべき第二株価指数証拠金清算預託金の総額は想定損失額に零を乗じた額とし、本取引所は、平成 32 年度中までに株価指数証拠金清算参加者があらかじめ預託すべき第二株価指数証拠金清算預託金の総額を想定損失額に 0.4 を乗じた額に変更を行

うものとする。

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 28 年 6 月 27 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 この変更規則の施行後、金利先物等清算参加者が平成 29 年 3 月 1 日までに預託すべき金利先物等清算預託金の額の算出については、平成 29 年 2 月 21 日を第一算出基準日とする。
- 3 この変更規則の施行後、証拠金清算参加者が最初に預託すべき証拠金取引清算預託金の額の算出については、変更後の第 12 条の 3 第 1 項第 1 号の規定にかかわらず、平成 29 年 2 月 17 日を第一算出基準日とする。
- 4 この変更規則の施行をもって、平成 27 年 7 月 3 日付附則第 2 項の第二為替証拠金清算預託金に係る規定及び同第 3 項の第二株価指数証拠金清算預託金に係る規定の適用は行わないものとする。

附則

この変更規則は、平成 29 年 7 月 24 日から施行する。

附則

この変更規則は、平成 29 年 12 月 18 日から施行する。

附則

この変更規則は、平成 30 年 1 月 22 日から施行する。

別表第1 現在価値の算出式

$$\text{現在価値} = 3 \times \sum_{i=1}^{2m} A_i d_i + 100 \times d_{2m}$$

- 1 算出式中の m は、円金利スワップ標準物の種類ごとに、次に定めるところによる。
 - (1) 2年円金利スワップ標準物については、2とする。
 - (2) 5年円金利スワップ標準物については、5とする。
 - (3) 7年円金利スワップ標準物については、7とする。
 - (4) 10年円金利スワップ標準物については、10とする。

- 2 算出式中の A_i は、 $i-1$ 回目の利息交換日（ i が1のときは円金利スワップ標準物の開始日とする。）から i 回目の利息交換日までの実日数（片端計算とする。）を365で除した値（以下「**年利調整係数**」という。）を示す。

- 3 算出式中の d_i は、 i 回目の利息交換日における割引係数を示し、次に定める式により算出する。
 - (1) 1回目の利息交換日における割引係数

$$d_1 = 1 \div (1 + A_1 C_1) \quad (\text{小数点以下第8位未満を四捨五入する。})$$
 イ A_1 は、1回目の利息交換日における**年利調整係数**を示す。
 ロ C_1 は、円金利スワップ標準物の開始日から1回目の利息交換日までの期間のスワップ・レートを示す。

 - (2) 2回目以降の利息交換日における割引係数

$$d_i = (1 - C_i \sum_{j=1}^{i-1} A_j d_j) \div (1 + A_i C_i) \quad (\text{小数点以下第8位未満を四捨五入する。})$$
 イ A_i は、 i 回目の利息交換日における**年利調整係数**を示す。
 ロ C_i は、円金利スワップ標準物の開始日から i 回目の利息交換日までの期間のスワップ・レートを示す。
 ハ A_j は、1回目から $i-1$ 回目まで（ i が2のときは1回目のみとする。）の各利息交換日における**年利調整係数**を示す。
 ニ d_j は、1回目から $i-1$ 回目まで（ i が2のときは1回目のみとする。）の各利息交換日における**割引係数**を示す。

- 4 算出式中の d_{2m} は、最終回目の利息交換日（満期日）における割引係数を示し、前掲3(2)に定める式により算出する。

(注) 利息交換日は開始日から起算し半年ごとに到来する応答日とする。ただし、応答

日が日本の銀行休業日又は英国の銀行休業日にあたる時は、当該応答日の翌日（日本の銀行休業日又は英国の銀行休業日にあたる時は、順次繰り下げる。）を利息交換日とし、当該応答日が日本の銀行休業日又は英国の銀行休業日かつ月末日にあたる時は、当該応答日の前日（日本の銀行休業日又は英国の銀行休業日にあたる時は、順次繰り上げる。）を利息交換日とする。

別表第2 線形補間の方法

- 1 円金利スワップ標準物の開始日から奇数回目（1回目を除く。）の利息交換日までの各期間のスワップ・レート

$C_i = (A_i C_{i+1} + A_{i+1} C_{i-1}) \div (A_i + A_{i+1})$ （小数点以下第3位未満を四捨五入する。）

- (1) A_i は、 i 回目の利息交換日における年利調整係数を示す。
- (2) A_{i+1} は、 $i+1$ 回目の利息交換日における年利調整係数を示す。
- (3) C_{i-1} は、円金利スワップ標準物の開始日から $i-1$ 回目の利息交換日までの期間のスワップ・レートを示す。
- (4) C_{i+1} は、円金利スワップ標準物の開始日から $i+1$ 回目の利息交換日までの期間のスワップ・レートを示す。

- 2 円金利スワップ標準物の開始日から1回目の利息交換日までの期間のスワップ・レート

$C_1 = C_2 - (C_3 - C_2) \times A_2 \div A_3$ （小数点以下第3位未満を四捨五入する。）

- (1) A_2 は、2回目の利息交換日における年利調整係数を示す。
- (2) A_3 は、3回目の利息交換日における年利調整係数を示す。
- (3) C_2 は、円金利スワップ標準物の開始日から2回目の利息交換日までの期間のスワップ・レートを示す。
- (4) C_3 は、円金利スワップ標準物の開始日から3回目の利息交換日までの期間のスワップ・レートを示す。

別表第3 オプション理論価格算出式

コールオプションの理論価格（以下「C」とする。）及びプットオプションの理論価格（以下「P」とする。）は、次に定める方法による算出するものとする。

$$C = e^{-rt} [FN(d) - KN(d - \sigma\sqrt{t})]$$

$$P = C - e^{-rt}(F - K)$$

なお、dは次の式により計算するものとする。

$$d = [\ln(F/K) + \sigma^2 t/2] / \sigma\sqrt{t}$$

(注) 当該算出式における各記号の意味は次のとおりとする。

- F : ユーロ円3ヵ月金利先物の清算価格
- e : 自然対数の底
- t : 権利行使日までの日数/365
- K : 行使価格
- σ : 銘柄ごとに本取引所が定めるところにより算出するインプライド・ボラティリティを100で除した値
- r : 全銀協TIBOR運営機関が当該日に公表する期間3ヵ月のユーロ円TIBORを100で除したのち、小数点以下第3位を四捨五入した値
- N(x) : 値がxのときの標準正規分布の累積密度
- In : 自然対数