

取引所株価指数証拠金取引に関する業務規程の特例の施行規則

(目的)

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

(呼び値の取消しの受付時間)

第2条 株価指数特例第5条第7項に規定する呼び値の取消しは、プレオープン時間帯の開始時から付合せ時間帯の終了時までの間に受け付けることができる。

2 本取引所は、必要があると認めるときは、呼び値の取消しを、前項に規定する受付時間のほか、本取引所がその都度定める時間に受け付けることができるものとする。

(2020年10月26日 変更)

(呼び値に関する事項)

第3条 株価指数特例第23条第9項に規定する本取引所が別に定める事項は、次の各号に定める事項とする。

(1) マーケットメイク呼び値及び非マーケットメイク呼び値の処理

マーケットメイク呼び値及び非マーケットメイク呼び値は、次に定めるところにより、為替株価指数取引・清算システムにおいて処理するものとする。この場合において、当該マーケットメイク呼び値及び非マーケットメイク呼び値は、それぞれ対当する非マーケットメイク呼び値及びマーケットメイク呼び値に係る数量を限度として処理するものとする。

イ マーケットメイク売呼び値が行われているときにおける当該価格より高い価格の非マーケットメイク買呼び値は、当該非マーケットメイク買呼び値の限度の価格まで、これまでに行われている個々の価格のマーケットメイク売呼び値に対当する非マーケットメイク呼び値として処理するものとする。

ロ マーケットメイク買呼び値が行われているときにおける当該価格より低い価格の非マーケットメイク売呼び値は、当該非マーケットメイク売呼び値の限度の価格まで、これまでに行われている個々の価格のマーケットメイク買呼び値に対当する非マーケットメイク呼び値として処理するものとする。

ハ 非マーケットメイク売呼び値が行われているときにおける当該価格より高い価格のマーケットメイク買呼び値は、当該マーケットメイク買呼び値の限度の価格まで、これまでに行われている個々の価格の非マーケットメイク売呼び値に対当するマーケットメイク呼び値として処理するものとする。

- ニ 非マーケットメイク買呼び値が行われているときにおける当該価格より低い価格のマーケットメイク売呼び値は、当該マーケットメイク売呼び値の限度の価格まで、これまでに行われている個々の価格の非マーケットメイク買呼び値に相当するマーケットメイク呼び値として処理するものとする。
- (2) IC 条件（呼び値を行うと同時に全く約定しないときは呼び値が直ちに効力を失い、呼び値を行うと同時に呼び値に係る数量の一部が約定しないときはこれに係る呼び値が直ちに効力を失うとする条件をいう。以下同じ。）は、指値呼び値に付することができる。ただし、プレオープン時間帯に受け付ける指値呼び値には付することができない。
- (3) OCO 条件（組み合わせた呼び値の一方の呼び値に係る数量の一部が約定するときは他方の呼び値に係る数量から約定に係る数量を減じるとする条件をいう。）は、次に掲げる呼び値の組み合わせにおけるそれぞれの呼び値に付することができる。
 - イ 同一数量の指値呼び値による売呼び値及びトリガー成行売呼び値の組み合わせ
 - ロ 同一数量の指値呼び値による買呼び値及びトリガー成行買呼び値の組み合わせ
- (4) 呼び値の効力

為替株価指数取引・清算システムに入力された後に付合せがなされない呼び値については、次に掲げる場合のほか、呼び値に付された期限まで効力を有する。ただし、規程第 14 条の規定により取引所株価指数証拠金取引の停止が行われたときの呼び値の効力については、本取引所がその都度定めることができる。

- イ マーケットメイク呼び値については、当該マーケットメイク呼び値が為替株価指数取引・清算システムに入力された取引日の付合せ時間帯の終了時に効力を失うものとする。
- ロ IC 成行呼び値及び IC 条件が付された呼び値については、為替株価指数取引・清算システムに入力された時点において、対当するマーケットメイク呼び値が存在しない場合は、約定がないものとして、直ちに効力を失うものとする。
- ハ ロスカット呼び値については、為替株価指数取引・清算システムに入力された取引日の付合せ時間帯の終了時に効力を失うものとする。
- ニ 呼び値に付された期限が株価指数特例第 6 条第 1 項及び第 2 項に規定する休業日又は同条第 3 項に規定する臨時休業日を含む場合は、呼び値を行った時から最初に到来する休業日又は臨時休業日の、直前の取引日の付合せ時間帯終了時に効力を失う。

（呼び値の制限値幅）

第 4 条 株価指数特例第 23 条第 5 項に規定する値幅の限度（以下「制限値幅」という。）については、日経 225 リセット付証拠金取引及び NY ダウリセット付証拠金取引について、前取引日の株価指数清算価格の区分に従って次のとおり定める。

- (1) 日経 225 リセット付証拠金取引

前取引日の株価指数清算価格	制限値幅の範囲
7,500 円未満	上下 1,000 円
7,500 円以上 10,000 円未満	上下 1,500 円
10,000 円以上 12,500 円未満	上下 2,000 円

12,500 円以上 17,500 円未満	上下 3,000 円
17,500 円以上 22,500 円未満	上下 4,000 円
22,500 円以上 27,500 円未満	上下 5,000 円
27,500 円以上 32,500 円未満	上下 6,000 円
32,500 円以上 37,500 円未満	上下 7,000 円
37,500 円以上 42,500 円未満	上下 8,000 円
42,500 円以上	上下 9,000 円

(2) NY ダウリセット付証拠金取引

前取引日の株価指数清算価格	制限値幅の範囲
7,500 ポイント未満	上下 1,000 ポイント
7,500 ポイント以上 10,000 ポイント未満	上下 1,500 ポイント
10,000 ポイント以上 12,500 ポイント未満	上下 2,000 ポイント
12,500 ポイント以上 17,500 ポイント未満	上下 3,000 ポイント
17,500 ポイント以上 22,500 ポイント未満	上下 4,000 ポイント
22,500 ポイント以上 27,500 ポイント未満	上下 5,000 ポイント
27,500 ポイント以上 32,500 ポイント未満	上下 6,000 ポイント
32,500 ポイント以上 37,500 ポイント未満	上下 7,000 ポイント
37,500 ポイント以上 42,500 ポイント未満	上下 8,000 ポイント
42,500 ポイント以上	上下 9,000 ポイント

(平成 23 年 12 月 1 日、平成 26 年 9 月 20 日、平成 30 年 1 月 29 日、2020 年 10 月 26 日、2021 年 4 月 12 日 変更)

(非マーケットメイク呼び値に係る数量制限)

第 5 条 株価指数特例第 23 条第 6 項に規定する非マーケットメイク呼び値に係る数量の限度は、500 枚以内とする。ただし、NY ダウリセット付証拠金取引にあっては、2,000 枚以内とする。

2 本取引所は、前項に規定する制限を超える数量による非マーケットメイク呼び値の受付を拒絶する。

(2020 年 10 月 26 日 変更)

(呼び値に係る入力内容の訂正)

第 6 条 株価指数特例第 26 条第 3 項に規定する入力内容の訂正は、以下の方法により行うものとする。

(1) 呼び値の訂正は、株価指数証拠金取引参加者等が当該呼び値の取消しを行ったうえ、新たに正しい呼び値により株価指数特例第 23 条第 2 項に定める入力をなす方法

(2) 呼び値に係る数量の訂正

イ 数量削減の場合 削減する数量分について、呼び値の取消しを行う方法

- ロ 数量追加の場合 当該呼び値に係る数量すべての取消しを行ったうえ、新たに正しい数量により株価指数特例第 23 条第 2 項に定める入力方法をなす方法
- 2 前項第 2 号イの規定にかかわらず、同一時点に入力されたトリガー呼び値に係る数量のうち一部の数量が約定した場合における残数量の訂正については、当該トリガー呼び値に係る残数量すべての取消しを行ったうえ、新たに正しい数量により株価指数特例第 23 条第 2 項に定める入力方法をなす方法により行うものとする。

(過誤訂正等のための市場デリバティブ取引の承認申請)

第 7 条 規程第 19 条の規定により、取引所株価指数証拠金取引の過誤訂正に係る本取引所の承認を受けようとする株価指数証拠金取引参加者等は、過誤等が発生した取引日の付合せ時間帯の終了時まで所定の申請書を本取引所に提出するものとする。

第 7 条の 2 (削除)

(平成 23 年 12 月 1 日 追加、平成 26 年 9 月 20 日、平成 28 年 6 月 27 日、2021 年 4 月 12 日 変更)

第 7 条の 3 (削除)

(平成 23 年 12 月 1 日 追加、2021 年 4 月 12 日 変更)

(ブロック取引の申込みに関する事項)

第 7 条の 4 株価指数特例第 28 条の 4 第 2 項の規定により、ブロック取引の申込みに関し、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) 申込方法

株価指数証拠金取引参加者等は、参加者端末装置を通じて、次に掲げる内容を為替株価指数取引・清算システムに入力することによってブロック取引の申込みを行うものとする。

- イ 申込取引参加者
- ロ 取引所株価指数証拠金取引の銘柄
- ハ 価格
- ニ 呼び値に係る数量
- ホ 売付取引及び買付取引の自己又は委託の別
- ヘ 相手方取引参加者（他の株価指数証拠金取引参加者等との間でブロック取引を成立させる場合）
- ト 売付取引及び買付取引に係る株価指数証拠金取引参加者等の口座番号

(2) 価格の制限

前号ハの価格は、申込時点における本取引所の取引状況を勘案した適正かつ合理的な価格

とする。

(3) 最低数量

ブロック取引により成立する取引所株価指数証拠金取引の数量は、取引所株価指数証拠金取引の種類ごとに次の表に定めるものとする。

取引所株価指数証拠金取引の種類	数量
日経 225 リセット付証拠金取引	取引単位の 500 倍以上の数量
FTSE100 リセット付証拠金取引	取引単位の 200 倍以上の数量
DAX [®] リセット付証拠金取引	取引単位の 200 倍以上の数量
NY ダウリセット付証拠金取引	取引単位の 2,000 倍以上の数量
金 ETF リセット付証拠金取引	取引単位の 200 倍以上の数量
原油 ETF リセット付証拠金取引	取引単位の 200 倍以上の数量

(4) 承認の条件

本取引所は、株価指数証拠金取引参加者等からの申込みに係る内容が次に定める事項を満たしていることを確認したときは、当該申込内容に基づく取引所株価指数証拠金取引が成立することを認めるものとする。

- イ 第 1 号に定める申込内容が明らかにされていること。
- ロ 第 1 号ハの価格が第 2 号に定める価格であること。
- ハ 最低数量についての前号の規定を満たすこと。
- ニ その他、当該申込みに基づく取引所株価指数証拠金取引を成立させることが明らかに不適切でないこと。

(5) 承認及び不承認の通知

本取引所は、前号の規定により取引所株価指数証拠金取引が成立することを認めるときは承認の旨を、取引所株価指数証拠金取引が成立することを認めないときは不承認の旨を、申込取引参加者に通知する。ただし、本取引所が当該申込みのなされた取引日の終了時までいずれの通知もなさなかった場合には、不承認の通知をなしたものとする。

(2020 年 10 月 26 日 追加、2021 年 4 月 12 日 変更)

(ブロック取引に関する不承認通知の時限)

第 7 条の 5 株価指数特例第 28 条の 6 第 4 項に規定する本取引所が別に定める時限は、同条第 1 項の取引所株価指数証拠金取引の成立時から原則として 10 分以内とする。

(2020 年 10 月 26 日 追加、2021 年 4 月 12 日 変更)

(ブロック取引の停止期間)

第 7 条の 6 株価指数特例第 28 条の 8 各号に掲げる場合のブロック取引の停止は、本取引所がその都度必要と認める期間とする。

(2020年10月26日 追加)

(情報通信の技術を利用する通知内容の顧客への提供方法)

第8条 株価指数特例第32条第3項に規定する本取引所が別に定める方法は、次に掲げる方法とする。

- (1) 電子情報処理組織を使用する方法のうちイ又はロに掲げるもの
 - イ 株価指数証拠金取引参加者等の使用に係る電子計算機と株価指数証拠金取引顧客の使用に係る電子計算機とを接続する電気通信回線を通じて送信し、受信者の使用に係る電子計算機に備えられたファイルに記録する方法
 - ロ 株価指数証拠金取引参加者等の使用に係る電子計算機に備えられたファイルに記録された株価指数特例第32条第2項の規定による通知書に記載すべき事項を電気通信回線を通じて株価指数証拠金取引顧客の閲覧に供し、当該顧客の使用に係る電子計算機に備えられたファイルに当該事項を記録する方法
 - (2) 磁気ディスク、シー・ディー・ロムその他これらに準ずる方法により一定の事項を確実に記録しておくことができる物をもって調製するファイルに株価指数特例第32条第2項の規定による通知書に記載すべき事項を記録したものを送付する方法
- 2 前項各号に掲げる方法は、株価指数証拠金取引顧客がファイルへの記録を出力することによる書面を作成することができるものでなければならない。
- 3 第1項第1号の「電子情報処理組織」とは、株価指数証拠金取引参加者等の使用に係る電子計算機と、株価指数証拠金取引顧客の使用に係る電子計算機とを電気通信回線で接続した電子情報処理組織をいう。

(顧客の委託に基づく取引所株価指数証拠金取引についての記録等)

- 第9条 株価指数特例第33条に規定する本取引所が別に定める記録等は、参加者端末装置から取得する取引注文及び取引結果に係る記録とする。
- 2 前項の記録は、別表に定める事項を記録したものとす。
 - 3 株価指数証拠金取引参加者等は、第1項に定める記録について、出力することにより、又はマイクロフィルム、フロッピーディスクその他の電子媒体により保存することができる。
 - 4 第1項に定める記録の保存期間は5年とする。

(利益相反のおそれのある取引の防止体制)

第10条 株価指数特例第13条第1項に規定する本取引所が別に定める適切な体制は、次に掲げる体制とする。

- (1) マーケットメイク業務を行う部署と受託業務を行う部署が分離されている体制
- (2) マーケットメイク業務に係る責任者及び担当者と受託業務に係る責任者及び担当者が分離されている体制
- (3) マーケットメイク業務を行う部署と受託業務を行う部署との間において、取引所株価指数証拠金取引に係る顧客情報の管理が物理的かつシステムの的に遮断されている体制

- (4) その他本取引所が必要と認める体制

(情報通信の技術を利用する通知内容の株価指数証拠金取引参加者等への提供方法)

第 11 条 株価指数特例第 34 条第 2 項に規定する本取引所が別に定める方法は、次に掲げる方法とする。

- (1) 電子情報処理組織を使用する方法のうちイ又はロに掲げるもの
- イ 本取引所の使用に係る電子計算機と株価指数証拠金取引参加者等の使用に係る電子計算機とを接続する電気通信回線を通じて送信し、受信者の使用に係る電子計算機に備えられたファイルに記録する方法
 - ロ 本取引所の使用に係る電子計算機に備えられたファイルに記録された株価指数特例の別表に定める事項を電気通信回線を通じて株価指数証拠金取引参加者等の閲覧に供し、当該株価指数証拠金取引参加者等の使用に係る電子計算機に備えられたファイルに当該事項を記録する方法
- (2) 磁気ディスク、シー・ディー・ロムその他これらに準ずる方法により一定の事項を確実に記録しておくことができる物をもって調製するファイルに株価指数特例の別表に定める事項を記録したものを送付する方法
- 2 前項第 1 号の「電子情報処理組織」とは、本取引所の使用に係る電子計算機と、株価指数証拠金取引参加者等の使用に係る電子計算機とを電気通信回線で接続した電子情報処理組織をいう。

附則

- 1 この規則は、平成 22 年 10 月 1 日から施行する。
- 2 第 4 条の規定にかかわらず、取引開始日における制限値幅については、本取引所が定める。

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 26 年 9 月 20 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

この変更規則は、平成 30 年 1 月 29 日から施行する。

附則

この変更規則は、2020 年 10 月 26 日から施行する。

附則

この変更規則は、2021 年 4 月 12 日から施行する。

別表 取引注文及び取引結果に係る記録事項（第9条関係）

記録事項

- 1 取引所株価指数証拠金取引の種類及びリセット日が属する年
- 2 売付取引又は買付取引の別
- 3 価格（IC 成行呼び値、トリガー成行呼び値又はロスカット呼び値である場合は、その旨）
- 4 トリガー呼び値である場合は、トリガー価格
- 5 呼び値に係る数量
- 6 受託日時
- 7 注文番号
- 8 顧客の委託に基づく旨
- 9 ブロック取引の場合は、その旨
- 10 呼び値に条件を付した場合は、その旨

(2020年10月26日、2021年4月12日 変更)