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40条の4の規定が適用となる場合を除き、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　方法書第41条の6の規定が適用となる場合を除き、方法書第31条第4項に規定する預託すべきFXクリアリング清算預託金の額に不足を生じた清算参加者は、第12条の5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。

4　前3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、証拠金取引清算預託金又はFXクリアリング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、2021年4月12日、2021年4月23日、2023年3月20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ときは、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ヵ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）

（金利先物等損失処理期間終了後の新たな金利先物等清算預託金所要額）

第 12 条の 2 の 2　方法書第 40 条の 4 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金利先物等清算預託金の額は、金利先物等新所要額適用日（同項に規定する「金利先物等新所要額適用日」をいう。）の 6 営業日前の営業日を金利先物等特別算出基準日として、第 12 条の 2 の規定を準用して算出する額とする。この場合において、第 12 条の 2 第 1 項中「各算出基準日」とあるのは「金利先物等特別算出基準日」と読み替えて適用する。

2　本取引所は、金利先物等特別算出基準日の翌営業日に、金利先物等清算参加者に対し、当該預託すべき金利先物等清算預託金の額を通知する。

（2023 年 3 月 20 日　追加）

（金利先物等取引に係る特別目的担保金の額）

第 12 条の 2 の 3　方法書第 40 条の 6 第 1 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特別目的担保金の額は、債務不履行金利先物等清算参加者以外の金利先物等清算参加者（以下「他の金利先物等清算参加者」という。）ごとに、次に掲げるところにより算出する。

(1)　一の金利先物等損失処理期間における各取引日において、次に掲げるところにより金利先物等変動相当額（方法書第 40 条の 5 第 2 項第 1 号に規定する金利先物等変動相当額をいう。）を算出する。

イ　前条の規定を準用し、当該各取引日を算出基準日とみなして計算上の預託すべき金利先物等清算預託金の額に相当する額（以下「計算上金利先物等清算預託金相当額」という。）を算出する。

ロ　次の a、b 及び c に掲げる日の区分に応じて、当該 a、b 及び c に定めるところにより金利先物等変動相当額の算出の基礎となる額（以下「金利先物等算出基礎額」とい

う。）を算出する。

a　金利先物等損失処理期間の開始日

当該金利先物等損失処理期間に適用される当初金利先物等清算預託金所要額（方法書第 40 条第 5 項に規定する当初金利先物等清算預託金所要額をいう。）と、当該開始日における計算上金利先物等清算預託金相当額とを比較して、いずれか大きい方の額を金利先物等算出基礎額とする。

b　開始日の翌取引日

a の金利先物等算出基礎額と、当該開始日の翌取引日における計算上金利先物等清算預託金相当額とを比較して、いずれか大きい方の額を当該翌取引日における金利先物等算出基礎額とする。

c　開始日の翌々取引日から終了日までの各取引日

前取引日における金利先物等算出基礎額と、当該各取引日における計算上金利先物等清算預託金相当額とを比較して、いずれか大きい方の額を当該各取引日における金利先物等算出基礎額とする。

ハ　当日の金利先物等算出基礎額から当初金利先物等清算預託金所要額を控除した額を、当該一の金利先物等損失処理期間の各取引日における金利先物等変動相当額とする。

(2)　一の金利先物等損失処理期間における各取引日において、次に掲げる金利先物等第一清算拠出金相当額及び金利先物等第二清算拠出金相当額を合計した金利先物等清算拠出金相当額(方法書第40条の5第2項第2号に規定する金利先物等清算拠出金相当額をいう。)を、それぞれ次に掲げるところにより算出する。

イ　金利先物等第一清算拠出金相当額

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額が、方法書第 40 条第 1 項、第 2 項及び第 3 項の規定に基づく損失補填の額を超過した場合のその超過分に相当する額について、他の金利先物等清算参加者を対象に、当該他の金利先物等清算参加者の当初金利先物等清算預託金所要額に応じて按分した額を算出する。ただし、このイの規定に基づき算出する額は、各金利先物等清算参加者の当初金利先物等清算預託金所要額を上限とする。

ロ　金利先物等第二清算拠出金相当額

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額が、方法書第 40 条第 1 項、第 2 項、第 3 項、第 4 項及び第 6 項の規定に基づく損失補填の額を超過した場合のその超過分に相当する額について、方法書第 40 条第 15 項に定める処分期間における金利先物等第二清算拠出金負担清算参加者を対象に、当該金利先物等第二清算拠出金負担清算参加者の金利先物等取引及び清算建玉に係る差金並びにユーロ円 3 ヵ月金利先物オプション又は無担保コールオーバーナイト 3 ヵ月金利先物オプションに係るオプション料及びオプション価値（他の金利先物等清算参加者が処分期間において保持する建玉について、当該処分期間におけるオプションの清算値段と建玉数量を乗算して本取引所が都度定める値をいう。）より本取引所が都度定める差金代金相当

額の受け取るべき額の総額から支払うべき額の総額を控除した額（ただし、当該額が正の場合に限る。）に応じて按分した額を算出する。

ハ　イの規定に基づき算出した額とロの規定に基づき算出した額を合算した額を、当該一の金利先物等損失処理期間の各取引日における金利先物等清算拠出金相当額とする。

（2023 年 3 月 20 日　追加）

（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ときは、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 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。

ＰＭＬ額＝ＰＭＬ基礎額の全ての合計＋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＋（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－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。

基準ＰＭＬ額＝ＰＭＬ額－｛(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±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。為替差金が正の数の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、負の数のときは減算する。)）＋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と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。）の積を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＋（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±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の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、負の数のときは減算する。)）＋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と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。）の積を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 ヵ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　前項各号において、取引所株価指数証拠金取引については、銘柄ごとに必要な計算を行うものとする。

3　前2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、2020年10月26日、2021年4月12日、2023年3月20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）

（FXクリアリング清算預託金の額）

第12条の5　方法書第31条第4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FXクリアリング清算預託金の額は、FXクリアリング清算参加者ごとに、次に掲げるところにより算出する。

(1)　一のFXクリアリング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ときは、順次繰り下げる。）の6営業日前の営業日をいう。）の各算出基準日の付合せ時間帯終了時において当該FXクリアリング清算参加者が保有するFXクリアリング取引の種類ごとの売建玉又は買建玉の数量（方法書第90条の27の規定に基づくロールオーバーにより、当該FXクリアリング清算参加者に新たに発生する売建玉又は買建玉いずれかの数量をいう。以下第8号において同じ。）×取引単位×当該FXクリアリング取

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FXクリアリング取引に係るFXクリアリング清算価格の変動率（価格変動サンプル期間の開始日が当該FXクリアリング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FXクリアリング取引の上場日までの間の、当該FXクリアリング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FXクリアリング取引に係るFXクリアリング清算価格（当該FXクリアリング取引がクロスカレンシー取引（FXクリアリング取引に関する業務規程の特例（以下「FXクリアリング特例」という。）第2条第10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FXクリアリング取引の計算通貨（FXクリアリング特例第2条12号に規定する計算通貨をいう。）に係る対円取引（FXクリアリング特例第2条第9号に規定する対円取引をいう。）のFXクリアリング清算価格を乗じる。）

(2)　一のFXクリアリング清算参加者について、次の算式によりＰＭＬ額を得る。

ＰＭＬ額＝ＰＭＬ基礎額の全ての合計＋各算出基準日における自己のFXクリアリング取引証拠金の不足額

(3)　一のFXクリアリング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のFXクリアリング取引証拠金預託額±FXクリアリング差金（業務方法書第90条の29第1項に規定するFXクリアリング差金をいう。FXクリアリング差金が正の数のときは当該正の数を当該FXクリアリング取引証拠金預託額に加算し、負の数のときは減算する。）｝

(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FXクリアリング清算参加者及び本取引所が定める時点における純資産額が最少のFXクリアリング清算参加者の基準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ヵ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、FXクリアリング違約損失積立金を控除して、預託すべきFXクリアリング清算預託金の総額を得る。

(8)　一のFXクリアリング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FXクリアリング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FXクリアリング取引の種類ごとに算出しそれらを合計した額とする。

FXクリアリング取引証拠金の不足相当額＝（各算出基準日の付合せ時間帯終了時において一のFXクリアリング清算参加者が保有する一のFXクリアリング取引に係る売建玉又は買建玉の数量　×　当該FXクリアリング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FXクリアリング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FXクリアリング清算価格）　－　各算出基準日における当該FXクリアリング清算参加者のFXクリアリング取引証拠金預託額

（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)　第7号で得た預託すべきFXクリアリング清算預託金の総額から、FXクリアリング清算参加者の数に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FXクリアリング清算参加者に按分する。

(10) 前号で一のFXクリアリング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FXクリアリング清算参加者が預託すべきFXクリアリング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。

（2021年4月12日　追加、2023年3月20日　変更）

（損失処理期間終了後の新たなFXクリアリング清算預託金所要額）

第12条の6　方法書第41条の6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FXクリアリング清算預託金の額は、新所要額適用日（同項に規定する「新所要額適用日」をいう。）の6営業日前の営業日を特別算出基準日として、第12条の5の規定を準用して算出する額とする。この場合において、第12条の5第1項中「各算出基準日」とあるのは「特別算出基準日」と読み替えて適用する。

2　本取引所は、特別算出基準日の翌営業日に、FXクリアリング清算参加者に対し、当該預託すべきFXクリアリング清算預託金の額を通知する。

（2021年4月12日　追加）

（特別目的担保金の額）

第12条の7　方法書第41条の10第1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特別目的担保金の額は、他のFXクリアリング清算参加者（方法書第41条の5第1項に規定する他のFXクリアリング清算参加者をいう。）ごとに、次に掲げるところにより算出する。

(1)　一の損失処理期間における各取引日において、次に掲げるところにより変動相当額（方法書第41条の9第2項第1号に規定する変動相当額をいう。）を算出する。

イ　前条の規定を準用し、当該各取引日を算出基準日とみなして計算上の預託すべきFXクリアリング清算預託金の額に相当する額（以下「計算上清算預託金相当額」という。）を算出する。

ロ　次のa、b及びcに掲げる日の区分に応じて、当該a、b及びcに定めるところによ

り変動相当額の算出の基礎となる額（以下「算出基礎額」という。）を算出する。

a　損失処理期間の開始日

当該損失処理期間に適用される当初清算預託金所要額（方法書第 41 条の 5 第 2 項に規定する当初清算預託金所要額をいう。）と、当該開始日おける計算上清算預託金相当額とを比較して、いずれか大きい方の額を算出基礎額とする。

b　開始日の翌取引日

a の算出基礎額と、当該開始日の翌取引日における計算上清算預託金相当額とを比較して、いずれか大きい方の額を当該翌取引日における算出基礎額とする。

c　開始日の翌々取引日から終了日までの各取引日

前取引日における算出基礎額と、当該各取引日における計算上清算預託金相当額とを比較して、いずれか大きい方の額を当該各取引日における算出基礎額とする。

ハ　当日の算出基礎額から当初清算預託金所要額を控除した額を、当該一の損失処理期間の各取引日のおける変動相当額とする。

(2)　一の損失処理期間における各取引日において、次に掲げる第一清算拠出金相当額及び第二清算拠出金相当額を合計した清算拠出金相当額（方法書第 41 条の 9 第 2 項第 2 号に規定する清算拠出金相当額をいう。）を、それぞれ次に掲げるところにより算出する。

イ　第一清算拠出金相当額

FX クリアリング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額が、方法書第 41 条の 3 及び第 41 条の 4 の規定に基づく損失補填の額を超過した場合のその超過分に相当する額について、他の FX クリアリング清算参加者を対象に、当該他の FX クリアリング清算参加者の当初清算預託金所要額に応じて按分した額を算出する。ただし、このイの規定に基づき算出する額は、各 FX クリアリング清算参加者の当初清算預託金所要額を上限とする。

ロ　第二清算拠出金相当額

FX クリアリング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額が、方法書第 41 条の 3、第 41 条の 4、第 41 条の 5 及び第 41 条の 7 の規定に基づく損失補填の額を超過した場合のその超過分に相当する額として、当該超過が生じた取引日以降の損失発生日（方法書第 41 条の 2 第 3 項に規定する損失発生日をいう。）において正の FX クリアリング差金が発生する他の FX クリアリング清算参加者を対象に、当該損失発生日における債務不履行清算参加者（方法書第 41 条の 2 第 2 項に規定する債務不履行清算参加者をいう。）の負の FX クリアリング差金に相当する額について、当該他の FX クリアリング清算参加者の正の FX クリアリング差金の額に応じて按分した額を算出する。

ハ　イの規定に基づき算出した額とロの規定に基づき算出した額を合算した額を、当該一の損失処理期間の各取引日のおける清算拠出金相当額とする。

2　本取引所は、該当損失発生日（方法書第 41 条の 8 第 2 項に規定する該当損失発生日をいう。）の FX クリアリング差金の算出と同時に、第二清算拠出金負担清算参加者（同項に規定する第二清算拠出金負担清算参加者をいう。）の第二清算拠出金相当額に相当する額の正の FX クリ

アリング差金を、当該第二清算拠出金負担清算参加者の特別目的担保金に振り替える。

（2021 年 4 月 12 日　追加）

（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、個別申告にあっては当該転売又は買戻しを行ったときから、一括申告にあっ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、以下に定める時限までに行うものとする。

個別申告にあっては当該転売又は買戻しを行ったときから、一括申告にあっ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　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、2023 年 3 月 20 日、2024 年 9 月 16 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（円金利先物遠隔地取引参加者にあっては翌々営業日）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、2023 年 3 月 20 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（非清算参加者が円金利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、2023 年 3 月 20 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ことができる。

（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 項並びに第 90 条の 33 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。

（2023 年 3 月 20 日　変更）

（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 項並びに第 90 条の 33 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（非清算参加者が円金利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、2023 年 3 月 20 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 項及び第 90 条の 37 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 項及び第 90 条の 38 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、2023 年 3 月 20 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 条及び第 90 条の 39 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 ヵ月金利先物オプション取引又は無担保コールオーバーナイト 3 ヵ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、2023 年 3 月 20 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 条及び第 90 条の 39 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 条並びに第 90 条の 37 及び第 90 条の 38 に規定する転売又は買戻しの申告は、個別申告にあっては当該転売又は買戻しを行ったときから、一括申告にあっ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 ヵ月金利先物オプション取引又は無担保コールオーバーナイト 3 ヵ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又は無担保コールオーバーナイト 3 ヵ月金利先物オプション取引

翌営業日（円金利先物遠隔地取引参加者にあっては翌々営業日）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又は無担保コールオーバーナイト 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、2023 年 3 月 20 日　変更）

（権利行使の申告時限等）

第 31 条　方法書第 85 条第 1 項及び第 90 条の 41 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 項及び第 90 条の 42 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、2023 年 3 月 20 日　変更）

（割当の方法）

第 32 条　方法書第 87 条第 1 項及び第 90 条の 43 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。

（2023 年 3 月 20 日　変更）

（権利行使に伴う建玉の消滅時限）

第 33 条　方法書第 88 条各項及び第 90 条の 44 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 ヵ月金利先物又は無担保コールオーバーナイト 3 ヵ月金利先物の成立時限）とする。

（平成 29 年 7 月 24 日、2023 年 3 月 20 日　変更）

（権利行使に伴う円金利先物の成立時限）

第 34 条　方法書第 89 条各項及び第 90 条の 45 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、2023 年 3 月 20 日　変更）

（清算値段の決定方法）

第35条　方法書第90条第2項及び第90条の46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。

（2023年3月20日　変更）

（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と判断したとき、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に満たないときは、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 項に規定する手続きを行うときは、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銘柄ごとに、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×ｕ×（利率）×（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銘柄に係る株価指数清算価格

ｕ：日経 225 マイクロリセット付証拠金取引、NY ダウリセット付証拠金取引及び NASDAQ-100 リセット付証拠金取引にあっては 10 とし、その他の取引所株価指数証拠金取引にあっては 100 とする。

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 リセット付証拠金取引及び日経 225 マイクロリセット付証拠金取引　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 リセット付証拠金取引、DAX®リセット付証拠金取引、NY ダウリセット付証拠金取引、NASDAQ-100 リセット付証拠金取引及びラッセル 2000 リセット付証拠金取引　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と判断したときは、本取引所が適正と認める利率とする。

利率＝｛（Ｆ＋Ｄ－Ｓ）÷（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 リセット付証拠金取引にあっては連合王国、DAX®リセット付証拠金取引にあってはドイツ連邦共和国、NY ダウリセット付証拠金取引、NASDAQ-100 リセット付証拠金取引及びラッセル 2000 リセット付証拠金取引にあっ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®リセット付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)　金 ETF リセット付証拠金取引、原油 ETF リセット付証拠金取引、銀 ETF リセット付証拠金取引及びプラチナ ETF リセット付証拠金取引　取引日の終了時における一般社団

法人全銀協 TIBOR 運営機関が公表する直近の期間 12 ヵ月の日本円 TIBOR（Tokyo Inter-Bank Offered Rate）。

（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、2020 年 10 月 26 日、2021 年 4 月 12 日、2022 年 2 月 28 日、2023 年 9 月 11 日、2024 年 9 月 16 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 リセット付証拠金取引及び日経 225 マイクロリセット付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。

$B_D = \{(D_1 \times F_1) + (D_2 \times F_2) + \cdots + (D_N \times F_N)\} / V \times u$

B_D：日経 225 リセット付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

F_1：配当金の支払いが見込まれるＮ種類の銘柄のうち、1 番目の銘柄の株価換算係数

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

F_2：配当金の支払いが見込まれるＮ種類の銘柄のうち、2 番目の銘柄の株価換算係数

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

F_N：配当金の支払いが見込まれるＮ種類の銘柄のうち、Ｎ番目の銘柄の株価換算係数

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

ｕ　：日経 225 リセット付証拠金取引にあっては 100 とし、日経 225 マイクロリセット付証拠金取引にあっては 10 とする。

（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「株価換算係数」とは、指数の算出に用いる採用株価の水準を調整するために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 リセット付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 リセット付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 ダウリセット付証拠金取引、NASDAQ-100 リセッ

ト付証拠金取引及びラッセル2000リセット付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。

$B_D = (D_1 + D_2 + \cdots + D_N) / V \times u$

B_D： NY ダウリセット付証拠金取引、NASDAQ-100 リセット付証拠金取引及びラッセル2000 リセット付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 ： NY ダウリセット付証拠金取引については、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、NASDAQ-100 リセット付証拠金取引については、NASDAQ 社が NASDAQ-100 の算出において定める除数、ラッセル2000 リセット付証拠金取引については、FTSE International Limited がラッセル2000 の算出において定める除数

ｕ ： NY ダウリセット付証拠金取引及び NASDAQ-100 リセット付証拠金取引にあっては10 とし、ラッセル 2000 リセット付証拠金取引にあっては 100 とする。

（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、2020 年 10 月 26 日、2021 年 4 月 12 日、2021 年 12 月 10 日、2022 年 2 月 28 日、2023 年 9 月 11 日、2024 年 9 月 16 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）

（FXクリアリング清算価格の算出基準時間帯）

第39条の2　方法書第90条の25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。

（2021年4月12日　追加）

（スワップポイントの算出方法）

第39条の3　方法書第90条の28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)　LP取引参加者は、FXクリアリング特例第12条第1項の規定に基づき一以上のFXクリアリング取引参加者との間で取引を行うことを届け出ているFXクリアリング取引の種類ごとに、本取引所にスワップポイント参考値（FXクリアリング特例第20条第1項に規定するスワップポイント参考値をいう。以下同じ。）を提示する。

(2)　本取引所は、FXクリアリング取引の種類ごとに、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外した残りの数値の平均値を算出し、これをスワップポイントとする。ただし、提示されたスワップポイント参考値の数が次に掲げる数となる場合には、本取引所は、それぞれ次に掲げる値をスワップポイント参考値とすることができる。

イ　3以下　提示された全てのスワップポイント参考値の平均値

ロ　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最小のものからそれぞれ数えて本取引所が適当と認める数のスワップポイント参考値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LP取引参加者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LP取引参加者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　スワップポイント算出の基礎となるスワップポイント参考値の数が3以下となる場合であって本取引所が適当と認めたときには、本取引所は市場実勢等を勘案し、適正と認める値をスワップポイント参考値とみなして、第1項の規定に基づきスワップポイントを算出することができる。

4　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第3位未満の数が生じた場合は、小数点以下第4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。

5　本取引所が前4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と判断したときは、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。

（2021年4月12日　追加、2021年4月23日　変更）

（FXクリアリング取引の損益に係る端数の処理）

第39条の4　方法書90条の29第1項各号に掲げる決済損益差金の数額又はスワップポイントの数額の算出にあたり1円未満の端数が生じた場合は、当該各数額が正の値であるときはこれを切り捨て、負の値であるときはこれを切り上げる。

（2021年4月12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、次の各号に掲げる区分により、当該各号に定める日時とする。

(1)　金利先物等取引又は清算建玉　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。

(2)　為替証拠金取引又は株価指数証拠金取引　移管時刻が属する日の直前の営業日まで。

（平成22年10月1日、2021年2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を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）

（期限前終了割当建玉の割当て方法）

第42条　方法書第15条の10の3第1項に規定する期限前終了割当建玉の割当て方法は、期限前終了対象清算参加者（同項に規定する期限前終了対象清算参加者をいう。）以外の金利先物等清算参加者の自己取引及び受託取引の区分ごとに、本取引所が次の各号に定める順序に従って割り当てる。

(1)　当該金利先物等清算参加者の自己取引及び受託取引の区分ごとに、期限前終了対象建玉

の銘柄ごとの買建玉と売建玉をネットした建玉が、なお当該建玉と売り買いの別が反対となっている建玉を抽出し、その建玉の数量（以下「銘柄ごとネット数量」という。）を算出する。

(2)　前号において、当該金利先物等清算参加者が、受託取引に関してその内訳の区分（以下「サブアカウント」という。）を設定している場合は、銘柄ごとネット数量を当該サブアカウントごとに算出する。

(3)　期限前終了対象建玉の銘柄ごとの数量を、当該金利先物等清算参加者が保持する全ての自己取引及び受託取引の区分（サブアカウントを設定している場合は当該サブアカウントとする。以下同じ。）ごとに銘柄ごとネット数量を合計した数量に応じて按分し、当該金利先物等清算清算参加者ごとの割当数量とする。

(4)　前号による当該金利先物等清算参加者ごとの割当数量を、当該金利先物等清算参加者の自己取引及び受託取引の区分（ただし、サブアカウントを設定している場合には当該サブアカウント）について銘柄ごとネット数量に応じて按分して割り当て、期限前終了割当建玉とする。

(2023 年 3 月 20 日　追加)

（金利先物等清算預託金の補填順位）

第 43 条　方法書第 40 条第 10 項に規定する補填は、次の各号に掲げる損失の区分に従い、当該各号に定めるところにより行う。

(1)　方法書第 40 条第 5 項の規定により補填する損失の額が他の金利先物等清算参加者（同条第 4 項の規定に規定する他の金利先物等清算参加者をいう。）の当初金利先物等清算預託金所要額の総額を超えるとき

当初金利先物等清算預託金所要額総額の全額をもって当該損失を補填する。

(2)　(1)以外のとき

当該損失の額を、他の金利先物等清算参加者それぞれの当初金利先物等清算預託金所要額に応じて按分した額（当該額が当初金利先物等清算預託金所要額を超える場合は、当該当初金利先物等清算預託金所要額）をもって当該損失を補填する。ただし、本取引所が方法書第 15 条の 9 第 5 項又は第 15 条の 10 第 7 項に定めるポジション処理オークションを実施した場合における当該損失の補填は、次の a、b 及び c に掲げる金利先物等清算預託金の順序に従い、当該 a、b 及び c の定めるところによるものとする。

a　当該ポジション処理オークションにて入札を行わなかった他の金利先物等清算参加者（以下この条において「非入札参加者」という。）が本取引所に預託している金利先物等清算預託金

当該損失の額を、非入札参加者それぞれの当初金利先物等清算預託金所要額に応じて按分した額（当該額が当初金利先物等清算預託金所要額を超える場合は、当該当初金利先物等清算預託金所要額）をもって、当該損失を補填する。

b　当該ポジション処理オークションにて入札を行ったが落札に至らなかった他の金利先

物等清算参加者（以下この条において「入札参加者」という。）が本取引所に預託している金利先物等清算預託金

当該損失の額から前 a に定める額の合計額を控除した残額を、入札参加者それぞれの当初金利先物等清算預託金所要額に応じて按分した額（当該額が当初金利先物等清算預託金所要額を超える場合は、当該当初金利先物等清算預託金所要額）をもって、当該損失を補填する。

c　当該ポジション処理オークションにて入札を行い落札した他の金利先物等清算参加者（以下この条において「落札参加者」という。）が本取引所に預託している金利先物等清算預託金

当該損失の額から前 a に定める額の合計額及び前 b に定める額の合計額を控除した残額を、落札参加者それぞれの当初金利先物等清算預託金所要額に応じて按分した額（当該額が当初金利先物等清算預託金所要額を超える場合は、当該当初金利先物等清算預託金所要額）をもって、当該損失を補填する。

（2023 年 3 月 20 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 年度にあっ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 年度にあっ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。

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 2 月 1 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。

附則

この変更規則は、2021 年 4 月 23 日から施行する。

附則

この変更規則は、2021 年 12 月 10 日から施行する。

附則

この変更規則は、2022 年 2 月 28 日から施行する。

附則

この変更規則は、2023 年 3 月 20 日から施行する。

附則

この変更規則は、2023 年 9 月 11 日から施行する。

附則

1　この変更規則は、2024 年 9 月 16 日から施行する。
2　前項の規定にかかわらず、第 37 条第 1 項、第 37 条第 2 項第 1 号及び第 38 条第 1 項の日経 225 マイクロリセット付証拠金取引に関する変更規則は 2024 年 9 月 30 日から、第 15 条の取引所為替証拠金取引に関する変更規則は 2025 年 1 月 20 日から施行する。

別表第１　現在価値の算出式

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

$d_1 = 1 \div (1 + A_1 C_1)$　（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

$d_i = (1 - C_i \sum_{j=1}^{i-1} A_j d_j) \div (1 + A_i C_i)$（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ときは、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ときは、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ときは、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ときは、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

ユーロ円３ヵ月金利先物オプション取引又は無担保コールオーバーナイト３ヵ月金利先物オプション取引における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ヵ月金利先物オプション取引についてはユーロ円３ヵ月金利先物の清算価格、無担保コールオーバーナイト３ヵ月金利先物オプション取引については無担保コールオーバーナイト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 ヵ月の日本円 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
ln	：	自然対数