

東京金融取引所受託契約準則

第1章 総則

(目的)

第1条 この準則は、定款第39条の規定に基づき、本取引所の市場における市場デリバティブ取引の受託に関する契約、提携市場デリバティブ取引の受託に関する契約、提携市場デリバティブ取引の委託の取次ぎの受託に関する契約及び第4条第1項に規定する受管の委託を受けること（以下「受管の受託」という。）に関する契約について必要な事項、並びに取次者の本取引所の市場における市場デリバティブ取引の委託の取次ぎの引受けに関する契約について必要な事項を定める。ただし、オプションを取引の対象とする市場デリバティブ取引の受託に関する契約について必要な事項については、この準則に定めるもののほか、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。）をもって定める。

2 この準則の変更は、取締役会の決議をもって行う。ただし、変更の内容が軽微である場合は、この限りではない。

(平成3年7月8日、平成8年4月8日、平成10年12月1日、平成16年4月1日、平成17年7月1日、平成19年9月30日変更)

(適用除外)

第1条の2 顧客の受託に係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3章第2節、第4章、第5章、第7章、第8章の2及び第8章の3並びにその他非清算参加者、清算委託契約、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し、顧客の受託に係る市場デリバティブ取引が取引所株価指数証拠金取引であるときは、第3章第2節、第4章、第5章、第7章、第8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日変更)

(定義)

第2条 本取引所の定款、業務規程、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。）、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。）及び業務方法書における用語の意義は、この準則について適用する。ただし、この準則においてユーロ円3ヵ月金利先物とは、業務規程第3条第1号に規定する金融指標に係る市場デリバティブ取引及び業務規程第23条に規定する金融指標に係る清算建玉をいう。

(平成8年4月8日追加、平成10年12月1日、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22年10月1日変更)

(準則の遵守)

第3条 顧客及び取引参加者は、この準則を熟読し、これを遵守すべきことに同意してすべての取引を処理するものとする。ただし、顧客が取次者である場合における当該取次者と申込者との関係については、取引参加者と委託者との関係に準じて取引を処理するものとし、第5条第5項、第7条の2の2、第7条の3第1項、第7条の4第1項、第8条、第11条の3並びに第28条の2第2項を除きこの準則の規定を適用する。この場合において、第5条第3項中「本取引所が定める様式による金利先物等取引口座設定約諾書」とあるのは「本準則に準じた契約書」と、第6条の2第3項中「本取引所が定める様式による為替証拠金取引口座設定約諾書」とあるのは「本準則に準じた契約書」と、第6条の2の2第3項中「本取引所が定める様式による株価指数証拠金取引口座設定約諾書」とあるのは「本準則に準じた契約書」と、第10条中「第8条第1項」とあるのは「第8条の2」と、第6条、第9条及び第10条中「委託又はその委託の取次ぎの委託」とあるのは「委託又は委託の取次ぎの申込み」と、第42条第2項及び第43条中「顧客」とあるのは「申込者及び取次者」と、第1条、第6条、第7条の4第2項、第8条の2、第9条、第10条、第42条第2項並びに第43条を除き本準則中「取引参加者」とあるのは「取次者」と、「注文執行取引参加者」とあるのは「注文執行取引参加者に対する取次者」と、「清算執行取引参加者」とあるのは「清算執行取引参加者に対する取次者」と、「移管元取引参加者」とあるのは「移管元取引参加者に対する取次者」と、「移管先取引参加者」とあるのは「移管先取引参加者に対する取次者」と、「顧客」とあるのは「申込者」と、「委託証拠金」とあるのは「委託証拠金並びに取次証拠金」と、「委託」とあるのは「委託の取次ぎの申込み」と、「為替証拠金取引参加者」とあるのは「取引所為替証拠金取引に係る取次者」と、「株価指数証拠金取引参加者」とあるのは「取引所株価指数証拠金取引に係る取次者」と読み替えて適用する。

(平成8年4月8日、平成10年12月1日、平成11年10月26日、平成15年4月28日、平成16年4月1日、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22年10月1日、平成25年3月11日変更)

第2章 取引口座の設定 (平成8年4月8日変更)

(顧客からの通告事項)

第4条 顧客は、市場デリバティブ取引の委託又は、清算建玉の発生及びその清算の委託（以下「受管の委託」という。）をする場合には、あらかじめ次の各号に掲げる事項を取引参加者に通告するものとする。

- (1) 氏名又は名称
- (2) 住所又は事務所の所在地
- (3) 特に通信を受ける場所を定めたときは、その場所
- (4) 代理人を定めたときは、その氏名又は名称及び住所又は事務所の所在地並びに代理人の権限の範囲

2 顧客が前項各号に掲げる事項を変更したときは、取引参加者に対して直ちにその旨を通告しなければならない。

(平成8年4月8日、平成10年12月1日、平成16年4月1日、平成19年9月30日、平成20年4月7日変更)

(金利先物等取引口座の設定等)

第5条 顧客が金利先物等取引の委託又は受管の委託をしようとするときは、金利先物等取引に係る取引口座（以下「金利先物等取引口座」という。）を設定しなければならない。

2 金利先物等取引口座の設定については、顧客がその旨を金利先物等取引参加者に申し込み、その承諾を受けるものとする。

3 顧客は、前項の申込みにつき、金利先物等取引参加者の承諾を受けた場合には、本取引所が定める様式による金利先物等取引口座設定約諾書に所定事項を記載し、これに署名又は記名押印して、金利先物等取引参加者に差し入れるものとする。

4 金利先物等取引参加者は、取引証拠金、委託証拠金、金利先物等取引又は清算建玉について転売若しくは買戻し又は最終決済を行った場合の損益金、オプション料、その他授受する金銭を、第1項に規定する金利先物等取引口座により処理するものとする。

5 顧客がギブアップに係る金利先物等取引の委託をしようとするときは、第1項に規定する金利先物等取引口座を注文執行取引参加者及び清算執行取引参加者に設定しなければならない。

6 前項の規定にかかわらず、顧客が第7条の4第2項の規定に基づきギブアップに係る金利先物等取引の委託をしようとするときは、注文執行取引参加者の顧客は当該注文執行取引参加者に、清算執行取引参加者の顧客は当該清算執行取引参加者にそれぞれ第1項に規定する金利先物等取引口座を設定するものとする。

7 顧客が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。）第26条に規定する証拠金の預託方式として差換預託に同意するときは、あらかじめ本取引所が定める様式による差換預託に関する同意書を取引参加者に届け出るものとする。

8 顧客は、第3項の規定による約諾書の差し入れ及び前項の規定による差換預託に関する同意書の届出に代えて、取引参加者からその用いる電磁的方法（電子情報処理組織を使用する方法その他の情報通信の技術を利用する方法であって金融商品取引業等に関する内閣府令第57条の3に定める方法と同様の方法をいう。以下同じ。）の種類及び内容を提示され、取引参加者に書面又は電磁的方法による承諾をした場合には、電磁的方法により、当該約諾書の内容を承諾した旨、又は差換預託に関する同意を行った旨を取引参加者に通知することができる。この場合において、当該顧客は、当該約諾書を取引参加者に差し入れたもの、又は当該差換預託に関する同意書を届け出たものとみなす。

9 前項に規定する書面又は電磁的方法による承諾を得た取引参加者は、当該顧客から書面又は電磁的方法により電磁的方法による通知を行わない旨の申出があったときは、電磁的方法によって当該顧客から前項の規定による通知を受け入れてはならない。ただし、当該顧客が再び当該承諾をした場合は、この限りでない。

(平成8年4月8日、平成10年12月1日、平成11年10月26日、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4月7日、平成22年4月1日変更)

(外国市場デリバティブ取引口座の設定)

第6条 顧客が提携市場デリバティブ取引の委託又はその委託の取次ぎの委託をしようとするときは、外国市場デリバティブ取引口座を設定しなければならない。

2 外国市場デリバティブ取引口座の設定については、顧客がその旨を取引参加者に申し込み、その承諾を受けるものとする。

3 顧客は、前項の申込みにつき、取引参加者の承諾を受けた場合には、外国市場デリバティブ取引口座設定約諾書を取引参加者に差し入れるものとする。

4 取引参加者は、第10条に規定する証拠金その他の金銭を、第1項に規定する外国市場デリバティブ取引口座により処理するものとする。

5 顧客は、第3項の規定による約諾書の差し入れに代えて、取引参加者からその用いる電磁的方法の種類及び内容を提示され、取引参加者に書面又は電磁的方法による承諾をした場合には、電磁的

方法により、当該約諾書の内容を承諾した旨を取引参加者に通知することができる。この場合において、当該顧客は、当該約諾書を取引参加者に差し入れたものとみなす。

6 前項に規定する書面又は電磁的方法による承諾を得た取引参加者は、当該顧客から書面又は電磁的方法により電磁的方法による通知を行わない旨の申出があったときは、電磁的方法によって当該顧客から前項の規定による通知を受け入れてはならない。ただし、当該顧客が再び当該承諾をした場合は、この限りでない。

(平成8年4月8日、平成16年4月1日、平成19年9月30日、平成20年4月7日変更)

(為替証拠金取引口座の設定)

第6条の2 顧客が取引所為替証拠金取引の委託をしようとするときは、取引所為替証拠金取引に係る取引口座（以下「為替証拠金取引口座」という。）を設定しなければならない。

2 為替証拠金取引口座の設定については、顧客がその旨を為替証拠金取引参加者に申し込み、その承諾を受けるものとする。

3 顧客は、前項の申込みにつき、為替証拠金取引参加者の承諾を受けた場合には、本取引所が定める様式による為替証拠金取引口座設定約諾書に所定事項を記載し、これに署名又は記名押印して、為替証拠金取引参加者に差し入れるものとする。

4 為替証拠金取引参加者は、為替取引証拠金を、第1項に規定する為替証拠金取引口座により処理するものとする。

5 顧客は、第3項の規定による約諾書の差し入れに代えて、取引参加者からその用いる電磁的方法の種類及び内容を提示され、取引参加者に書面又は電磁的方法による承諾をした場合には、電磁的方法により、当該約諾書の内容を承諾した旨を取引参加者に通知することができる。この場合において、当該顧客は、当該約諾書を取引参加者に差し入れたものとみなす。

6 前項に規定する書面又は電磁的方法による承諾を得た取引参加者は、当該顧客から書面又は電磁的方法により電磁的方法による通知を行わない旨の申出があったときは、電磁的方法によって当該顧客から前項の規定による通知を受け入れてはならない。ただし、当該顧客が再び当該承諾をした場合は、この限りでない。

(平成17年7月1日追加、平成19年9月30日、平成20年4月7日変更)

(株価指数証拠金取引口座の設定)

第6条の2 の2顧客が取引所株価指数証拠金取引の委託をしようとするときは、取引所株価指数証拠金取引に係る取引口座（以下「株価指数証拠金取引口座」という。）を設定しなければならない。

2 株価指数証拠金取引口座の設定については、顧客がその旨を株価指数証拠金取引参加者等に申し込み、その承諾を受けるものとする。

3 顧客は、前項の申込みにつき、株価指数証拠金取引参加者等の承諾を受けた場合には、本取引所が定める様式による株価指数証拠金取引口座設定約諾書に所定事項を記載し、これに署名又は記名押印して、株価指数証拠金取引参加者等に差し入れるものとする。

4 株価指数証拠金取引参加者等は、株価指数証拠金取引を、株価指数証拠金取引口座により処理するものとする。

5 顧客は、第3項の規定による約諾書の差し入れに代えて、取引参加者からその用いる電磁的方法の種類及び内容を提示され、取引参加者に書面又は電磁的方法による承諾をした場合には、電磁的方法により、当該約諾書の内容を承諾した旨を取引参加者に通知することができる。この場合において、当該顧客は、当該約諾書を取引参加者に差し入れたものとみなす。

6 前項に規定する書面又は電磁的方法による承諾を得た取引参加者は、当該顧客から書面又は電磁的方法により電磁的方法による通知を行わない旨の申出があった場合は、電磁的方法によって当該顧客から同項の規定による通知を受け入れてはならない。ただし、当該顧客が再び当該承諾をしたときは、この限りでない。

(平成22年10月1日追加)

第3章 市場デリバティブ取引の受託

(平成8年4月8日追加、平成19年9月30日変更)

第1節 顧客による市場デリバティブ取引の委託

(平成11年10月26日追加、平成19年9月30日変更)

(取引の委託に先立つ指示事項)

第6条の3 顧客は、取引所為替証拠金取引の委託に先立って、為替証拠金取引参加者に対し第7条の2の2第1項に規定する建玉の決済方法のいずれかを指示しなければならない。

2 顧客は、取引所株価指数証拠金取引の委託に先立って、株価指数証拠金取引参加者等に対し、第7条の2の3第1項に規定する建玉の決済方法のいずれかを指示しなければならない。

(平成20年10月27日追加、平成22年10月1日変更)

(委託の際の指示事項)

第7条 顧客が金利先物等取引の委託をする場合には、その都度、次の各号に掲げる事項を取引参加者に指示するものとする。

- (1) 委託する金融指標等の種類及び限月取引
- (2) ストラテジー取引により行おうとするときは、その種類
- (3) ブロック取引により行おうとするときは、その旨
- (4) 売付取引又は買付取引の別（ストラテジー取引にあっては、ストラテジー売又はストラテジー買の別）
- (5) 数量
- (6) 価格の限度（ストラテジー取引にあってはストラテジー価格の限度）
- (7) 委託注文の有効期間
- (8) その他条件を付すときは、その条件

2 前項の規定にかかわらず、顧客が前項第7号の委託注文の有効期間を指示しない場合において、委託注文がプレオープン時間帯の開始時から当日の夜間取引時間帯の終了時（夜間取引時間帯における付合せを行わないときは日中取引時間帯の終了時。以下同じ。）までの間になされた場合には、当該委託注文は当該夜間取引時間帯の終了時まで有効とし、委託注文が夜間取引時間帯の終了後から翌営業日（業務規程第2条第23号に規定する営業日をいう。以下別途の定めがある場合を除き同じ。）のプレオープン時間帯の開始時までの間になされた場合には、当該委託注文は当該プレオープン時間帯の開始時から当日の夜間取引時間帯の終了時まで有効とする。

3 顧客が取引所為替証拠金取引の委託をする場合には、その都度、次の各号に掲げる事項を為替証拠金取引参加者に指示するものとする。

- (1) 委託する取引所為替証拠金取引の種類
- (2) 売付取引又は買付取引の別
- (3) 数量
- (4) 指値呼び値及びトリガー指値呼び値にあっては、価格の限度
- (5) トリガー呼び値にあっては、トリガー条件となる価格
- (6) 委託注文の有効期間。ただし、IC成行呼び値及びロスカット呼び値については、この限りでない。
- (7) その他条件を付すときは、その条件

4 顧客が、取引所株価指数証拠金取引の委託をする場合には、その都度、次の各号に掲げる事項を株価指数証拠金取引参加者等に指示するものとする。

- (1) 委託する取引所株価指数証拠金取引の種類
- (2) 売付取引又は買付取引の別
- (3) 数量
- (4) 指値呼び値及びトリガー指値呼び値にあっては、価格の限度
- (5) トリガー呼び値にあっては、トリガー条件となる価格
- (6) 委託注文の有効期間。ただし、IC成行呼び値及びロスカット呼び値については、この限りでない。
- (7) その他条件を付すときは、その条件

（平成3年12月9日、平成8年4月8日、平成10年7月28日、平成13年9月3日、平成15年4月28日、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4月28日、平成20年10月27日、平成22年10月1日変更）

（金利先物等取引に係る転売又は買戻し等の指示）

第7条の2 取引参加者に金利先物等取引を委託した顧客は、当該取引参加者の定める日時までに、成立する金利先物等取引又は成立した金利先物等取引について新規の売付取引、新規の買付取引、転売又は買戻しの別を当該取引参加者に指示するものとする。2前項の規定にかかわらず、金利先物等取引を委託した顧客が取引参加者に前項の指示をしないときは、新規の売付取引又は新規の買付取引の指示があったものとする。

3 金利先物等取引を委託した顧客は、その注文時において、新規の売付取引、新規の買付取引、転売又は買戻しの別を取引参加者に指示することを要しない。

（平成10年7月28日追加、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22年10月1日変更）

（取引所為替証拠金取引の決済方法）

第7条の2 の2為替証拠金取引参加者が顧客の委託に係る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、為替証拠金取引参加者の顧客ごとの取引について、業務方法書第90条の9の2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、為替証拠金取引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又は買建玉を有する場合で、新たに当該顧客の計算により、当該売建玉又は買建玉と同じ種類の取引所為替証拠金取引の買付取引又は売付取引を行ったときは、当該買付取引又は売付取引は当該為替証拠金取引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。

4 為替証拠金取引参加者に委託をした顧客は、その注文時において、新規の売付取引、新規の買付取引、転売又は買戻しの別を為替証拠金取引参加者に指示することを要しない。

(平成17年7月1日追加、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)

(取引所株価指数証拠金取引の決済方法)

第7条の2 の3株価指数証拠金取引参加者等が顧客の委託に係る取引所株価指数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、株価指数証拠金取引参加者等の顧客ごとの取引について、業務方法書第90条の22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、株価指数証拠金取引参加者等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又は買建玉を有する場合で、新たに当該顧客の計算により、当該売建玉又は買建玉と同じ種類の取引所株価指数証拠金取引の買付取引又は売付取引を行ったときは、当該買付取引又は売付取引は当該株価指数証拠金取引参加者等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。

4 株価指数証拠金取引参加者等に委託をした顧客は、その注文時において、成立させようとする取引所株価指数証拠金取引について新規又は決済の別を株価指数証拠金取引参加者等に指示することを要しない。

(平成22年10月1日追加)

第2節 ギブアップ

(平成11年10月26日追加)

(ギブアップに係る市場デリバティブ取引又は清算建玉の受管の委託)

第7条の3 顧客が注文執行取引参加者に委託し成立したギブアップに係る市場デリバティブ取引又は顧客が注文執行取引参加者に受管の委託を行い発生したギブアップに係る清算建玉が、本取引所が清算執行取引参加者からテイクアップ申告を受けたことにより消滅した場合には、当該市場デリバティブ取引又は清算建玉についての顧客と注文執行取引参加者との間の委託が終了し、同時にあらたに発生した市場デリバティブ取引又は清算建玉についての顧客と清算執行取引参加者との間の清算に係る委託があらたに成立するものとする。

2 ギブアップにより発生した市場デリバティブ取引又は清算建玉については、証拠金規則において、顧客が清算執行取引参加者に委託したものとみなし、かつ当該ギブアップの対象となった市場デリバティブ取引又は清算建玉を注文執行取引参加者が成立又は発生させた取引日において、顧客の委託に基づき成立又は発生したものとみなす。

(平成11年10月26日追加、平成15年4月28日、平成16年4月1日、平成19年9月30日変更)

(ギブアップに係る契約の締結)

第7条の4 注文執行取引参加者及び清算執行取引参加者がギブアップに係る市場デリバティブ取引又は清算建玉の受管の委託を受ける場合には、当該注文執行取引参加者、当該清算執行取引参加者及び当該委託をしようとする顧客の間でギブアップに係る契約を締結し、次の各号に掲げる事項を定めるものとする。

(1) 委託手数料の額並びにその徴収者及び徴収方法

(2) 清算の引受けの拒絶に関する事項

2 前項の規定にかかわらず、注文執行取引参加者の顧客及び清算執行取引参加者の顧客が異なる場合において、当該注文執行取引参加者及び当該清算執行取引参加者の間で本取引所が別に定める協定書が締結されているときは、当該注文執行取引参加者及び当該清算執行取引参加者は、ギブアップに係る市場デリバティブ取引又は清算建玉の受管の委託を受けることができるものとする。

(平成11年10月26日追加、平成11年12月7日、平成15年4月28日、平成16年4月1日、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又は清算建玉の受管の委託の際の指示事項)

第7条の5 顧客がギブアップに係る市場デリバティブ取引又は清算建玉の受管の委託をする場合には、その都度注文執行取引参加者に対し、第7条第1項各号又は第9条第1項各号に掲げる事項のほか、次の各号に掲げる事項を指示するものとする。

(1) 当該市場デリバティブ取引又は清算建玉がギブアップに係る市場デリバティブ取引又は清算建玉である旨

(2) 清算執行取引参加者の名

2 前項の規定にかかわらず、顧客は、注文執行取引参加者の同意がある場合には、当該注文執行取引参加者の定める時限までに、前項各号に掲げる事項を当該注文執行取引参加者に指示することができるものとする。ただし、顧客が当該指示をしないときは、当初からギブアップに係らない市場デリバティブ取引又は清算建玉の受管の委託がなされたものとする。

(平成11年10月26日追加、平成15年4月28日、平成16年4月1日、平成19年9月30日変更)

(ギブアップに係る転売又は買戻し等の指示)

第7条の6 ギブアップに係る市場デリバティブ取引又は清算建玉の清算に係る委託をした顧客は、清算執行取引参加者の定める日時までに、当該ギブアップによりあらたに発生した市場デリバティブ取引又は清算建玉について新規の売付取引若しくは清算売建玉、新規の買付取引若しくは清算買建玉、転売又は買戻しの別を当該清算執行取引参加者に指示するものとする。

2 前項の規定にかかわらず、顧客が清算執行取引参加者に前項の指示をしないときは、新規の売付取引若しくは新規の清算売建玉の発生又は新規の買付取引若しくは新規の清算買建玉の発生の指示があったものとする。

(平成11年10月26日追加、平成15年4月28日、平成15年5月9日、平成16年4月1日、平成19年9月30日変更)

(ギブアップに係る証拠金等)

第7条の7 顧客は、ギブアップに係る市場デリバティブ取引又は清算建玉については、証拠金及び転売若しくは買戻し又は最終決済に伴う金銭を、清算執行取引参加者との間で授受するものとする。

(平成11年10月26日追加、平成15年4月28日、平成16年4月1日、平成19年9月30日変更)

第4章 受管の受託

(平成8年4月8日追加)

(受管の委託の時期)

第8条 取引参加者に提携市場デリバティブ取引の委託又はその委託の取次ぎの委託を行い当該取引参加者の計算により清算建玉を発生させようとする顧客は、当該提携市場デリバティブ取引の委託又はその委託の取次ぎの委託をした時に、当該清算建玉につき当該取引参加者に受管の委託を行ったものとみなす。

2 取引参加者に提携市場デリバティブ取引の委託又はその委託の取次ぎの委託を行わずして当該取引参加者の計算により清算建玉を発生させようとする顧客は、当該清算建玉が発生した時に、当該清算建玉につき当該取引参加者に受管の委託を行ったものとみなす。

(平成8年4月8日追加、平成16年4月1日、平成19年9月30日変更)

(受管の委託の取次ぎの申込みの時期)

第8条の2 取次者に提携市場デリバティブ取引の委託又は委託の取次ぎの申込みを行い取引参加者の計算により清算建玉を発生させようとする申込者は、当該提携市場デリバティブ取引の委託又は委託の取次ぎの申込みをした時に、当該清算建玉につき当該取次者に受管の委託の取次ぎの申込みを行ったものとみなす。

(平成10年12月1日追加、平成16年4月1日、平成19年9月30日変更)

(提携市場デリバティブ取引の委託又はその委託の取次ぎの委託の際の指示事項)

第9条 前2条に規定する顧客が取引参加者に提携市場デリバティブ取引の委託又はその委託の取次ぎの委託をしようとする場合には、その都度、次の各号に掲げる事項を当該取引参加者に指示するものとする。

(1) 委託する指標の種類及び限月取引

(2) 数量

(3) 提携市場デリバティブ取引における指標の数値

(4) 委託注文の有効期間

2 前項の規定にかかわらず、前2条に規定する顧客が前項第4号の委託注文の有効期間を指示しない場合において、委託注文が提携外国取引所の取引の行われる時間帯(以下「提携外国取引所の取引時間帯」という。)においてなされた場合には、当該委託注文は当該提携外国取引所の取引時間帯に限り有効とし、委託注文が提携外国取引所の取引時間帯以外の時になされた場合には、当該委託注文はその直後に到来する提携外国取引所の取引時間帯に限り有効とする。

(平成8年4月8日追加、平成10年12月1日、平成16年4月1日、平成19年9月30日変更)

(提携市場デリバティブ取引に係る証拠金及び手数料等)

第10条 取引参加者は、第8条第1項に規定する顧客から提携市場デリバティブ取引の委託又はその委託の取次ぎの委託を受け当該提携市場デリバティブ取引が成立した場合において、当該取引参加者の定める額の委託手数料を、当該取引参加者の定めるときに、当該顧客から徴収することができる。

2 取引参加者は、委託手数料のほかに通信又は通送に要した実費その他提携市場デリバティブ取引に関し要した費用を、徴収することができる。

3 取引参加者は、第8条第1項に規定する顧客の委託又は委託の取次ぎの委託に係る提携市場デリバティブ取引が成立した場合で当該提携市場デリバティブ取引が成立した提携外国取引所の営業日中に当該提携市場デリバティブ取引に係る外国建玉と同条件の清算建玉が発生しなかったときは、取引参加者の定める方法により、当該提携市場デリバティブ取引に係る損益金及び当該取引参加者の定める額の当該提携市場デリバティブ取引に係る証拠金を当該顧客と授受することができる。

(平成8年4月8日追加、平成16年4月1日、平成19年9月30日変更)

(転売又は買戻し等の指示)

第11条 取引参加者に受管の委託をした顧客は、当該取引参加者の定める日時までに、発生した清算建玉又は発生する清算建玉について新規の清算売建玉の発生、新規の清算買建玉の発生、転売又は買戻しの別を当該取引参加者に指示するものとする。

2 前項の規定にかかわらず、受管の委託をした顧客が取引参加者に前項の指示をしないときは、新規の清算売建玉又は新規の清算買建玉が発生したものとする。

3 取引参加者に受管の委託をした顧客は、その委託時において、新規の清算売建玉の発生、新規の清算買建玉の発生、転売又は買戻しの別を取引参加者に指示することを要しない。

(平成8年4月8日追加、平成16年4月1日、平成19年9月30日変更)

第5章 建玉移管

(平成15年4月28日追加)

(建玉移管の委託の際の指示事項)

第11条の2 顧客が建玉移管の委託をする場合には、移管元取引参加者及び移管先取引参加者それぞれの定める日時までに、次の各号に掲げる事項を当該移管元取引参加者及び移管先取引参加者それぞれに指示するものとする。

(1) 移管建玉の金融指標等の種類及び限月取引又はオプション特例に定める銘柄

(2) 売建玉又は買建玉の別

(3) 移管建玉の数量

(4) 移管元取引参加者に指示する場合は移管先取引参加者の名。移管先取引参加者に指示する場合は移管元取引参加者の名

(5) 建玉移管を行う日

(平成15年4月28日追加、平成16年4月1日、平成17年7月1日変更)

(移管建玉に係る委託)

第11条の3 顧客の委託に係る移管建玉が移管先取引参加者に引き継がれた場合には、移管時刻をもって当該移管建玉についての顧客と移管元取引参加者との間の委託が終了し、同時に当該移管建玉についての顧客と移管先取引参加者との間の委託があらたに成立するものとする。

(平成15年4月28日追加、平成15年5月9日、平成16年4月1日変更)

第6章 証拠金

(平成8年4月8日追加、平成10年12月1日、平成15年4月28日、平成16年4月1日変更)

(証拠金)

第11条の4 証拠金に関する事項は、証拠金規則、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。)及び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。)によるものとする。

(平成10年12月1日追加、平成15年4月28日、平成16年4月1日、平成17年7月1日、平成22年10月1日変更)

第11条の5 から第21条まで(削除)

(平成16年4月1日変更)

第7章 金利先物等取引及び清算建玉に係る転売若しくは買戻し又は最終決済に伴う金銭の授受

(平成8年4月8日追加、平成10年12月1日、平成15年4月28日、平成17年7月1日、平成19年9月30日変更)

(転売又は買戻しに伴い授受する金銭)

第22条 顧客の市場デリバティブ取引(金利先物等取引をいう。以下本章において同じ。)又は清算建玉について転売又は買戻しを行った場合には、金融指標等ごとの取引単位あたり次の各号に定める計算式により算出した額に当該顧客の取引数量及び受管数量(各数量ともにギブアップに係るものを除く。)並びにギブアップに係る発生数量の合計数量を乗じた額の金銭を取引参加者と顧客との間で授受するものとする。

(1) ユーロ円3ヵ月金利先物

1 億円×転売又は買戻しに係る約定価格又は受管数値と当該転売又は買戻しの対象となった買付取引若しくは売付取引に係る約定価格又は清算買建玉若しくは清算売建玉に係る受管数値との差×100分の1×360日分の90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

1,000万円×転売又は買戻しに係る約定価格と当該転売又は買戻しの対象となった買付取引又は売付取引に係る約定価格との差×100分の1

(3) 無担保コールオーバーナイト金利先物

3億円×転売又は買戻しに係る約定価格と当該転売又は買戻しの対象となった買付取引又は売付取引に係る約定価格との差×100分の1×360日分の30日

(4) ユーロ円LIBOR6ヵ月金利先物の取引単位あたり授受する金銭の額

1億円×転売又は買戻しに係る約定価格と当該転売又は買戻しの対象となった買付取引又は売付取引に係る約定価格との差×100分の1×360日分の180日

2 前項において、顧客の市場デリバティブ取引が売付取引の場合又は顧客の清算建玉が清算売建玉の場合、買戻しに係る約定価格又は受管数値が当該買戻しの対象となった売付取引に係る約定価格又は当該買戻しの対象となった清算売建玉に係る受管数値を下回ったときには顧客が金銭を受け取ることとなり、買戻しに係る約定価格又は受管数値が当該買戻しの対象となった売付取引に係る約定価格又は当該買戻しの対象となった清算売建玉に係る受管数値を上回ったときには顧客が金銭を支払うこととなり、顧客の市場デリバティブ取引が買付取引の場合又は顧客の清算建玉が清算買建玉の場合、転売に係る約定価格又は受管数値が当該転売の対象となった買付取引に係る約定価格又は当該転売の対象となった清算買建玉に係る受管数値を上回ったときには顧客が金銭を受け取ることとなり、転売に係る約定価格又は受管数値が当該転売の対象となった買付取引に係る約定価格又は当該転売の対象となった清算買建玉に係る受管数値を下回ったときには顧客が金銭を支払うこととなる。

3 ユーロ円先物遠隔地取引参加者とその顧客は、第1項の規定による金銭の授受を円通貨以外の通貨建て現金により行うことができる。

(平成3年2月15日、平成4年5月1日、平成4年7月14日、平成8年4月8日、平成10年12月1日、平成11年3月23日、平成11年10月26日、平成12年11月1日、平成15年4月28日、平成15年5月9日、平成16年4月1日、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21年6月1日、平成23年12月1日、平成24年4月23日変更)

(転売又は買戻しに伴う損失金の支払時限)

第23条 顧客は、前条の規定により金銭を支払うこととなった場合には、前条の規定により算出された額の金銭を、当該転売又は買戻しを行った取引日の日中取引時間帯の属する営業日の翌々営業日(銀行法第15条第1項の規定による銀行の休日にあたる場合は順次繰り下げる。)以内の取引参加者の指定する日時までに取引参加者に支払うものとする。

(平成10年12月1日追加、平成16年4月1日、平成17年12月20日変更)

(差金決済のために授受する金銭)

第24条 ユーロ円3ヵ月金利先物、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、10年円金利スワップ先物、無担保コールオーバーナイト金利先物又はユーロ円LIBOR6ヵ月金利先物の限月取引について取引最終日以前に買戻しが行われなかった売付取引若しくは清算売建玉(以下「最終売建玉」という。)又は転売が行われなかった買付取引若しくは清算買建玉(以下「最終買建玉」という。)については、当該限月取引の取引最終日の日中取引時間帯(ユーロ円LIBOR6ヵ月金利先物については、当該限月取引の取引最終日の夜間取引時間帯)終了後に本取引所が業務方法書により決定する数値(以下「差金決済数値」という。)による決済(以下「差金決済」という。)を行うものとし、この場合、顧客と取引参加者は、金融指標等ごとの取引単位あたり次の各号に定める計算式により算出した額に当該顧客の最終売建玉の数量又は最終買建玉の数量を乗じた額の金銭を授受するものとする。

(1) ユーロ円3ヵ月金利先物

1億円×差金決済数値と最終売建玉又は最終買建玉に係る約定価格又は受管数値との差×100分の1×360日分の90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

- 1,000万円×差金決済数値と最終売建玉又は最終買建玉に係る約定価格との差×100分の1
- (3) 無担保コールオーバーナイト金利先物
3億円×差金決済数値と最終売建玉又は最終買建玉に係る約定価格との差×100分の1×360日分の30日
- (4) ユーロ円LIBOR6ヵ月金利先物の取引単位あたり授受する金銭の額
1億円×差金決済数値と最終売建玉又は最終買建玉に係る約定価格との差×100分の1×360日分の180日

2 前項において、最終売建玉を有する顧客については、差金決済数値が当該最終売建玉に係る約定価格又は受管数値を下回ったときには顧客が金銭を受け取ることとなり、差金決済数値が当該最終売建玉に係る約定価格又は受管数値を上回ったときには顧客が金銭を支払うこととなり、最終買建玉を有する顧客については、差金決済数値が当該最終買建玉に係る約定価格又は受管数値を上回ったときには顧客が金銭を受け取ることとなり、差金決済数値が当該最終買建玉に係る約定価格又は受管数値を下回ったときには顧客が金銭を支払うこととなる。

3 ユーロ円先物遠隔地取引参加者とその顧客は、第1項の規定による金銭の授受を円通貨以外の通貨建て現金により行うことができる。

(平成10年12月1日追加、平成11年3月23日、平成15年5月9日、平成16年4月1日、平成17年12月20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)

(差金決済に係る金銭の支払時限)

第25条 顧客は、前条の規定により算出された支払うべき額の金銭を、決済期日(本取引所が業務規程により各金融指標等の限月取引ごとに定める日をいう。以下同じ。)の翌営業日以内の取引参加者が指定する日時までに取引参加者に支払うものとする。

(平成10年12月1日追加、平成16年4月1日、平成17年12月20日変更)

第26条、第27条(削除)

(平成17年12月20日変更)

(計算上の利益の払出し又は証拠金への振替に伴う金銭の授受)

第28条 取引参加者は、第22条から第25条までの規定にかかわらず、証拠金規則第36条の規定により計算上の利益の払出し又は証拠金への振替を受けている顧客の委託に係る未決済の市場デリバティブ取引又は未決済の清算建玉について転売若しくは買戻し又は最終決済を行ったときの顧客との金銭の授受については、次の各号に定めるところにより行うものとする。この場合において、証拠金規則第36条の規定は第2号における未決済の市場デリバティブ取引又は未決済の清算建玉にも適用されるものとする。

(1) 転売若しくは買戻し又は最終決済の結果顧客の委託に係る未決済の市場デリバティブ取引又は未決済の清算建玉がない場合

イ 計算上の利益の払出額及び証拠金への振替額に相当する円通貨の額が第22条又は第24条の規定により顧客が受け取ることとなる金銭の額に相当する円通貨の額(以下「決済利益額」という。)を上回るときは、取引参加者はこれを顧客に通知するものとし、顧客は、転売若しくは買戻し又は最終決済の行われた取引日の日中取引時間帯の属する営業日の翌々営業日以内の取引参加者の指定する日時までに、当該差額を取引参加者に返還しなければならない。この場合においては、第22条又は第24条の規定にかかわらず、取引参加者は顧客に対し決済利益額を支払わないものとする。

ロ 計算上の利益の払出額及び証拠金への振替額に相当する円通貨の額が決済利益額を下回るときは、第22条又は第24条の規定にかかわらず、取引参加者は顧客に対し当該差額を支払うものとする。

ハ 第22条又は第24条の規定により顧客が支払うこととなる金銭の額に相当する円通貨の額(以下「決済損失額」という。)があるときは、顧客は第23条又は第25条の規定に従い、決済損失に係る金銭を取引参加者に支払うとともに、計算上の利益の払出額及び証拠金への振替額を転売若しくは買戻し又は最終決済の行われた取引日の日中取引時間帯の属する営業日の翌々営業日以内の取引参加者の指定する日時までに、取引参加者に返還しなければならない。

(2) 転売若しくは買戻し又は最終決済の結果顧客の委託に係る未決済の市場デリバティブ取引又は未決済の清算建玉が残存する場合

イ 取引参加者は、計算上の利益の払出額及び証拠金への振替額に相当する円通貨の額が決済利益額を上回るときは、第22条又は第24条の規定にかかわらず、顧客に対し決済利益額を支払わないものとする。この場合において、計算上の利益の払出額及び証拠金への振替額に相当する円通貨の額と決済利益額との差額をあらたな計算上の利益の払出額及び証拠金への振替額とする。

ロ 計算上の利益の払出額及び証拠金への振替額に相当する円通貨の額が決済利益額を下回るときは、第22条又は第24条の規定にかかわらず、取引参加者は顧客に対し当該差額を支払うものとする。この場合において、計算上の利益の払出額及び証拠金への振替額は零となる。

ハ 顧客に決済損失額があるときは、顧客は決済損失に係る金銭の支払いを第23条又は第25条の規定に従い行うものとする。この場合において、計算上の利益の払出額及び証拠金への振替額は

- 転売若しくは買戻し又は最終決済前と同額とする。
- 2 ユーロ円先物遠隔地取引参加者とその顧客は、前項の規定による金銭の支払い及び返還を円通貨以外の通貨建て現金により行うことができる。
- (平成8年4月8日追加、平成10年12月1日、平成15年4月28日、平成15年5月9日、平成16年4月1日、平成17年12月20日、平成19年9月30日、平成21年6月1日変更)

第8章 取引所為替証拠金取引に係る決済及び金銭の授受 (平成17年7月1日追加、平成20年10月27日変更)

(取引所為替証拠金取引に係る決済)

第28条の2 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、第7条の2の2第1項第1号の転売・買戻しの申告又は同項第2号の転売・買戻し(以下この条及び次条において「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(以下「為替差金決済」という。)とする。

2 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・買戻しの申告等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為替証拠金取引参加者との間に新たに発生するものとする。以下この章において取引所為替証拠金取引に係る当該建玉の消滅及び発生を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日変更)

(為替差金)

第28条の3 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 前項第1号の引直為替評価損益の数額とは、取引により新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生じた場合において、当該取引が成立した取引日の為替清算価格(業務方法書第90条の2第1項に規定する為替清算価格をいう。以下この条において同じ。)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に、その差に基づいて算出した正又は負の計算上の数額をいう。

3 第1項第2号の更新為替評価損益の数額の累計額とは、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生じた場合において、当該ロールオーバーが生じ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とを比較して差が生じているときに、その差に基づいて算出した正又は負の計算上の数額の累計額をいう。

4 第1項第3号の決済為替評価損益の数額とは、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に、その差に基づいて算出した正又は負の計算上の数額をいう。

- (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・買戻しの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

5 第1項第4号のスワップポイントの累計額とは、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生じ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、当該建玉に係る2通貨間における金利差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(「スワップポイント」という。)の累計額をいう。

6 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。以下この項において同じ。)に係る第1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。

（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）

（取引所為替証拠金取引に関する金銭の授受）

第28条の4 為替証拠金取引参加者及び顧客のなす取引所為替証拠金取引に係る金銭の授受に関する事項は、為替証拠金規則によるものとする。

（平成17年7月1日追加、平成17年12月20日変更）

第8章の2 取引所株価指数証拠金取引に係る決済及び金銭の授受

（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決済）

第28条の5 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、第7条の2の3第1項第1号の転売・買戻しの申告又は同項第2号の転売・買戻し（以下この条及び次条において「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（次条第1項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 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・買戻しの申告等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株価指数証拠金清算参加者との間に新たに発生するものとする。以下この章において取引所株価指数証拠金取引に係る当該建玉の消滅及び発生をロールオーバーという。

（平成22年10月1日追加）

（株価指数差金）

第28条の6 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

2 前項第1号の引直株価指数差金の数額とは、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（業務方法書第90条の12第1項に規定する株価指数清算価格をいう。以下この条において同じ。）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に、その差に基づいて算出した正又は負の計算上の数額をいう。

3 第1項第2号の更新株価指数差金の数額の累計額とは、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が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に、その差に基づいて算出した正又は負の計算上の数額の累計額をいう。

4 第1項第3号の解消株価指数差金の数額とは、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に、その差に基づいて算出した正又は負の計算上の数額をいう。

- (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口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

5 第1項第4号の金利相当額の数額の累計額とは、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前条第1項の決済の決済期日が繰り延べられた

場合に、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、売建玉を保有する者にとっては正となり、買建玉を保有する者にとっては負となる計算上の数額の累計額をいう。

6 第1項第5号の配当相当額の数額の累計額とは、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に、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、買建玉を保有する者にとっては正となり、売建玉を保有する者にとっては負となる計算上の数額の累計額をいう。

7 DAX®証拠金取引については、配当相当額の数額の累計額は生じないものとする。

(平成22年10月1日追加)

(取引所株価指数証拠金取引に関する金銭の授受)

第28条の7 株価指数証拠金取引参加者等及び顧客のなす取引所株価指数証拠金取引に係る金銭の授受に関する事項は、株価指数証拠金規則によるものとする。

(平成22年10月1日追加)

第8章の2の2 取引所為替証拠金取引に係るロスカット取引管理態勢

(平成23年8月1日追加)

(ロスカット取引の管理態勢)

第28条の7の2 為替証拠金取引参加者は、為替証拠金規則第2条第6号に規定する受託取引分について同規則第22条の3第1項に規定する非個人用為替証拠金基準額を適用する顧客（金融商品取引法第2条第31項に規定する特定投資家及び同法第34条の3の規定により特定投資家とみなされる者を除く。）の委託に基づき取引所為替証拠金取引を行うにあたり、ロスカット取引を行うための十分な管理態勢を整備するものとする。

2 前項の管理態勢は、次に掲げるところによる。

(1) 付合せ時間帯中の5分以内の間隔で有効証拠金比率が100%を下回っていないことを確認すること

(2) 有効証拠金比率が100%を下回っている場合は、直ちにロスカット取引を実行すること。

3 この条において「ロスカット取引」とは、顧客の委託に基づき行う取引所為替証拠金取引を決済した場合に、当該顧客に生ずることとなる損失の額が、当該顧客との間であらかじめ約した計算方法により算出される額に達する場合に、当該顧客が受ける損失を限定することを目的として行うこととする取引所為替証拠金取引の転売又は買戻しをいう。

4 この条において「有効証拠金比率」とは、為替証拠金規則第2条第2号に規定する為替取引証拠金額について為替差金の金額の調整（為替差金が正の数ときは当該正の数の額を加算し、負の数ときはその絶対値の額を減算する。）を行った後の額を、為替証拠金規則第19条第1項に規定する発注証拠金の額に取引所為替証拠金取引の種類ごとの保有する売建玉の合計又は買建玉の合計のいずれか多い方の数量（同数量の場合は当該数量）を乗じた額の合計額で除した額に100を乗じて得られる百分率の数値をいう。

(平成23年8月1日追加)

第8章の3 取引所株価指数証拠金取引に係るロスカット取引管理態勢

(平成22年10月1日追加)

(ロスカット取引の管理態勢)

第28条の8 株価指数証拠金取引参加者等は、個人である顧客（金融商品取引法第2条第31項第1号の適格機関投資家及び同法第34条の4の規定により特定投資家とみなされるものを除く。以下この条において同じ。）との間で取引所株価指数証拠金取引を行おうとするときは、ロスカット取引を行うための十分な管理態勢を整備しなければならない。

2 前項の管理態勢は、次に掲げるところによる。

(1) 顧客の損失が株価指数証拠金を上回ることがないように、価格変動リスク、流動性リスク等を勘案して、ロスカット取引を実行する水準を定めること。

(2) ロスカット取引に関する明確な取決めを顧客との契約に反映すること。

(3) 取引時間中の各時点における顧客の損失の額を適切に把握し、第1号の水準に抵触した場合にはロスカット取引を実行すること。

(4) ロスカット取引を実行した状況を、定期的に又は必要に応じて随時に、取締役会又はこれに相当するものに報告すること。

3 取引参加者は、顧客ごとに、ロスカット取引を行うための態勢及びロスカット取引の内容を異なるものとするができる。

4 この条において「ロスカット取引」とは、株価指数証拠金取引において顧客が受ける損失を限定することを目的とする、次に掲げる行為その他の措置をいう。

(1) 顧客の計算による転売又は買戻しを行い、顧客が有する建玉の全部又は一部を解消すること。

(2) 顧客の計算に属する建玉について、両建てとなる取引を行うこと。

- (3) 顧客の計算に属する建玉について、顧客自身にあらかじめ損失を限定することとなる条件付注文を行わせること。
(平成 22 年 10 月 1 日追加)

第9章 顧客の決済不履行の場合の措置等

(平成 8 年 4 月 8 日、平成 15 年 4 月 28 日、平成 16 年 4 月 1 日、平成 17 年 7 月 1 日変更)

(顧客の決済不履行の場合の措置)

第29条 顧客が所定の時刻までに、市場デリバティブ取引又は清算建玉に関し取引参加者に差入れ若しくは預託すべき証拠金又は支払うべき金銭を差入れ若しくは預託せず又は支払わないときは、当該取引参加者は、任意に、当該市場デリバティブ取引又は当該清算建玉を決済するために当該顧客の計算において、転売若しくは買戻し又は最終決済を行うことができる。

2 取引参加者が、前項により損害を被った場合においては、顧客のために占有する金銭及び有価証券等をもって、その損害の賠償に充当し、なお不足があるときは、その不足額の支払いを顧客に対し請求することができる。

(平成 8 年 4 月 8 日、平成 10 年 12 月 1 日、平成 15 年 4 月 28 日、平成 16 年 4 月 1 日、平成 19 年 9 月 30 日変更)

(顧客の過大な建玉に対する措置)

第30条 顧客の未決済の市場デリバティブ取引の数量と未決済の清算建玉の数量の合計数量が、当該顧客の計算によるギブアップに係る市場デリバティブ取引又は清算建玉の発生により、取引参加者が当該顧客に随時あらかじめ通知した上限を超えたときは、当該取引参加者は、任意に、当該上限を超えた数量と同量の市場デリバティブ取引又は清算建玉を決済するために当該顧客の計算において、転売若しくは買戻し又は最終決済を行うことができる。

2 一定期間内に発生する顧客のギブアップに係る市場デリバティブ取引又は清算建玉の数量が、当該顧客の計算によるギブアップに係る市場デリバティブ取引又は清算建玉の発生により、取引参加者が当該顧客に随時あらかじめ通知した上限を超えたときは、当該取引参加者は、任意に、当該市場デリバティブ取引又は当該清算建玉を決済するために当該顧客の計算において、転売若しくは買戻し又は最終決済を行うことができる。

(平成 8 年 4 月 8 日、平成 10 年 12 月 1 日、平成 11 年 10 月 26 日、平成 16 年 4 月 1 日、平成 19 年 9 月 30 日変更)

第31条 から第38条まで (削除)

(平成 16 年 4 月 1 日、平成 17 年 10 月 20 日、平成 17 年 12 月 20 日変更)

第10章 委託手数料等

(平成 8 年 4 月 8 日、平成 10 年 12 月 1 日、平成 15 年 4 月 28 日変更)

(委託手数料)

第39条 取引参加者が顧客から市場デリバティブ取引の委託を受け当該市場デリバティブ取引が成立した場合において当該顧客から徴収する委託手数料の額及びその徴収方法は、あらかじめ当該取引参加者と当該顧客との間で定めるものとする。

2 取引参加者が顧客から受管の委託を受け当該委託に従い清算建玉が発生した場合において顧客から徴収する委託手数料は、当該取引参加者の定める額とする。

3 移管元取引参加者及び移管先取引参加者が顧客から建玉移管の委託を受け当該建玉移管が行われた場合において顧客から徴収する委託手数料は、当該移管元取引参加者及び移管先取引参加者がそれぞれ定める額とする。

(平成 3 年 2 月 15 日、平成 8 年 4 月 8 日、平成 10 年 4 月 1 日、平成 10 年 12 月 1 日、平成 15 年 4 月 28 日、平成 16 年 4 月 1 日、平成 19 年 9 月 30 日変更)

(通信費等の徴収)

第40条 取引参加者は、委託手数料のほかに通信若しくは通送に要した実費又はその他市場デリバティブ取引若しくは清算建玉の発生に関し要した費用を、顧客から徴収することができる。

(平成 4 年 5 月 1 日、平成 8 年 4 月 8 日、平成 10 年 12 月 1 日、平成 16 年 4 月 1 日、平成 19 年 9 月 30 日変更)

第11章 市場デリバティブ取引の約定取消

(平成 18 年 6 月 1 日追加、平成 19 年 9 月 30 日変更)

(顧客に対する措置)

第41条 取引参加者が業務規程第14条の3第1項に基づく通知を受領したときは、次の各号に掲げる顧客に対し、速やかに、当該受領した内容を通知するものとする。

- (1) 取引所システムの稼働に支障が生じた時点以降に成立した取引の委託を当該取引参加者に対し

行っていた顧客

(2) その他、当該取引参加者が必要と判断した顧客

2 取引参加者が業務規程第14条の3第2項に基づき本取引所から通知を受領したときは、以下に掲げる顧客に対し、速やかに、当該受領した内容を通知するものとする。

(1) 取消し等の対象となる取引の委託を当該取引参加者に対し行っていた顧客

(2) その他、当該取引参加者が必要と判断した顧客

(平成18年6月1日追加、平成19年9月30日変更)

(取引の取消しの効果等)

第42条 本取引所が市場デリバティブ取引の取消しを行った場合には、当該取り消された取引に係る顧客と取引参加者との間の権利及び義務は、初めから発生しなかったものとみなす。

2 顧客は、本取引所が市場デリバティブ取引を取り消したことにより損害を受けることがあっても、本取引所に対して、その損害の賠償を請求できないものとする。ただし、本取引所に故意又は重過失が認められる場合は、この限りでない。

(平成25年3月11日追加)

第12章 雑則

(平成25年3月11日追加)

(市場の利用による責任の所在)

第43条 顧客は、以下の事由により生じた損害については、本取引所に対してその賠償を請求できないものとする。

(1) 本取引所が法令又は本取引所の諸規則に基づく措置をとったこと

(2) 天災地変等の不可抗力

(平成25年3月11日追加)

附則

この準則は、本取引所の成立の日から施行する。

附則

第24条の2の規定は、平成2年10月1日から施行する。

附則

この変更規定は、平成3年2月15日から施行する。

附則

第1条の変更規定は、平成3年7月8日から施行する。

附則

この変更規定は、平成3年12月9日から施行する。

附則

この変更規定は、平成4年5月1日から施行する。

附則

この変更規定は、平成4年7月14日から施行する。

附則

第8条の変更規定は、平成4年8月1日から施行する。

附則

第8条及び第9条の変更規定は、平成6年3月28日から施行する。

附則

この変更規定は、平成8年4月8日から施行する。

附則

別表第3の変更規定は、平成9年3月31日から施行する。

附則

この変更規定は、平成10年4月1日から施行する。

附則

第7条及び第7条の2の変更規定は、平成10年7月28日から施行する。

附則

この変更規定は、平成10年12月1日から施行する。

附則

この変更規定は、平成11年3月23日から施行する。ただし、第40条の変更規定は、平成11年4月1日から施行する。

附則

この変更規定は、平成11年6月14日から施行する。

附則

この変更規定は、平成11年10月26日から施行する。

附則

この変更規定は、平成11年12月7日から施行する。

附則

この変更規定は、平成13年9月3日の夜間取引時間帯から施行する。

附則

1 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

2 商法等の一部を改正する法律（平成13年法律第128号）附則第7条第1項の規定によりなお従前の例によるとされた転換社債又は新株引受権付社債は、新株予約権付社債とみなして、この規則を適用する。

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5月9日

附則

この変更規定は、平成16年4月1日から施行する。

附則

この変更規定は、平成17年7月1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6月1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4月7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

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取引参加者の顧客である者は、改正後の第6条の3の規定にかかわらず、この改正規定の施行の時に於いて、当該為替証拠金取引参加者に対し改正後の第7条の2の2第1項第2号の決済方法を指示したものとみなす。

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3月11日から施行する。