

売買システム障害に伴う先物・オプション取引の取引代行に関する取扱い

2023年5月29日現在
株式会社大阪取引所
株式会社東京商品取引所
株式会社日本証券クリアリング機構

項 目	内 容	備 考
1. 制定趣旨	<ul style="list-style-type: none"> 取引参加者が大阪取引所又は東京商品取引所（以下、「当社」という。）の売買システム、取引参加者のシステム又は電力・通信網等（以下、「売買システム等」という。）の稼働に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により国債証券先物取引、金利先物取引、指数先物取引、商品先物取引、有価証券オプション取引、国債証券先物オプション取引、指数オプション取引及び商品先物オプション取引（以下「先物・オプション取引」という。）の呼値を行うことが困難である場合には、あらかじめ他の取引参加者を通じて呼値を行うことができるよう、所要の取扱いを定めるものとする。 	<ul style="list-style-type: none"> 大阪取引所業務規程第58条第2項等、東京商品取引所業務規程第27条
2. 定義	<ul style="list-style-type: none"> 「取引の代行」とは、障害取引参加者が他の取引参加者をして先物・オプション取引を代行させることをいう。 「障害取引参加者」とは、売買システム等の稼働に支障が生じ、先物・オプション取引の呼値を行うことができない取引参加者をいう。 「代行取引参加者」とは、障害取引参加者からの指示に基づき取引を代行する取引参加者をいう。 	
3. 取引の代行的条件	<ul style="list-style-type: none"> 取引参加者が、売買システム等の稼働に支障が生じたことにより、先物・オプション取引の呼値を行うことができないと当社が認める場合とする。 取引を代行させようとする場合には、あらかじめ当社の承認を必要とする。 	<ul style="list-style-type: none"> 「先物・オプション取引の取引代行承認申請書」を提出す

項 目	内 容	備 考
<p>4. 手続き</p> <p>(1) 代行取引参加者の承諾</p> <p>(2) 注文の発注・受託</p> <p>(3) ギブアップ機能の利用による取引の移管</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・ 障害取引参加者は、債券系（国債証券先物取引／国債証券先物オプション取引）、金利系（金利先物取引）、株式系（指数先物取引／指数オプション取引／有価証券オプション取引）、商品先物取引／商品先物オプション取引については貴金属系、ゴム系、農産物系、エネルギー系でそれぞれ一取引参加者を限度として代行取引参加者を指定することができる。 ・ 障害取引参加者は、取引を代行させる場合には、あらかじめ他の取引参加者から代行取引参加者として当該障害取引参加者の取引を代行する旨の承諾を得るものとする。 ・ 代行取引参加者は、取引を代行する取引については、すべて委託取引として取り扱うものとする。 ・ 代行取引参加者は、代行した約定について、JSCC清算システムのギブアップ機能を利用して障害取引参加者へ取引を移すこととする。代行取引参加者は、代行した約定を、ギブアップ数量及びテイクア 	<p>るものとする。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 書面による承諾を得るものとする。 ・ 「先物・オプション取引口座設定約諾書」の差入れは不要とする。 ・ J-NET取引については、本来当社のシステム障害時に用いる「OSE売買システム障害時におけるJ-NET取引申込書」（Targetに掲載）を、障害取引参加者がTarget等にて当社に提出することにより、取引を代行させることなく呼値を行うこととする。 ・ 代行取引参加者は、代行した取引日と同一の取引日の当社が定める時限までに、ギブ

項 目	内 容	備 考
(4) 障害取引参加者の清算執行	<p>アップ参加者名称に障害取引参加者名を入力することにより、ギブアップ申告を行う。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 障害取引参加者（当該障害取引参加者が非清算参加者の場合は、当該障害取引参加者の指定清算参加者。）は、取引代行の対象となった取引について清算を執行する。 ・ この場合において、障害取引参加者及び代行取引参加者は、取引代行の対象となった取引の内容について、双方の認識に齟齬がないか確認するものとする。 	<p>アップ申告を行う。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ ギブアップ契約は不要とする。 ・ ギブアップ手数料は課金しない。 ・ 障害取引参加者は、代行した取引日と同一の取引日の当社の定める時限までに、JSCC清算システムの「テイクアップ申告」機能を用いて、清算を執行する取引を確定させる。 ・ 清算の執行が確定された約定について、障害取引参加者が他の取引参加者（代行取引参加者を含む。）へギブアップ申告及びギブアップ訂正申告を行うことはできない。
(5) アロケーション申告、クローズアウト数量申告及びポジション申告	<ul style="list-style-type: none"> ・ 障害取引参加者は、システム障害発生前に自らの呼値により成立した取引（ギブアップ及びテイクアップにより成立した取引を加味する。）に取引代行分を加えた未決済約定について、必要に応じてアロケーション申告、クローズアウト数量申告及びポジション申告を行うものとする。ただし、当該障害取引参加者が非清算参加者である場合には、アロケーション申告は不要とする。 ・ 代行取引参加者は、自らの呼値により成立した取引（ギブアップ及びテイクアップにより成立した取引を加味し、取引代行分に係る注 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 障害取引参加者は当日の長期国債先物オプション取引の権利行使・割当てに伴い成立する先物を決済に含める場合には、当該数量も含めてクローズアウト数量申告及びポジション申告を行う。

項 目	内 容	備 考
(6) 取引代行内容の申告	<p>文を含まない。)について、必要に応じてアロケーション申告、クローズアウト数量申告及びポジション申告を行うものとする。ただし、当該代行取引参加者が非清算参加者である場合には、アロケーション申告は不要とする。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 障害取引参加者及び代行取引参加者は、取引代行の対象となった取引について、以下の内容を当社に申告するものとする。 <ul style="list-style-type: none"> ① 銘柄 ② 約定値段 ③ 約定数量 ④ 障害取引参加者の自己・委託の別 ⑤ 約定通知番号 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 申告時限は代行した取引日と同一の取引日の午後6時とし、Target登録等により行う。
(7) 取引証拠金	<ul style="list-style-type: none"> ・ 障害取引参加者（当該障害取引参加者が非清算参加者の場合は、当該障害取引参加者の指定清算参加者。以下5(1)を除き同じ。）は、クリアリング機構が定める各口座ごとに、システム障害発生前に自らの呼値により成立した取引（ギブアップ及びテイクアップにより成立した取引を加味する。）に取引代行分を加えた未決済約定に係る取引証拠金所要額以上の取引証拠金を預託するものとする。 ・ 代行取引参加者（当該代行取引参加者が非清算参加者の場合は、当該代行取引参加者の指定清算参加者。以下5(1)を除き同じ。）は、クリアリング機構が定める各口座ごとに、自らの呼値により成立した取引（ギブアップ及びテイクアップにより成立した取引を加味する。）から取引代行分を除いた取引の未決済約定に係る取引証拠金所要額以上の取引証拠金を預託するものとする。 	
(8) 値洗差金等の授受	<ul style="list-style-type: none"> ・ 取引代行分に係る先物取引の引直差金及びオプション取引の取引代金については、障害取引参加者が授受するものとする。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 更新差金については、通常どおり障害取引参加者が授受する。

項 目	内 容	備 考
<p>5. 取引参加者料金等の取扱い</p> <p>(1) 取引手数料</p> <p>(2) 清算手数料</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・ 代行取引参加者は、取引の代行を行った取引日の属する月においては、自らの呼値により成立した取引（取引代行分に係る注文を含む。）に応じた取引手数料を支払うものとする（ただし、国債先物オプション取引の権利行使又は権利行使の割当てにより成立した国債先物取引に係る取引手数料は、障害取引参加者が支払うものとする。）。 ・ 障害取引参加者は、システム障害発生前に自らの呼値により成立した取引（ギブアップ及びテイクアップにより成立した取引を加味する。）及び代行取引参加者に取引を代行させた取引を清算対象取引とし、当該清算対象取引に係る清算手数料を支払うものとする。 ・ 代行取引参加者は、自らの呼値により成立した取引（ギブアップ及びテイクアップにより成立した取引を加味する。）から取引を代行した取引を除いた取引を清算対象取引とし、当該清算対象取引に係る清算手数料を支払うものとする。 	
<p>6. オプション取引に係る権利行使の申告</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・ 障害取引参加者は、オプション取引の権利行使においてオプション取引を代行させた場合は、取引代行分を含めて権利行使の申告を行う。 <p style="text-align: right;">以 上</p> <p>「先物・オプション取引の取引代行承認申請書」の提出先 株式会社大阪取引所 市場管理部 取引管理室 株式会社東京商品取引所 総合業務室 市場管理担当 TEL： 050-3361-1660 FAX： 06-6222-4861</p>	

備考

東京商品取引所において取り扱われる商品については、以下のとおり、読み替えることとする。

項番	大阪取引所において取り扱われる商品での表現	東京商品取引所において取り扱われる商品での表現
1	代行	代理
2	先物・オプション取引	商品先物取引
3	呼値	注文
4	先物・オプション取引口座設定約諾書	約諾書
5	J-NET取引	立会外取引、EFP取引及びEFS取引
6	OSE 売買システム障害時における J-NET 取引申込書	TOCOM 売買システム障害時における立会外取引等申込書
7	取引を移す	取引を付替える
8	取引日	計算区域
9	ギブアップ申告	ギブアップ申出
10	テイクアップ申告	テイクアップ申出
11	ギブアップ訂正申告	業務規程第32条に基づくギブアップの取消し及び業務規程第31条に基づくギブアップ申出
12	引直差金	約定差金
13	更新差金	帳入差金
14	取引参加者料金	取引参加料等
15	取引手数料	定率参加料

以上