

業務方法書の取扱い

(目的)

第1条 この規則は、業務方法書に基づき、本所が定める事項について規定する。

(清算資格の取得申請)

第2条 業務方法書第5条第1項及び第2項の清算資格の取得申請は、清算資格の取得申請者が、次の各号に掲げる事項を記載した所定の清算資格取得申請書を本所に提出して行うものとする。

(1) 取得しようとする清算資格の種類（先物・オプション清算資格又はFX清算資格の別及び自社清算資格又は他社清算資格の別をいう。以下同じ。）

(2) 商号又は名称（英文の商号又は名称を含む。）

(3) 本店又は主たる事務所の所在地

(4) 代表者名

(5) 清算資格の取得申請理由

2 前項の清算資格取得申請書には、本所が必要と認める書類を添付しなければならない。

3 清算資格取得申請者は、申請の都度本所が定める日までに、資格審査料として30万円を本所に納入するものとする。この場合において、複数の清算資格を同時に取得申請するときであっても、当該資格取得に係る資格審査料は30万円とする。ただし、清算資格取得申請者が、清算資格の取得の申請と同時に取引資

格の取得の申請を行った場合は、この限りでない。

(届出事項)

第3条 業務方法書第11条第1項、第12条並びに第18条の2、第40条及び第41条に規定する本所への届出は、本所が指定するときまでに、所定の届出書に本所が必要と認める書類を添付して行うものとする。

(清算預託金に係る金銭の取扱い)

第4条 清算参加者が、業務方法書第14条第1項に規定する清算預託金を金銭により本所に差し入れる場合には、清算参加者は、本所が指定する銀行のうちから当該清算参加者が選定した銀行に設けられた本所名義の口座への振込みにより当該差入れを行うものとする。

2 本所に清算預託金として預託されている金銭の清算参加者への返戻は、本所が本所名義の口座から当該清算参加者名義の口座への振込みにより行うものとする。

(代用有価証券)

第5条 業務方法書第14条第3項から第5項までに定める代用有価証券に関する事項は、別表に定める。

(報告事項)

第6条 業務方法書第19条に規定する本所が定める場合は、次の各号に掲げる場合とし、所定の報告書に本所が必要と認める書類を添付して報告するものとする。

- (1) 株式会社日本証券クリアリング機構（以下「クリアリング機構」という。）の業務方法書に規定する現物清算資格を喪失したとき。
- (2) 業務方法書第12条の3に規定する清算対象取引に係るポジションの管理に関する事項を定めた社内規則，損失の危険の管理方法，業務分掌の方法その他の業務の内容及び方法を定めたとき又は変更したとき。
- (2)の2 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とき。
- (3) 次の a 又は b に掲げる区分に従い，当該 a 又は b に定める場合
- a 先物・オプション清算参加者
- (a) 金融商品取引業者が，法第28条第1項第1号に掲げる業務を休止し，又は再開したとき。
- (b) 登録金融機関が，法第33条の5第1項第3号に規定する登録金融機関業務を休止し，又は再開したとき。
- b FX清算参加者
- (a) 金融商品取引業者が，第二種金融商品取引業（取引所FX取引の委託を受ける場合は第二種金融商品取引業及び有価証券等管理業務）を休止し，又は再開したとき。
- (b) 登録金融機関が，法第33条の5第1項第3号に規定する登録金融機関業務を休止し，又は再開したとき。
- (4) 破産手続開始，再生手続開始，更生手続開始，清算開始若しくは特別清算開始の申立てを行ったとき，又はこれらの申立てが行われた事実を知ったとき。

(4)の2 指定親会社について，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とき。

(5) 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とき。

(5)の2 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とき。

(6) 純財産額（登録金融機関にあっては，純資産額とする。以下この号において同じ。）が5億円を下回ったとき（当該清算参加者が他社清算参加者である場合は，純財産額が100億円を下回ったとき）。

(7) 資本金の額又は出資の総額（相互会社にあっては，基金（基金償却積立金を含む。）の総額）が3億円を下回ったとき。

(8) 次のaからdまでに掲げる区分に従い，当該aからdまでに定める事由に該当したとき。

a 金融商品取引業者

自己資本規制比率（第一種金融商品取引業を行わない者にあつては，法第46条の6第1項の規定に準じて算出した比率をいう。以下この号において同じ。）又は連結自己資本規制比率が140パーセントを下回ったとき（当該清算参加者が他社清算参加者である場合は，自己資本規制比率又は連結自己資本規制比率が200パーセントを下回ったとき）。

b 国際統一基準行，農林中央金庫及び株式会社商工組合中央金庫

次の(a)から(c)までのいずれかに該当したとき（外国銀行にあっては，これに準ずる場合に該当したとき）。

- (a) 単体又は連結普通株式等 Tier 1 比率（農林中央金庫にあっては，単体又は連結普通出資等 Tier 1 比率）が 4.5 パーセントを下回ったとき。
 - (b) 単体又は連結 Tier 1 比率が 6 パーセントを下回ったとき。
 - (c) 単体又は連結総自己資本比率が 8 パーセントを下回ったとき。
- c 国際統一基準行，農林中央金庫，株式会社商工組合中央金庫，外国銀行及び保険会社以外の登録金融機関
- 海外事業拠点を有する場合は国際統一基準に係る単体又は連結自己資本比率が 8 パーセントを，海外事業拠点を有しない場合は国内基準に係る単体又は連結自己資本比率が 4 パーセントを下回ったとき。
- d 保険会社
- 単体又は連結ソルベンシー・マージン比率が 200 パーセントを下回ったとき（当該清算参加者が他社清算参加者である場合は，単体又は連結ソルベンシー・マージン比率が 400 パーセントを下回ったとき）。
- (9) 総株主の議決権（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き，会社法（平成 17 年法律第 86 号）第 879 条第 3 項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含む。）又は出資に係る議決権の過半数が一の個人又は他の一の法人その他の団体によって保有されることを知ったとき。
- (10) 大株主上位 10 名（自己又は他人の名義をもって所有する

株式の数が多い順に10名の株主をいう。)に関し変更があったとき。

(11) 役員が他の会社その他の法人の役員に就任又は退任したとき。

(12) 法令の規定により処分若しくは処罰を受けたとき又は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とき。

(12)の2 指定親会社又は特定主要株主（法第32条第4項に規定する特定主要株主をいう。以下同じ。）が法令の規定により処分若しくは処罰を受けたことを知ったとき又は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とき。

(13) 金融商品取引業者にあつては、役員が法第29条の4第1項第2号イからトまでに掲げる者のいずれかに該当することとなったとき、登録金融機関にあつては、役員が破産手続開始の決定、禁錮以上の刑又は法の規定により罰金の刑を受けたとき。

(13)の2 指定親会社の役員が法第29条の4第1項第2号イからトまでに掲げる者のいずれかに該当することとなった事実を知ったとき。

(14) 金融商品取引業者の主要株主（法第29条の4第2項に規定する主要株主をいう。以下同じ。）が同条第1項第5号ニ又はホに該当することとなった事実を知ったとき（外国法人にあつては、主要株主に準ずる者が同号へに該当することとなった事実を知ったとき。）。

(14)の2 指定親会社の主要株主が法第29条の4第1項第5

号ニ又はホに該当することとなった事実を知ったとき。

(15) 民事事件に係る訴え（訴訟の目的の価額が3億円未満のものを除く。以下同じ。）を提起され若しくは当該訴訟について判決等があったとき（上訴の場合を含む。）又は民事調停法（昭和26年法律第222号）による調停（調停を求める事項の価額が3億円未満のものを除く。以下同じ。）を申し立てられ若しくは当該調停事件が終結したとき。

(15)の2 指定親会社が民事事件に係る訴えを提起され若しくは当該訴訟について判決等があったことを知ったとき（上訴の場合を含む。）又は民事調停法による調停を申し立てられ若しくは当該調停事件が終結したことを知ったとき。

(16) 金融商品取引業者にあつては、法第46条の3第2項の規定に基づく関係会社に関する報告書を作成したとき。

(17) 法第56条の2に基づくモニタリング調査表（登録金融機関にあつては、本所が定める主要勘定状況表）を作成したとき。

(17)の2 法第57条の5第3項の規定に従い公衆の縦覧に供する経営の健全性の状況を記載した書面を作成したとき。

(17)の3 最終指定親会社（法第57条の12第3項に規定する最終指定親会社をいう。以下同じ。）が法第57条の17第3項の規定に従い公衆の縦覧に供する経営の健全性の状況を記載した書面を作成したとき。

(18) 金融商品取引業者にあつては、事業報告書（金融商品取引業等に関する内閣府令（平成19年内閣府令第52号）第179条第2項に規定する添付書類を含む。）を作成したとき、登録金融機関にあつては、単体又は連結の業務報告書又は中間業

務報告書を作成したとき。

(18)の2 法第57条の3第1項に基づく事業報告書を作成したとき。

(18)の3 最終指定親会社が事業報告書を作成したとき。

(19) 外国法人である金融商品取引業者にあつては、法第49条の3第1項に規定する貸借対照表、損益計算書その他財務計算に関する書類を作成したとき。

(20) 非清算参加者との間で有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引に係る債務の履行の確実性の観点から清算受託契約を解約することができる条件を定めたとき又は変更したとき。

(21) 当該清算参加者を指定清算参加者として指定している非清算参加者が決済を履行しない場合又はそのおそれがある状態となったとき。

(22) 指定親会社が本店又は主たる事務所を変更したことを知ったとき。

(23) 法第57条の2第1項又は同条第6項（同項第2号に該当することとなった場合に限る。）の届出を行ったとき。

(24) 指定親会社の指定があつたこと、当該指定が解除されたこと又は当該指定が効力を失つたことを知ったとき。

(25) 指定親会社が他の法人と合併したことを知ったとき（当該指定親会社が合併により消滅した場合を除く。）。

(26) 指定親会社の役員の変更があつたことを知ったとき（第11号に掲げる場合を除く。）。

(27) 新たに特定主要株主に該当した者があつたこと又は特定主要株主に該当しなくなった者があつたことを知ったとき。

2 前項に定めるもののほか、FX清算参加者は、事業年度ごと

に、所定の区分管理状況等報告書（区分管理の状況及び外部監査又は内部監査の状況を記載したものを含む。）を作成し提出しなければならない。ただし、当該F X清算参加者がF X取引資格（取引参加者規程第2条第5項に規定するF X取引資格をいう。）を有する場合は、この限りでない。

（清算資格の喪失申請）

第7条 業務方法書第21条の清算資格の喪失申請は、清算資格の喪失申請者が、次の各号に掲げる事項を記載した所定の清算資格喪失申請書を本所に提出して行うものとする。

- (1) 喪失しようとする清算資格の種類
- (2) 商号又は名称（英文の商号又は名称を含む。）
- (3) 本店又は主たる事務所の所在地
- (4) 代表者名
- (5) 清算資格の喪失申請理由

2 前項の清算資格喪失申請書には、次の各号に掲げる書類を添付しなければならない。

- (1) 清算資格の喪失に係る日程表
- (2) その他本所が必要と認める書類

3 清算参加者は、本所の清算資格を喪失するときは、申請の都度本所が定める日までに、清算資格の喪失に係る手数料として30万円を本所に納入するものとする。この場合において、複数の清算資格を同時に喪失申請するときであっても、当該資格喪失に係る手数料は30万円とする。ただし、清算参加者が、清算資格の喪失と同時に取引資格を喪失する場合は、この限りでない。

4 前項の規定にかかわらず、清算参加者が、清算資格の喪失と同時に新たに同一の清算資格を取得する場合又は業務方法書第27条の2に規定するときは、清算資格の喪失に係る手続料の納入を要しない。

(清算参加者参加金の免除)

第7条の2 業務方法書第27条の2に規定する清算資格を喪失する清算参加者と清算資格の取得申請者の実態に差異がないと本所が認めるときとは、清算資格の喪失申請者から清算資格の取得申請者へ事業の全部譲渡が行われるとき、清算資格の喪失申請者から清算資格の取得申請者へ分割による事業の全部承継が行われるとき及び清算資格の喪失申請者と清算資格の取得申請者が合併する場合で清算資格の取得申請者が存続会社となるときその他本所が適当と認める場合をいう。

(清算受託契約)

第8条 業務方法書第39条に規定する清算受託契約は、別紙様式によるものとする。

(先物・オプション取引に係る転売又は買戻しの申告時限)

第9条 業務方法書第47条第1項、第53条第1項及び第58条第1項に規定する転売又は買戻しの申告は、当該転売又は買戻しが成立した取引日の終了する日において午後5時までに行うものとする。

(約定数値を清算数値とする取引成立の時間帯)

第10条 業務方法書第48条第2項に規定する本所が定める時間帯は、午後3時から指数先物取引に関する業務規程及び受託契約準則の特例第5条第1項第1号に規定する日中立会の終了時までとする。

(先物取引の理論価格)

第11条 業務方法書第48条第2項に規定する理論価格は、指数先物取引に関する業務規程及び受託契約準則の特例の施行規則別表2「理論価格算出に関する表」により算出するものとする。この場合において、同別表2中「算出時の取引対象指数」とあるのは「最終の取引対象指数」と読み替えるものとする。

(オプション取引に係る権利行使の申告時限)

第12条 業務方法書第55条第1項及び第60条第1項に規定する権利行使の申告は、権利行使日において午後5時までに行うものとする。

(権利行使の割当方法)

第13条 業務方法書第56条第1項及び第61条第1項に規定する権利行使の割当ては、権利行使が行われた銘柄の売建玉について、各清算参加者又は各非清算参加者の自己分の数量及び委託分の数量を最小単位に細分化して行うものとする。

(取引所FX取引に係る建玉の申告時限)

第13条の2 業務方法書第63条の2第1項に規定する取引所FX取引に係る建玉の申告は、各取引日の終了する日(休業日(業

務方法書第3条第2項に規定する休業日をいい、同条第4項に規定する臨時休業日を含む。)に当たるときは、順次繰り下げる。)の午前10時までに行うものとする。

- 2 前項の規定にかかわらず、本所は、必要があると認めるときは、同項の申告時限を臨時に変更することができるものとする。この場合においては、あらかじめその旨をFX清算参加者に通知する。

(取引所FX取引において約定数値を清算数値とする取引成立の時間帯)

第13条の3 業務方法書第63条の3第2項に規定する本所が定める時間帯は、取引所外国為替証拠金取引に関する業務規程及び受託契約準則の特例(以下「取引所FX取引特例」という。)第5条第1項各号に定める立会時が終了する前の5分間とする。

(金銭の受払い)

第14条 業務方法書第64条第2項に規定する金銭の受払いは、次の各号に定めるところにより行うものとする。

- (1) 金銭を支払う清算参加者は、本所が指定する銀行及び日本銀行のうちから清算参加者が選定した銀行(以下「資金決済銀行」という。)に口座を設け、当該口座から当該資金決済銀行に先物・オプション取引の決済を行うために設けられた本所名義の口座に振り込むものとする。
- (2) 金銭を受領する清算参加者は、受領金額について本所と照合を行った後、資金決済銀行に口座を設け、当該口座におい

て受領するものとする。

(非対円金融指標に係る差金の額)

第14条の2 非対円金融指標(取引所FX取引特例第3条第2項に規定する非対円金融指標をいう。以下同じ。)に係る業務方法書第63条の4, 第63条の5及び第63条の7に規定する差に相当する金銭は, それぞれの数値間の差に基準通貨(取引所FX取引特例第3条第2項に規定する非対円金融指標について, 金融指標の算出の基準となる通貨をいう。)に係る対円金融指標(取引所FX取引特例第3条第2項に規定する対円金融指標をいう。以下同じ。)における当該取引日の清算数値を乗じることにより得られる円価額(円位未満の端数金額は切り捨てる。)とする。

(取引所FX取引に係る差金の額の申告及び受払い)

第14条の3 FX清算参加者は, 業務方法書第63条の8の規定により授受する金銭の額を, 預り目的(取引所外国為替証拠金取引に係る証拠金及び未決済約定の引継ぎ等に関する規則(以下「FX証拠金規則」という。))第13条第1項に規定する取引証拠金の区分をいう。以下同じ。)ごとに決済日(業務方法書第63条の4に規定する決済日をいう。)の午前10時までに本所に申告するものとする。

2 FX清算参加者は, 非対円金融指標について, 委託取引の合計について算出した前条に定める差に相当する金銭の額(以下「委託合計額」という。)と顧客ごとに算出した前条に定める差に相当する金銭の額の合計額(以下「顧客合計額」という。)

に差が生じる場合は、委託合計額から顧客合計額を差し引いて得られる額を、前項の規定により本所に申告するFX清算参加者自己分に係る金銭の額に加算して得た額を、FX清算参加者自己分に係る金銭の額として申告するものとする。

- 3 業務方法書第63条の8第2項に規定する金銭の受払いは、前2項に定める申告額及び本所が算出した額に基づき、本所が預り目的ごとの取引証拠金を加減することにより行うこととする。
- 4 FX清算参加者は、前項の加減により預り目的ごとの取引証拠金が取引証拠金所要額に満たなくなる場合は、当該取引証拠金所要額から当該取引証拠金を差し引いた額以上の取引証拠金を、FX証拠金規則第11条及び第12条に定めるところにより、本所に預託しなければならない。

(先物・オプション清算預託金、為替清算預託金及び本所の利益剰余金相当額による損失の補填方法)

第15条 業務方法書第70条第5項に規定する不履行発生日の清算参加者(同項に規定する不履行発生日の清算参加者をいう。以下同じ。)が本所に預託している先物・オプション清算預託金、為替清算預託金及び本所の利益剰余金相当額(同条第5項に規定する本所の利益剰余金相当額をいう。以下同じ。)による補填は、次の各号に定めるところにより行うものとする。

- (1) 第6項に規定する先物・オプション未補填損失額の補填
 - a 先物・オプション未補填損失額が、第3項に規定する先物・オプション清算預託金総額及び第7項に規定する先物・オプション割当剰余金の合計額を超えるとき。

先物・オプション清算預託金総額及び先物・オプション割当剰余金の全額をもって先物・オプション未補填損失額の損失の補填にあてる。

b 前 a 以外の場合

(a) 先物・オプション未補填損失額が、先物・オプション清算預託金総額又は先物・オプション割当剰余金のいずれか小さい方の額に 2 を乗じて得た額を超えるとき。

先物・オプション清算預託金総額又は先物・オプション割当剰余金のいずれか小さい方の額の全額をもって先物・オプション未補填損失額の補填にあてた後、先物・オプション清算預託金総額又は先物・オプション割当剰余金のいずれか大きい方の額をもって残額の損失の補填にあてる。

(b) 前(a)以外の場合

先物・オプション未補填損失額を 2 で除して得られる額について、先物・オプション清算預託金総額及び先物・オプション割当剰余金をもってそれぞれ先物・オプション未補填損失額の補填にあてる。

(2) 第 6 項に規定する F X 未補填損失額の補填

a F X 未補填損失額が、第 3 項に規定する為替清算預託金総額及び第 7 項に規定する F X 割当剰余金の合計を超えるとき。

為替清算預託金総額及び F X 割当剰余金の全額をもって F X 未補填損失額の補填にあてる。

b 前 a 以外の場合

(a) F X 未補填損失額が、為替清算預託金総額又は F X 割

当剰余金のいずれか小さい方の額に2を乗じて得た額を超えるとき。

為替清算預託金総額又はFX割当剰余金のいずれか小さい方の額の全額をもってFX未補填損失額の補填にあてた後、為替清算預託金総額又はFX割当剰余金のいずれか大きい方の額をもって残額の損失の補填にあてる。

(b) 前(a)以外の場合

FX未補填損失額を2で除して得られる額について、為替清算預託金総額及びFX割当剰余金をもってそれぞれFX未補填損失額の補填にあてる。

- 2 前項各号の規定により未補填損失（業務方法書第70条第5項に規定する補填し得ない損失をいう。）の補填を行った後、未補填の損失が残っている場合であって、先物・オプション割当剰余金又はFX割当剰余金の残額があるときは、当該残額を補填にあてる。
- 3 先物・オプション清算預託金総額又は為替清算預託金総額は、次項に規定する先物・オプション清算預託金預託額又は為替清算預託金預託額をすべての不履行発生日の清算参加者についてそれぞれ合計した額とする。
- 4 先物・オプション清算預託金預託額又は為替清算預託金預託額は、不履行発生日の清算参加者が先物・オプション清算預託金又は為替清算預託金として差し入れた金銭の額及び有価証券の時価評価額（不履行発生日の前日（休業日（業務方法書第3条第1項に規定する休業日をいい、同条第4項に規定する臨時休業日を含む。以下同じ。）に当たるときは、順次繰り上げる。以下同じ。）における時価（別表に規定する時価をいう。

以下この条において同じ。)により評価した額(当該有価証券がアメリカ合衆国財務省証券である場合には、その時価を不履行発生日の前日における東京外国為替市場の対顧客直物電信買相場の1米ドル当たりの円貨額により円貨に換算した額)をいう。)のそれぞれの合計額とする。

- 5 第1項の規定に基づき先物・オプション未補填損失額又はFXを補填するときは、一の不履行発生日の清算参加者は、不履行発生日において適用される先物・オプション清算預託金所要額又は為替清算預託金所要額に応じて、その預託目的に従って負担するものとする。
- 6 未補填損失のうち、先物・オプション取引に係る額を先物・オプション未補填損失額といい、取引所FX取引に係る額をFX未補填損失額という。
- 7 先物・オプション割当剰余金及びFX割当剰余金は、本所の利益剰余金相当額を前項に規定する先物・オプション未補填損失額及びFX未補填損失額に応じてあん分した額とする。

(特別負担金の徴収による損失の補填)

第16条 業務方法書第72条第2項の規定に基づき、同項の補填し得ない損失額のうち先物・オプション取引に係る損失額を不履行発生日の先物・オプション清算参加者にあん分する場合には、当該補填し得ない損失額を、不履行発生日の先物・オプション清算参加者それぞれの当該不履行発生日からさかのぼって1年間の先物・オプションに係る清算約定についての次の各号に掲げる額の合計額に応じてあん分することによるものとする。

- (1) 指数先物取引に係る取引契約金額
 - (2) 個別証券オプション取引に係る取引代金
 - (3) 指数オプション取引に係る取引代金及び権利行使により授受する金額
- 2 業務方法書第72条第2項の規定に基づき、同項の補填し得ない損失額のうち取引所FX取引に係る損失額を不履行発生日のFX清算参加者にあん分する場合には、当該補填し得ない損失額を、不履行発生日のFX清算参加者それぞれの当該不履行発生日からさかのぼって1年間の取引所FX取引に係る清算約定についての取引数量の合計に応じてあん分することによるものとする。

付 則

- 1 この取扱いは、平成15年1月14日から施行する。
- 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、それぞれ、転換社債型新株予約権付社債又は転換社債型新株予約権付社債以外の新株予約権付社債とみなして、この取扱いを適用する。

付 則

この取扱いは、平成16年2月2日から施行する。

付 則

- 1 この取扱いは、平成16年10月1日から施行する。
- 2 清算参加者は、平成16年12月30日までに、この改正規定施行の際現に本券により清算預託金及び特別清算預託金の代用

有価証券として差し入れている有価証券（改正後の別表第1項に規定する国債証券及び別表第5項各号に掲げる有価証券をいう。）の返戻を受けるものとする。

付 則

- 1 この取扱いは、本所が定める日から施行する。
- 2 この取扱い施行の日（以下「施行日」という。）の前日において日本証券業協会に登録されていた有価証券を施行日及び施行日の翌日に差し入れる場合における改正後の別表第1項の規定の適用は、施行日の前々日及び前日に日本証券業協会が公表した最終価格（午後3時現在における直近の売買価格）を各々の日における国内の証券取引所の売買立会における最終価格とみなす。

（注）「本所が定める日」は平成16年12月13日

付 則

この取扱いは、平成17年2月1日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成17年4月1日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成17年12月19日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成17年12月30日から施行する。

付 則

- 1 この取扱いは、平成18年1月10日から施行する。
- 2 清算参加者は、この取扱い施行の際、現に債券（国債証券、新株予約権付社債券及び交換社債券を除く。）を本券により本所に差し入れている場合には、平成18年6月30日までに返戻

を受けるとする。

付 則

この取扱いは、平成18年2月27日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成18年5月1日から施行する。

付 則

この取扱いは、本所が定める日から施行する。

(注)「本所が定める日」は平成18年7月24日

付 則

この取扱いは、平成19年1月4日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成19年4月1日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成19年5月21日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成19年9月18日から施行する。

付 則

この取扱いは、本所が定める日から施行する。

(注)「本所が定める日」は平成19年9月30日

付 則

この取扱いは、平成19年9月30日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成20年4月21日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成20年12月26日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成21年1月5日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成21年6月12日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成21年6月16日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成21年9月28日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成21年12月30日から施行する。

付 則

1 この取扱いは、平成23年2月14日から施行する。

2 前項の規定にかかわらず、売買システムの稼働に支障が生じたことにより、改正後の規定により売買を行うことができない又はそのおそれがあると本所が認める場合には、平成23年2月14日以後の本所が定める日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成23年2月28日から施行する。ただし、第3条及び別表第1項（注）4の改正規定は、同年1月1日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成23年4月1日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成24年1月30日から施行する。

付 則

この取扱いは、平成24年2月27日から施行する。

付 則

この取扱いは，平成25年1月1日から施行する。

付 則

この取扱いは，平成25年2月12日から施行する。

付 則

- 1 この取扱いは，平成25年3月31日から施行する。
- 2 平成25年3月31日から平成26年3月30日までの間における改正後の第6条第1項第8号bの規定の適用については，同b(a)中「4.5パーセント」とあるのは「3.5パーセント」と，同b(b)中「6パーセント」とあるのは「4.5パーセント」とする。
- 3 平成26年3月31日から平成27年3月30日までの間における改正後の第6条第1項第8号bの規定の適用については，同b(a)中「4.5パーセント」とあるのは「4パーセント」と，同b(b)中「6パーセント」とあるのは「5.5パーセント」とする。

別 表

代用有価証券の種類及びその代用価格等に関する表

- 1 業務方法書第14条第3項及び第4項に定める本所が適当と認める有価証券の種類並びに本所が定める時価及び率は以下のとおりとする。

有価証券の種類	時価	時価に乗すべき率
国債証券	日本証券業協会が 売買参考統計値を 発表するもの	(1) 国債証券(変動利付国債, 分離元本振替国債及び分離利息振替国債を除く。) <ul style="list-style-type: none"> a 残存期間1年以内のもの 100分の99 b 残存期間1年超5年以内のもの 100分の99 c 残存期間5年超10年以内のもの 100分の97 d 残存期間10年超20年以内のもの 100分の97 e 残存期間20年超30年以内のもの 100分の95 f 残存期間30年超のもの 100分の94 (2) 変動利付国債 <ul style="list-style-type: none"> a 残存期間1年以内のもの 100分の98 b 残存期間1年超5年以内のもの 100分の98 c 残存期間5年超10年以内のもの
	売買参考統計値が発表されていないもののうち国内の金融商品取引所において上場されているもの	

			<p>100分の97</p> <p>d 残存期間10年超 20年以内のもの</p> <p>100分の96</p> <p>(3) 分離元本振替国 債及び分離利息振 替国債</p> <p>a 残存期間1年以 内のもの</p> <p>100分の98</p> <p>b 残存期間1年超 5年以内のもの</p> <p>100分の98</p> <p>c 残存期間5年超 10年以内のもの</p> <p>100分の96</p> <p>d 残存期間10年超 20年以内のもの</p> <p>100分の96</p> <p>e 残存期間20年超 30年以内のもの</p> <p>100分の93</p> <p>f 残存期間30年超 のもの</p> <p>100分の90</p>
<p>政府保証 債券</p> <p>金融商品 取引法第2 条の11に 定める債 券円貨債 (注3)</p>	<p>日本証券業協会が 売買参考統計値を 発表するもの</p>	<p>当該売買参考 統計値のうち 平均値</p>	<p>(1) 残存期間1年以 内のもの</p> <p>100分の98</p> <p>(2) 残存期間1年超 5年以内のもの</p> <p>100分の98</p> <p>(3) 残存期間5年超 10年以内のもの</p> <p>100分の96</p> <p>(4) 残存期間10年超 20年以内のもの</p> <p>100分の96</p> <p>(5) 残存期間20年超 30年以内のもの</p> <p>100分の94</p> <p>(6) 残存期間30年超 のもの</p> <p>100分の93</p>
	<p>売買参考統計値が 発表されていない ものうち国内の 金融商品取引所 において上場され ているもの</p>	<p>金融商品取引 所(注1)に おける最終価 格(注2)</p>	

アメリカ合衆国財務省証券	ニューヨーク市場における前日の最終の気配相場	(1) 残存期間1年以内のもの 100分の86 (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の86 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の86 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の84 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の84 (6) 残存期間30年超のもの 100分の83	
地方債証券（注3）	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの	当該売買参考統計値のうち平均値	(1) 残存期間1年以内のもの 100分の98 (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の98 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の96 (4) 残存期間10年超20年以内のもの 100分の96 (5) 残存期間20年超30年以内のもの 100分の94 (6) 残存期間30年超のもの 100分の93
特殊債券（政府保証債券を除く。） （注4） 社債券（新株予約権付社	日本証券業協会が売買参考統計値を発表するもの	当該売買参考統計値のうち平均値	(1) 残存期間1年以内のもの 100分の97 (2) 残存期間1年超5年以内のもの 100分の97 (3) 残存期間5年超10年以内のもの 100分の95
債権付社	売買参考統計値が発表されていないもののうち国内の金融商品取引所において上場されているもの	金融商品取引所（注1）における最終価格（注2）	

債券及び交換社債券を除く。(注3)(注4)			(4) 残存期間10年超 20年以内のもの 100分の95 (5) 残存期間20年超 30年以内のもの 100分の93 (6) 残存期間30年超 のもの 100分の92
円貨建外 国債券 (金融商 品取引法 施行令第 2条の11 に定める 債券であ る円貨債 券, 転換 社債, 新 株予約権 付社債券 及び交換 社債券を 除く。) (注3) (注4)	日本証券業協会が 売買参考統計値を 発表するもの 売買参考統計値が 発表されていない もののうち国内の 金融商品取引所 において上場されて いるもの	当該売買参考 統計値のうち 平均値 金融商品取引 所(注1)に おける最終価 格(注2)	(1) 残存期間1年以 内のもの 100分の84 (2) 残存期間1年超 5年以内のもの 100分の84 (3) 残存期間5年超 10年以内のもの 100分の82 (4) 残存期間10年超 20年以内のもの 100分の82 (5) 残存期間20年超 30年以内のもの 100分の80 (6) 残存期間30年超 のもの 100分の79
公社債投 資信託の 受益証券	社団法人投資信託 協会が前日の時価 を発表するもの	当該時価	100分の85
転換社債 型新株予 約権付社 債券(注 3)(注 5) 交換社債 券(注3) (注6)	国内の金融商品取 引所に上場されて いるもの	金融商品取引 所(注1)に おける最終価 格(注2)	100分の80

株券 優先出資証券 外国株預託証券 外国投資信託の受益証券 外国投資証券 受益証券発行信託の受益証券 外国受益証券発行信託の受益証券	国内の金融商品取引所に上場されているもの	金融商品取引所（注1）における最終価格（注2）	100分の70
投資信託の受益証券（公社債投資信託の受益証券を除く。） 投資証券	国内の金融商品取引所に上場されているもの 社団法人投資信託協会が前日の時価を発表するもの	金融商品取引所（注1）における最終価格（注2） 当該時価	100分の70

- （注） 1 複数の金融商品取引所に上場している銘柄については、本所が定める順位により選択した金融商品取引所とする。
- 2 最終価格については、当該金融商品取引所において気配表示が行われている場合は当該最終気配値段をいう。
- 3 発行に際して元引受契約が金融商品取引業者により締結されたものに限る。

- 4 特殊債券（政府保証債券を除く。）、社債券（新株予約権付社債券及び交換社債券を除く。）及び円貨建外国債券（金融商品取引法施行令（昭和40年政令第321号）第2条の11に定める債券である円貨債券、転換社債型新株予約権付社債券及び交換社債券を除く。）については、適格格付機関（法第2条第36項に規定する信用格付業者及び金融商品取引業等に関する内閣府令（平成19年内閣府令第52号）第116条の3第2項に規定する特定関係法人をいう。）から取得している格付がすべてA格相当以上であること等、発行企業の信用力その他の事情を勘案して、本所が適当と認めるものに限る。
 - 5 転換社債型新株予約権付社債券については、国内の金融商品取引所にその株券が上場されている会社が発行するものに限る。
 - 6 交換社債券とは、社債券（外国法人により発行されるものを含む。）であって、それを保有する者の請求により発行者以外の特定の会社の株券により償還されるものをいう。
- 2 前項の規定における本所が定める順位は、第一順位は、本所とし、それ以降は、取引所・業界団体等コード（証券コード協議会の定めるものをいう。以下同じ。）の順序とする。ただし、国債証券にあっては、取引所・業界団体等コードの順序とする。
 - 3 代用価格の端数金額の調整は次のとおりとする。
 - (1) 株券、優先出資証券、外国株預託証券、投資信託の受益証券、外国投資信託の受益証券、投資証券、外国投資証券、受益証券発行信託の受益証券及び外国受益証券発行信託の受益証券については、円位未満の端数金額は、これを切り捨てる。
 - (2) 前号に規定する有価証券以外の有価証券については、銭位

未満の端数金額は、これを切り捨てる。

4 清算参加者が第1項に規定する国債証券を本所に預託する場合には、社債、株式等の振替に関する法律（平成13年法律第75号。以下「振替法」という。）に基づき日本銀行に開設された本所名義の口座への振替により当該預託を行うものとする。

5 清算参加者が次の各号に掲げる有価証券を本所に預託する場合には、振替法に基づき株式会社証券保管振替機構（以下「保管振替機構」という。）に開設された本所名義の口座への振替により当該預託を行うものとする。

(1) 株券、優先出資証券、外国株預託証券、投資信託の受益証券、外国投資信託の受益証券、外国投資証券、受益証券発行信託の受益証券、外国受益証券発行信託の受益証券、債券（国債証券及び新株予約権付社債券を除く。）及び転換社債型新株予約権付社債券

(2) 投資証券のうち国内の金融商品取引所に上場されているもの

6 本所は、次の各号に掲げる預託有価証券に係る保管振替機構に対する報告を預託元の清算参加者に委託し、当該委託を受けた清算参加者は保管振替機構に対し当該報告を行うものとする。この場合において、当該委託を受けた清算参加者は他の者をして当該報告を行わせることができる。

(1) 内国法人の発行する株券に係る特別株主管理事務委託状況の報告

(2) 優先出資証券に係る特別優先出資者管理事務委託状況の報告

(3) 投資証券に係る特別投資主管理事務委託状況の報告

(4) 受益証券発行信託の受益証券に係る特別受益者管理事務委託状況の報告

- 7 清算参加者が、第1項に規定するアメリカ合衆国財務省証券（以下「財務省証券」という。）を本所に預託する場合には、預託の都度、本所の同意を得るものとする。
- 8 清算参加者が、前項の規定に基づき財務省証券を預託する場合には、預託しようとする財務省証券について、当該財務省証券を保有するためにアメリカ合衆国ニューヨーク州ニューヨーク市に所在する銀行に設けられた本所名義の口座に、預託日の前日のアメリカ合衆国東部時間の午後2時までに振替を行うものとし、当該口座振替を行う日の午後4時までに、その旨を本所に通知するものとする。この場合における口座振替（同一銀行内の口座振替を除く。）は、アメリカ合衆国のFederal Reserve Communications Systemを通じて行うものとする。
- 9 清算参加者が、代用有価証券として預託している財務省証券の返戻を求める場合には、当該返戻を受けようとする日の正午までに、その旨を本所に通知するものとする。
- 10 第1項の規定にかかわらず、国内の金融商品取引所に上場されている株券（優先出資証券、外国株預託証券、投資信託の受益証券、外国投資信託の受益証券、投資証券、外国投資証券、受益証券発行信託の受益証券及び外国受益証券発行信託の受益証券を含む。以下この項において同じ。）が、その上場されている国内のすべての金融商品取引所において、当該金融商品取引所の定める上場廃止の基準に該当した場合（当該株券の発行者が株式交換若しくは株式移転により指定金融商品市場に株券が上場されている会社（以下「上場会社」という。）の完

全子会社となる場合，当該株券の発行者が上場会社に吸収合併される場合その他当該株券が上場廃止となる場合であって当該株券と引換えに交付される株券が国内の金融商品取引所に速やかに上場される見込みがあるときを除く。）には，該当した日の翌日（休業日に当たるときは，順次繰り下げる。以下同じ。）から，当該株券及び当該株券（当該外国株預託証券，投資信託の受益証券，外国投資信託の受益証券，受益証券発行信託の受益証券及び外国受益証券発行信託の受益証券を除く。）の発行者が発行する社債券を，代用有価証券から除外する。

- 11 前項の規定は，債券の発行者が当該債券の期限の利益を喪失した場合の当該債券について準用する。

別紙様式

清算受託契約書

(以下「甲」という。)及び (以下「乙」という。)は、乙の委託に基づき甲が行う有価証券等清算取次ぎに関し、次のとおり契約する。なお、本契約における用語の意義は、株式会社大阪証券取引所(以下「取引所」という。)の定款、業務規程、業務方法書その他の規則において定めるところによるものとする。

(有価証券等清算取次ぎの対象取引)

第1条 本契約において対象となる取引(以下「対象取引」という。)は、取引所の業務方法書において有価証券等清算取次ぎの対象取引として定める取引のうち次に掲げるもの(以下単に「対象取引」という。)とする。

- 指数先物取引
- 個別証券オプション取引
- 指数オプション取引
- 取引所FX取引

(本契約の対象となる取引に該当する項目にレ印をつけてください。)

2 有価証券等清算取次ぎの委託に基づく指数オプション取引の権利行使により成立する取引及び取引所の定めるところによりギブアップが成立した場合に取引所と甲との間で新たに発生した取引については、有価証券等清算取次ぎの委託に基づき成立したものとみなして、本契約(第5条を除く。)を適用す

る。

(指定清算参加者としての指定)

第2条 乙は、対象取引について、常に有価証券等清算取次ぎの委託先とする清算参加者（以下「指定清算参加者」という。）として甲を任意に指定することができるものとする。

(指定を受けた場合の未決済取引の引継ぎ)

第3条 甲は、乙が対象取引に係る指定清算参加者として甲以外の清算参加者を指定していた場合において、当該指定を甲に変更したときは、乙の対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引で未決済のもの（清算約定に係るものに限る。）を、変更前の指定清算参加者から引き継ぐものとする。

2 甲は、乙がその有する対象取引に係る清算資格を喪失した場合において、甲を対象取引に係る指定清算参加者として指定した場合には、甲は、乙の清算約定で未決済のものを引き継ぐものとする。

(指定を変更した場合等の未決済取引の引継ぎ)

第4条 甲は、乙が対象取引に係る指定清算参加者として甲を指定していた場合において、当該指定を他の清算参加者に変更したときは、乙の対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引で未決済のもの（清算約定に係るものに限る。）を、乙が新たに指定した他の清算参加者に引き継ぐものとする。

2 甲は、乙が対象取引に係る指定清算参加者として甲を指定していた場合において、乙が対象取引に係る清算資格を取得した

ときは，乙の対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく清算約定で未決済のものを乙に引き継ぐものとする。

(売買の成立等)

第5条 甲が乙から対象取引に係る指定清算参加者として指定されている場合における対象取引については，乙が甲を代理して成立させるものとする。

2 前項の場合において，対象取引に係る有価証券等清算取次ぎについては，取引所が定めるところにより対象取引に係る呼値又は申込みを行ったときに，乙から甲に対し対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託の申込みが行われ，かつ，甲は対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの受託をしたものとみなす。

(清算取次口座)

第6条 乙の対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引に係る取引証拠金（先物・オプション取引に係るもの又は取引所FX取引に係るもの），非清算参加者証拠金，FX非清算参加者証拠金，指数先物取引に係る値洗いのために授受する金銭（清算・決済規程第22条又は第23条の規定により授受する金銭をいう。），指数先物取引に係る最終決済のために授受する金銭，オプション取引（個別証券オプション取引及び指数オプション取引をいう。以下同じ。）に係る売付け又は買付けに係る取引代金，指数オプション取引の権利行使に係る決済のために授受する金銭，その他授受する有価証券及び金銭は，すべて乙が甲に設定する清算取次口座において処理するものとする。

2 前項の清算取次口座は、先物・オプション取引に係るものと、取引所 F X 取引に係るものに区別して設定するものとする。

(取引証拠金等の代用有価証券の範囲及び掛目)

第 6 条の 2 乙が取引証拠金若しくは非清算参加者証拠金の預託若しくは差入れ又は F X 非清算参加者証拠金の預託を有価証券をもって代用する場合については、甲は、取引所の規則に基づき定める範囲のうち甲が応じられる範囲において有価証券を受け入れるものとする。

2 前項の有価証券の代用価格の計算において、時価（取引所の規則に基づき決定される時価）に乗すべき率については、取引所の規則に基づき定める率とする。

(期限の利益の喪失)

第 7 条 乙について次の各号の事由のいずれかが生じた場合には、乙は、甲から通知、催告等がなくても甲に対する対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引に係る債務について当然期限の利益を失い、直ちに債務を弁済しなければならない。

(1) 支払の停止又は破産手続開始、再生手続開始、会社更生手続開始若しくは特別清算開始の申立てがあったとき。

(2) 手形交換所の取引停止処分を受けたとき。

(3) 乙の甲に対する対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引に係る債権又はその他一切の債権のいずれかについて仮差押、保全差押又は差押の命令、通知が發送されたとき。

(4) 乙の甲に対する対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引に係る債務について差し入れ又は預託している担保の目的物について差押又は競売手続の開始があったとき。

(5) 外国の法令に基づく前各号のいずれかに相当又は類する事由に該当したとき。

2 乙について次の各号の事由のいずれかが生じた場合には、乙は、甲の請求によって甲に対する対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引に係る債務の期限の利益を失い、直ちに債務の弁済をしなければならない。

(1) 乙の甲に対する対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引に係る債務について一部でも履行を遅滞したとき。

(2) 乙の甲に対する債務（対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引に係る債務を除く。）について差し入れしている担保の目的物について差押又は競売手続の開始（外国の法令に基づくこれらのいずれかに相当又は類する事由に該当した場合を含む。）があったとき。

（支払の停止があった場合等における取扱い）

第8条 乙が前条第1項各号のいずれかに該当したときは、甲は任意に、乙のすべての対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引につき、それらを決済するために必要な指数先物取引及び取引所F X取引に係る転売若しくは買戻し又はオプション取引に係る転売、買戻し若しくは権利行使（これらの委託を含む。）を、乙の計算において行うことができる。

- 2 乙が前条第2項第1号に該当したときは、甲は任意に、当該遅滞に係る対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引を決済するために必要な指数先物取引及び取引所F X取引に係る転売若しくは買戻し又はオプション取引に係る転売、買戻し若しくは権利行使（これらの委託を含む。）を、乙の計算において行うことができる。
- 3 乙が前条第2項各号のいずれかに該当したときは、甲の請求により、乙は甲の指定する日時までに、乙のすべての対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引を決済するために必要な指数先物取引及び取引所F X取引に係る転売若しくは買戻しに係る有価証券等清算取次ぎの委託又はオプション取引に係る転売若しくは買戻しに係る有価証券等清算取次ぎの委託又は権利行使の申告を行うものとする。
- 4 乙が前項の日時までに指数先物取引及び取引所F X取引に係る転売若しくは買戻しに係る有価証券等清算取次ぎの委託又はオプション取引に係る転売若しくは買戻しに係る有価証券等清算取次ぎの委託又は権利行使の申告を行わないときは、甲は任意に、乙の計算において対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引を決済するために必要な指数先物取引及び取引所F X取引に係る転売若しくは買戻し又はオプション取引に係る転売、買戻し若しくは権利行使（これらの委託を含む。）を行うことができる。
- 5 前各項の規定にかかわらず、乙が取引所より先物取引等取引資格又はF X取引資格の取消し又は対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託の停止の処分、処置又は措置を受けたときは、甲及び乙は、取引所の取引参加者規程その他の規則の定め

るところに従うものとする。

- 6 第1項から第4項までの規定に基づき指数先物取引及び取引所FX取引に係る転売若しくは買戻し又はオプション取引に係る転売，買戻し若しくは権利行使（これらの委託を含む。）を行った結果又は前項の規定に基づき取引所の取引参加者規程その他の規則の定めるところに従い指数先物取引及び取引所FX取引に係る転売若しくは買戻し又はオプション取引に係る転売，買戻し若しくは権利行使（これらの委託を含む。）を行った結果，甲に損失が生じた場合には，乙は，甲に対してその額に相当する金銭を直ちに支払うものとする。

（甲にポジション保有状況の改善指示が行われた場合における対象取引の転売又は買戻し等）

- 第8条の2 甲が取引所の業務方法書第28条第4項に基づくポジション保有状況の改善指示（以下この条において「改善指示」という。）を受けた場合であって，乙の甲に対する対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引が当該指示の事由と密接な関係を有している場合には，甲は，乙に対し，乙の有価証券等清算取次ぎの委託に基づく清算約定で未決済のもの決済又は他の清算参加者への引継ぎを要請することができる。ただし，当該要請は，乙の有価証券等清算取次ぎの委託に基づく対象取引に係る取引証拠金について業務方法書第28条第3項第1号に規定する措置が実施されたにもかかわらず，乙が正当な理由なくこれに従わないことによって甲が改善指示を受けたときに限り行うことができるものとする。

- 2 前項の場合，甲は，合理的に必要と認められる範囲内におい

て、当該乙の甲に対する対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引を決済するために、乙の計算において、転売又は買戻し等（指数先物取引及び取引所 F X 取引に係る転売若しくは買戻し又はオプション取引に係る転売、買戻し若しくは権利行使（これらの委託を含む。）を総称していう。以下この条において同じ。）を行うことができる。ただし、かかる転売又は買戻し等は、甲が、他の方法により当該改善指示に適合するべく合理的な努力を行ってもなお当該改善指示に適合できないときで、かつ、乙に対して、あらかじめ、合理的な猶予期間を定めて前項の要請を行ったにもかかわらず、乙がこれらを正当な理由なく行わなかったときに限り行うことができるものとする。

- 3 甲が前項の規定に基づき同項の転売又は買戻し等を行った結果、乙が損害を被った場合であっても、乙は、甲及び取引所に対してその損害の賠償を請求しないものとする。ただし、甲又は取引所に故意又は重大なる過失がある場合にあっては、当該故意又は重大なる過失がある者に対する請求はこの限りではない。

（差引計算）

第 9 条 期限の到来、期限の利益の喪失その他の事由によって、乙が甲に対する対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引に係る債務を履行しなければならない場合には、当該債務と乙の甲に対する対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引に係る債権その他一切の債権とを、その債権の期限のいかんにかかわらず、甲は、いつでも相殺する

ことができる。

- 2 前項の相殺ができる場合には，甲は事前の通知及び所定の手続を省略し，乙に代わり諸預け金の払戻しを受け，債務の弁済に充当することもできる。
- 3 前2項によって差引計算をする場合，債権債務の利息，損害金等の計算については，その期間を計算実行の日までとし，債権債務の利率及び甲に対する債務の遅延損害金の率については甲の定める率によるものとする。

(代用有価証券の処分)

第10条 乙が甲に対する対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引に係る債務を所定の時限までに履行しないときは，甲は，通知，催告を行わず，かつ法律上の手続によらないで，対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引に係る債務の履行を確保するために乙が先物・オプション取引に係る取引証拠金若しくは非清算参加者証拠金として差し入れ若しくは預託している有価証券又はFX非清算参加者証拠金として預託している有価証券を，乙の計算において，その方法，時期，場所，価格等につき甲の任意で処分し，その取得金から諸費用を差し引いた残額を法定の順序にかかわらず債務の弁済に充当できるものとし，また当該弁済充当を行った結果，残債務がある場合は乙は直ちに弁済を行うものとする。

(占有物の処分)

第11条 乙が甲に対する対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引に係る債務を所定の時限までに履行しない

ときは、甲は、占有している乙の動産及び占有し、又は社債、株式等の振替に関する法律（平成13年法律第75号）に基づき甲の口座に記録している乙の有価証券等を処分できるものとし、この場合甲はすべて前条に準じて取り扱うものとする。

（弁済等充当の順序）

第12条 債務の弁済又は第9条の差引計算を行う場合、乙の甲に対する対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引に係る債務の全額を消滅させるに足りないときは、甲は、甲が適当と認める順序方法により充当することができるものとする。

（遅延損害金の支払）

第13条 乙が対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引に関し甲に対する債務の履行を怠ったときは、乙は、甲の請求により、甲に対し履行期日の翌日より履行の日まで、甲の定める率による遅延損害金を支払うものとする。

（債権譲渡等の禁止）

第14条 乙は、甲に対して有する対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引に係る債権を他に譲渡又は質入れをしてはならない。

（本契約の解約）

第15条 本契約は、甲乙協議のうえ、合意により本契約を解約することができる。

- 2 前項の規定によるほか，甲又は乙は，解約を希望する日から○か月以上前に，相手方に対し書面により解約の意思を申し出ることにより，本契約を解約することができる。
- 3 前2項の規定によるほか，甲は，乙が第7条第1項各号又は第2項各号のいずれかに該当する場合は，本契約の解約ができる。
- 4 前3項の規定により本契約を解約しようとする場合には，甲は，取引所に対しあらかじめ届出を行うものとする。この場合，第1項による解約の場合は解約しようとする日の3日前（休業日（業務方法書第3条第1項に規定する休業日をいい，同条第4項に規定する臨時休業日を含む。以下同じ。）を除外する。）までの日，第2項による解約の場合は甲が相手方に対し書面により解約の意思を申し出た又は申し出を受けた後遅滞なく，前項による解約の場合は解約しようとする日の前日（休業日に当たるときは，順次繰り上げる。）までに当該届出を行うものとする。
- 5 本契約の解約までに成立した対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引（第8条第1項から第4項までの規定に基づき指数先物取引及び取引所FX取引に係る転売若しくは買戻し又はオプション取引に係る転売，買戻し若しくは権利行使（これらの委託を含む。）を行う場合及び同条第5項の規定に基づき取引所の取引参加者規程その他の規則の定めるところに従い指数先物取引及び取引所FX取引に係る転売若しくは買戻し又はオプション取引に係る転売，買戻し若しくは権利行使（これらの委託を含む。）を行う場合を含む。）に関しては，引き続き本契約を適用する。

- 6 第1項から第3項までの規定にかかわらず，甲が第4項に定める届出を行わなかった場合には，本契約の解約は，その効力を生じない。

(特例解約)

第15条の2 前条の規定にかかわらず，本契約は，対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引に係る債務の履行の確実性の観点から本契約を解約することができる条件をあらかじめ甲と乙の合意により定めている場合において，乙が当該条件に該当したときは，甲は解約を希望する日の前日（休業日に当たるときは，順次繰り上げる。）までに乙に対し書面により解約の意思を申し出ることにより，解約することができる。

- 2 前項の規定による本契約の解約（以下「特例解約」という。）をしようとする場合には，甲は，相手方に対し書面により特例解約の意思を申し出た後直ちに，かつ，特例解約を行おうとする日の前日（休業日に当たるときは，順次繰り上げる。）までに，取引所に対し届出を行うものとする。
- 3 特例解約までに成立した対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引（当該取引に係る転売，買戻し又は権利行使を含む。）に関しては，引き続き本契約を適用する。
- 4 前項のほか，決済履行確保の観点から取引所が特に必要と認める取引については，引き続き本契約を適用する。
- 5 第1項の規定にかかわらず，甲が第2項に定める届出を行わなかった場合には，特例解約は，その効力を生じない。

(報告)

第16条 乙は、甲が請求したときは、対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引に関して必要な事項を甲に対して遅滞なく報告しなければならない。

2 乙は、第7条第1項各号又は第2項各号のいずれかの事由が生じたとき、又は、取引所より先物取引等取引資格若しくはFX取引資格の取消し又は対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託の停止の処分、処置又は措置（本契約に基づく対象取引に係る有価証券等清算取次ぎに係るものに限る。）を受けたときは、甲に対し直ちに書面をもってその旨の報告をしなければならない。

(乙の義務)

第17条 乙は、次の各号に掲げる事項について甲に対し通知するものとする。

(1) 乙又は乙の顧客が対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引に関し甲に差し入れ又は預託する証拠金について、差換預託の同意がある場合はその旨

(2) 乙が先物・オプション取引に係る転売又は買戻しの申告を取引所に行ったときは、その旨

(3) 乙が取引所FX取引に係る建玉の申告を取引所に行ったときは、その旨

(4) オプション取引について、乙が権利行使の申告を取引所に行ったとき又は権利行使の割当の通知を取引所から受けたときは、その旨

(5) 乙が建玉の移管を行ったときは、その旨

2 乙が，取引所の定めるところにより，甲に先物・オプション取引又は取引所 F X 取引に係る取引証拠金の差入れ又は預託を行うときは，次の各号のいずれに該当するか，甲に明示するものとする。

(1) 非清算参加者自己分の取引証拠金

(2) 非清算参加者委託分の取引証拠金（直接預託分）

(3) 非清算参加者委託分の取引証拠金（取次者差換預託分）

(4) 非清算参加者委託分の取引証拠金（差換預託分）

3 乙は，毎日，甲に対し，先物・オプション取引又は取引所 F X 取引に係る取引証拠金について，非清算参加者自己分の取引証拠金所要額及び非清算参加者委託分の取引証拠金所要額の合計額を，甲が指定する時限までに甲に通知するものとする。

4 取引所取引許可業者である乙が，取引所の定めるところにより，甲に指数先物取引に係る転売若しくは買戻し又はオプション取引に係る転売，買戻し若しくは権利行使の申告を行うときは，甲が指定する時限までに，次の各号に掲げる申告の区分に従い，当該各号に規定する事項を，顧客の委託に基づくものと自己の計算によるものとに区分して行うものとする。

(1) 指数先物取引に係る転売又は買戻しの申告

各限月取引ごとの転売又は買戻しの別及び数量

(2) オプション取引に係る転売又は買戻しの申告

各銘柄ごとの転売又は買戻しの別及び数量

(3) オプション取引に係る権利行使の申告

各銘柄ごとの権利行使に係る数量

(秘密保持)

第18条 甲及び乙は，本契約に関して業務上知り得た相手方の業務上の秘密を保持するものとし，他の目的のために利用してはならない。また，取引所の調査に応じる場合その他の正当な理由がある場合を除き，第三者に漏らしてはならない。

(届出事項の変更届出)

第19条 乙は，商号若しくは名称，代表者，甲に届け出た印章若しくは署名鑑又は住所若しくは事務所の所在地その他の事項に変更があったときは，甲に対し直ちに書面をもってその旨届け出なければならない。

(免責事項)

第20条 天災地変等の不可抗力により，乙の請求に係る担保物の返還が遅延した場合に生じた損害については，甲はその責を負わないものとする。

2 前項の事由による担保物の紛失，滅失，き損等の損害についても甲はその責を負わないものとする。

3 甲が，諸届その他の書類に使用された印影又は署名を届出の印鑑又は署名鑑と相当の注意をもって照合し，相違ないものと認めて取り扱ったうえは，それらの書類につき偽造，変造その他の事故があっても，そのために生じた損害については甲はその責を負わないものとする。

(通知の効力)

第21条 乙が甲に届け出た住所又は事務所にあて，甲によりなされた対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取

引に関する諸通知が乙の責に帰すべき事由により延着し，又は到達しなかった場合においては，通常到達すべき時に到達したものとす。

(電磁的方法による報告等)

第22条 乙は，第16条第2項の規定による書面による報告又は第19条の規定による書面（印章又は署名鑑の変更に係るものを除く。）による届出に代えて，甲の承諾を得た場合には，当該報告又は届出を行うための書面に記載すべき事項を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により提供することができる。この場合において，乙は，書面により当該報告又は届出を行ったものとみなす。

(適用法)

第23条 本契約は，日本国の法律により支配され，解釈されるものとする。

(合意管轄)

第24条 本契約に基づく対象取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引に関する訴訟については，甲の本店又は〇〇支店の所在地を管轄する裁判所を管轄裁判所とする。

この契約を証するため，本契約書2通を作成し，記名捺印のうち甲乙それぞれその1通を所持する。

平成 年 月 日

住 所

(甲) 清算参加者 商号又は名称

代表者 印

住 所

(乙) 非清算参加者 商号又は名称

代表 印

(注1) 第1条において本契約の対象に取引所F X取引を含めないこととした場合は、本契約中の取引所F X取引に係る事項については適用されないこととし、第1条において本契約の対象を取引所F X取引に限ることとした場合は、本契約中の先物・オプション取引に係る事項については適用されないこととする。

(注2) 第15条第2項中「○か月」の部分については、甲と乙の合意により、1か月以上の月数を記入するものとする。

(注3) 第15条の2については、同条第1項に規定する債務の履行の確実性の観点から本契約を解約することができる条件を甲と乙との間であらかじめ定めない場合は、本契約から削除することができる。

(注4) 第17条第1項第2号及び第3号については、乙が取引所取引許可業者である場合は、本契約から削除することができる。

(注5) 第17条第4項については、乙が取引所取引許可業者以外の者である場合は、本契約から削除することができる。

(注6) 第24条の合意管轄については、甲と乙との合意により、適当と認める修正を行うことができる。

(内国法人用)

清算参加者契約書

平成 年 月 日

株式会社大阪証券取引所

代表取締役社長 殿

所在地 _____

商号又は名称 _____

代表者名 _____ 印

(署名) _____

_____ (以下「会社」という。)は、株式会社大阪証券取引所 (以下「貴所」という。)の清算参加者 (清算参加者の種類名)として、次の事項を承諾します。

- 1 貴所が現に制定している及び将来制定又は改正することのある業務方法書その他の規則 (以下「規則」という。)に従い、また、これを遵守すること。
- 2 規則に基づいて貴所が行う、清算資格の取消し、債務の引受けの停止その他の措置に従うこと。
- 3 会社が清算資格を喪失する場合は、その喪失について会社が一切の責任を負い、貴所、他の清算参加者、会社を指定清算参加者とする非清算参加者及び顧客に対し、一切迷惑をかけないこと。
- 4 貴所からこの契約の内容の変更について通知された場合で、会社が所定の期日までに異議の申出をしないときは、その変更に同意したものとすること。
- 5 会社と貴所との間の一切の訴訟については、大阪地方裁判所のみ

をその管轄裁判所とすること。

以 上

付 則

この契約書は、平成 21 年 6 月 16 日から施行する。

付 則

この契約書は、平成 25 年 1 月 1 日から施行する。

(外国法人用)

清算参加者契約書

平成 年 月 日

株式会社大阪証券取引所
代表取締役社長 殿

所在地 _____
商号又は名称 _____
代表者名 _____ 印
(署名) _____

_____ (以下「会社」という。)は、株式会社大阪証券取引所
(以下「貴所」という。)の清算参加者(清算参加者の種類名)
として、次の事項を承諾します。

- 1 貴所が現に制定している及び将来制定又は改正することのある業務方法書その他の規則(以下「規則」という。)に従い、また、これを遵守すること。
- 2 規則に基づいて貴所が行う、清算資格の取消し、債務の引受けの停止その他の措置に従うこと。
- 3 会社が清算資格を喪失する場合は、その喪失について会社が一切の責任を負い、貴所、他の清算参加者、会社を指定清算参加者とする非清算参加者及び顧客に対し、一切迷惑をかけないこと。
- 4 貴所からこの契約の内容の変更について通知された場合で、会社が所定の期日までに異議の申出をしないときは、その変更

に同意したものとすること。

- 5 会社と貴所との間の諸通知（授受する書類を含む。）は日本語で作成し，金額の表示については本邦通貨で表示したものにより行うこと。
- 6 会社と貴所との間の一切の訴訟については，大阪地方裁判所のみをその管轄裁判所とすること。

以 上

付 則

この契約書は，平成 21 年 6 月 16 日から施行する。

付 則

この契約書は，平成 25 年 1 月 1 日から施行する。

清算預託金所要額に関する規則

(目的)

第1条 この規則は、業務方法書第14条第2項の規定に基づき、清算預託金所要額を定める。

(清算預託金所要額)

第2条 各清算参加者の清算預託金所要額は、業務方法書第14条第1項各号に規定する清算預託金の区分ごとに別表「清算預託金所要額算出に関する表」により算出した額の合計額によるものとする。

2 各清算参加者の清算預託金所要額は、本所が当月の末日を清算預託金所要額算出基準日として算出し、清算預託金所要額算出基準日の翌日（休業日（業務方法書第3条第1項に規定する休業日をいい、同条第4項に規定する臨時休業日を含む。以下同じ。））に当たるときは、順次繰り下げる。以下この条において同じ。）に各清算参加者に通知する。

3 前項の規定により算出した各清算参加者の清算預託金所要額は、清算預託金所要額算出基準日の翌日から起算して6日目（休業日を除外する。）の日から適用する。

(清算預託金所要額の臨時変更)

第3条 前条の規定にかかわらず、本所の債務引受額が著しく変化した場合、当該清算参加者が合併する場合、当該清算参加者が新たに非清算参加者の指定清算参加者となる場合その他本

所の金融商品債務引受業の適正かつ確実な運営にかんがみて必要と認める場合は，全部又は一部の清算参加者の清算預託金所要額を臨時に変更することができる。

(新たに清算資格を取得した者に係る清算預託金所要額に関する特則)

第4条 前2条の規定にかかわらず，新たに清算資格を取得した者が預託すべき各清算資格に係る清算預託金所要額は，当該清算資格を取得した者の会社の規模，その取引実績及び見込み，清算資格の取得の申請を行った日において各清算参加者の当該取得した清算資格に係る清算預託金所要額を合計した額を当該清算参加者数で除して得た金額等を勘案のうえ，本所が定める額を本所が必要と認める期間適用することができる。

付 則

この規則は，平成15年1月14日から施行する。

付 則

この規則は，平成19年4月1日から施行する。

付 則

この規則は，平成19年9月18日から施行する。

付 則

この規則は，平成19年9月30日から施行する。

付 則

1 この規則は，平成21年6月16日から施行する。

2 この改正規則別表2（注3）の規定にかかわらず，取引開

始前の期間において各金融指標に係る清算数値が存在しない間は、外国為替のインターバンク市場におけるニューヨーク時間の終値を採用することとする。ただし、欧州経済通貨統合参加国通貨導入前の期間については、欧州通貨単位を用いる。

付 則

この規則は、平成23年11月1日から施行する。

付 則

この規則は、平成24年2月27日から施行する。

付 則

この規則は、平成25年1月1日から施行する。

別 表

清算預託金所要額算出に関する表

1 先物・オプション清算預託金

各先物・オプション清算参加者の先物・オプション清算預託金所要額は、次の算式により算出された額とする。ただし、その額が100万円の整数倍でないときは、その額を超える100万円の整数倍である金額のうち最も少ない金額を先物・オプション清算預託金所要額とする。

(算式)

$$A \times B \div C$$

(上式における記号の意味)

A 清算預託金所要額算出基準日からさかのぼって6か月間（以下この1において「算出対象期間」という。）の毎取引日（指数先物特例第2条第6号に規定する取引日又は指数オプション特例第3条第6号に規定する取引日をいう。）以下この1において同じ。）の想定最大損失額のうち最も大きい額

(注1) 想定最大損失額とは、算出対象期間における毎取引日（以下この1において「計算日」という。）の想定損失額の額が大きい先物・オプション清算参加者上位2者の当該額を合計した額をいう。

(注2) 想定損失額とは、想定最大価格変動が生じた場合における当該先物・オプション清算参加者の評価損失相当額（本所が定めるところにより本所が算出した評価損失相当額）か

ら先物・オプション取引に係る取引証拠金預託額等を差し引いて得た額をいう。

(注3) 想定最大価格変動とは、昭和60年1月4日から想定損失額の計算日までの毎日の前々日比変動率（当日の最終の日経平均株価と前々日の最終の日経平均株価との差を前々日の最終の日経平均株価で除して得た数値をいう。以下同じ。）の標準偏差（当日を含む過去120日間の前々日比変動率に基づき算出した標準偏差）に3を乗じて得た数値（小数点第4位未満の端数が生じたときは、これを四捨五入する。）のうち最大の数値を、想定損失額の計算日における最終の日経平均株価で乗じて得た数値をいう。ただし、先物・オプション取引のうち日経平均株価に係る清算対象取引以外の清算対象取引に係る想定損失額を算出する場合には、当該清算対象取引に係る株価指数等の過去の変動状況と日経平均株価の過去の変動状況とを統計的に比較すること等により所要の調整を行う。

(注4) 先物・オプション取引に係る取引証拠金預託額等とは、当該先物・オプション清算参加者が想定最大損失額の計算日に先物・オプション取引に係る自己分の取引証拠金として本所に預託している金銭の額及び有価証券を代用価格（想定最大損失額の計算日の前日（休業日に当たるときは、順次繰り上げる。以下この1において同じ。）における時価（国内の金融商品取引所に上場されている有価証券（債券を除く。）については、当該計算日における時価）に先物・オプション取引に係る証拠金及び未決済約定の引継ぎ等に関する規則（以下「証拠金規則」という。）別表第2項に定める率を乗じた額（当該有価証券がアメリカ合衆国財務省証券である場合

は、その時価に同項に定める率を乗じた額を想定最大損失額の計算日の前日における東京外国為替市場の対顧客直物電信買相場の1米ドル当たりの円貨額により円貨に換算した額)をいう。)により評価した額並びに計算日の前日に先物・オプション取引に係る委託分及び有価証券等清算取次ぎ分の取引証拠金所要額として本所に申告した額の合計額をいう。

- B 当該先物・オプション清算参加者について、清算預託金所要額算出基準日の属する月の毎日(指数先物取引又は指数オプション取引にあっては、毎取引日)の取引証拠金所要額(証拠金規則第17条第1項の規定により本所が当該先物・オプション清算参加者に通知した先物・オプション取引に係る自己分の取引証拠金所要額及び同条第2項の規定により先物・オプション清算参加者が本所に申告した額の合計額をいう。)を合計した額
- C すべての先物・オプション清算参加者について、Bにより算出した額を合計した額

2 為替清算預託金

各FX清算参加者の為替清算預託金所要額は、次の算式により算出された額とする。ただし、その額が100万円の整数倍でないときは、その額を超える100万円の整数倍である金額のうち最も少ない金額を為替清算預託金所要額とする。

(算式)

$$D \times E \div F$$

(上式における記号の意味)

- D 清算預託金所要額算出基準日に開始する取引日(取引所FX取引特例第2条第15号に規定する取引日をいう。以下この2において同じ。)からさかのぼって6か月間(以下この2におい

て「算出対象期間」という。)の毎取引日の想定最大損失額のうち最も大きい額

(注1) 想定最大損失額とは、算出対象期間における毎取引日(以下この2において「計算日」という。)における想定損失額の99.74%をカバーすることができる最も小さい額とする。

(注2) 想定損失額とは、想定価格変動が生じた場合における各FX清算参加者の評価損失相当額(計算日における当該FX清算参加者が保有する建玉から生じる差金(業務方法書第63条の4、第63条の5及び第63条の7に規定する金銭をいう。)の合計のうち支払金額をいう。)から取引所FX取引に係る取引証拠金預託額等を差し引いて得た額が大きいFX清算参加者上位2者の当該額を合計した額をいう。

(注3) 想定価格変動とは、計算日の各金融指標に係る清算数値に、計算日から起算して過去20年間の毎取引日の各金融指標に係る3日間変動率(当日の各金融指標に係る清算数値と3取引日前の各金融指標に係る清算数値との差を3取引日前の金融指標に係る清算数値で除した数値をいう。)をそれぞれ乗じて得られる各金融指標に係る数値をいう。

(注4) 取引所FX取引に係る取引証拠金預託額等とは、当該FX清算参加者が想定最大損失額の計算日に取引所FX取引に係る自己分の取引証拠金として本所に預託している金銭の額並びに計算日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。)に取引所FX取引に係る委託分及び有価証券等清算取次ぎ分の取引証拠金所要額として本所に申告した額の合計額をいう。

E 当該FX清算参加者について、清算預託金所要額算出基準日の属する月の毎取引日に適用された取引証拠金所要額(FX清

算参加者が本所に申告した取引所 F X 取引に係る自己分並びに委託分及び有価証券等清算取次ぎ分の取引証拠金所要額の合計額をいう。) を合計した額

F すべての F X 清算参加者について、E により算出した額を合計した額

清算参加者料金等に関する規則

(目 的)

第1条 この規則は、業務方法書第7条第3項及び第13条の規定に基づき、清算参加者参加金及び清算参加者料金の額に関し必要な事項を規定する。

(清算参加者参加金の額)

第2条 業務方法書第7条第3項に規定する清算参加者参加金の額は、次の各号に掲げる清算資格の取得の区分に従い、当該各号に定める金額とする。

(1) F X清算資格を有しない先物取引等取引参加者が先物・オプション清算資格を取得する場合 1,000万円

(2) F X清算資格を有する先物取引等取引参加者が先物・オプション清算資格を取得する場合 800万円

(3) 前2号の場合を除き、先物・オプション清算資格を取得する場合
a 先物取引等取引資格（取引参加者規程第2条第3項に規定する先物取引等取引資格をいう。）を同時に取得する場合 1,000万円

b 前a以外の場合 2,000万円

(4) 前3号の場合を除き、F X清算資格を取得する場合 200万円

2 前項の規定にかかわらず、次の各号に掲げる場合は、F X清算資格に係る清算参加者参加金を必要としない。

(1) 先物・オプション清算参加者がF X清算資格を取得する場合又は先物・オプション清算資格及びF X清算資格を同時に取得する場合

(2) F X清算資格及びF X取引資格を取得する場合であって、同時に取引所外国為替証拠金取引に関する業務規程及び受託契約準則の特例（以下「取引所F X取引特例」という。）第21条第1項の規定に基

づき本所がマーケットメイカー（取引所F X取引特例第2条第6号に規定するマーケットメイカーをいう。以下同じ。）に指定する場合

（清算参加者料金）

第3条 業務方法書第13条に規定する清算参加者料金は、基本料及び清算手数料とする。

2 基本料の額（月額）は、次の各号に掲げる清算参加者の区分に従い、当該各号に定める額とする。

- | | |
|--------------------------------|------|
| (1) 先物取引等取引資格を有する先物・オプション清算参加者 | 12万円 |
| (2) 前号以外の先物・オプション清算参加者 | 18万円 |
| (3) F X清算参加者 | 2万円 |

3 清算手数料の額は、当該清算参加者を当事者とする次の各号に掲げる清算対象取引に区分して、当該各号に定める取引数量又は取引代金等（以下「清算手数料の算出の基準」という。）に清算手数料率を乗じて算出した額の総額とし、第1号及び第4号に掲げる清算対象取引に係る清算手数料率並びに第2号及び第3号に掲げる清算対象取引に係る清算手数料の算出の基準及び清算手数料率は、当該清算対象取引の対象ごとに、別表に定めるとおりとする。

- | | |
|----------------------------|---------------------|
| (1) 指数先物取引 | 取引数量 |
| (2) 個別証券オプション取引 | |
| 取引代金及び権利行使により成立する有価証券の売買代金 | |
| (3) 指数オプション取引 | 取引代金及び権利行使により授受する金額 |
| (4) 取引所F X取引 | 取引数量 |

4 基本料及び清算手数料の本所への納入の日は、毎月の20日（休業日（業務方法書第3条第1項に規定する休業日をいい、同条第4項に規定する臨時休業日を含む。）に当たるときは、順次繰り下げる。）とする。

(清算手数料率の変更等)

第4条 前条の規定にかかわらず、本所は、市場の活性化のために必要があると認める場合は、本所が別に定めるところにより、一定の期間において、清算手数料率の変更又は割戻しを行うことができる。この場合において、あらかじめその旨を清算参加者に通知する。

付 則

この規則は、平成17年4月1日から施行する。

付 則

- 1 この規則は、平成17年4月25日（次項において「施行日」という。）から施行する。
- 2 業務方法書平成17年4月1日改正付則第2項及びこの改正規則2(1)の規定にかかわらず、RNP指数に係る清算対象取引については、施行日から平成18年3月末日までの当該清算対象取引に係る清算手数料を清算参加者料金の徴収の対象としないものとする。

付 則

この規則は、平成17年8月1日から施行する。

付 則

この規則は、平成17年12月19日から施行する。

付 則

この規則は、平成19年5月21日から施行する。

付 則

この規則は、平成19年9月18日から施行する。

付 則

この規則は、平成20年4月21日から施行する。

付 則

1 この規則は、平成21年6月16日（次項において「施行日」という。）から施行する。

2 この改正規則2(4)の規定にかかわらず、取引所FX取引特例第21条第1項の規定による指定を受けたFX取引参加者については、マーケットメイカーとしての業務に係る呼値に基づき行った取引（施行日から平成22年7月31日までの間に終了する取引日に成立したものに限り。）に係る清算手数料を清算参加者料金の徴収の対象としないものとする。

付 則

この規則は、平成22年6月1日から施行する。

付 則

1 この規則は、平成23年2月14日から施行する。

2 前項の規定にかかわらず、売買システムの稼働に支障が生じたことにより、改正後の規定により売買を行うことができない又はそのおそれがあると本所が認める場合には、平成23年2月14日以後の本所が定める日から施行する。

付 則

この規則は、平成24年2月27日から施行する。

付 則

この規則は、平成25年1月1日から施行する。

別表

清算手数料の算出の基準及び清算手数料率

清算手数料の算出の基準及び清算手数料率は、次のとおりとする。

清算対象取引の区分		算出の基準	清算手数料率
指数先物取引(Mini取引を除く。)	日経300	取引数量	本所が引き受けた債務について1取引単位につき 4円 最終決済に係る数量について1取引単位につき 26円
	日経平均	取引数量	本所が引き受けた債務について1取引単位につき 20円 最終決済に係る数量について1取引単位につき 130円
	RNP指数, 業種別指数及びMSCI JAPAN	取引数量	本所が引き受けた債務について1取引単位につき 16円 最終決済に係る数量について1取引単位につき 45円
	NYダウ	取引数量	本所が引き受けた債務について1取引単位につき 5円 最終決済に係る数量について1取引単位につき 45円
	日経平均V1	取引数量	本所が引き受けた債務について1取引単位につき 20円 最終決済に係る数量について1取引単位につき 100円
指数先物取引(Mini取引に限る。)	日経平均	取引数量	本所が引き受けた債務について1取引単位につき 2円 最終決済に係る数量について1取引単位につき 13円

個別証券オプション取引	個別証券オプション	取引代金	本所が引き受けた債務について取引代金の 万分の0.5 権利行使により成立するオプション対象証券の売付け又は買付けに係る売買代金の合計額の 万分の0.015
指数オプション取引	日経300オプション	取引代金	本所が引き受けた債務について取引代金の 万分の0.5 権利行使及び権利行使の割当てにより授受する金額の合計額の 万分の5.5
	日経平均オプション	取引代金	本所が引き受けた債務について取引代金の 万分の0.5 権利行使及び権利行使の割当てにより授受する金額の合計額の 万分の5.5
	業種別指数オプション	取引代金	本所が引き受けた債務について取引代金の 万分の0.5 権利行使及び権利行使の割当てにより授受する金額の合計額の 万分の5.5
取引所FX取引	対円金融指標及び非対円金融指標	取引数量	本所が引き受けた債務について1取引単位につき 15円

(注1) 用語の意義は、業務規程(特例を含む。)において定めるところによる。

(注2) 取引所FX取引を除く市場デリバティブ取引に係る総取引数量又は取引代金の合計額は、各月の1日(休業日(業務方法書第3条第1項に規定する休業日をいい、同条第4項に規定する臨時休業日を含む。この(注2)において同じ。))に当たるときは、順次繰り下げる。)に終了する取引日から当該月の末日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。)に終了する取引日までの総取引数量又は取引代金の合計額

をいう。

(注3) ギブアップが成立した場合は、清算執行取引参加者（当該清算執行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）である清算参加者が当該ギブアップの対象の市場デリバティブ取引に係る清算手数料を納入するものとする。

(注4) 日経平均オプション取引において、本所が引き受けた債務に係る売付け若しくは買付けごとの1取引単位当たりの清算手数料が35円を超える場合は35円とし、権利行使若しくは権利行使の割当てごとの1取引単位当たりの清算手数料が385円を超える場合は385円とする。

(注5) 取引所FX取引における取引数量は、各月の1日（休業日（業務方法書第3条第2項及び第3項に規定する休業日をいい、同条第4項に規定する臨時休業日を含む。この(注5)において同じ。）に当たるときは、順次繰り下げる。）に開始する取引日から当該月の末日（休業日に当たるときは、順次繰り上げる。）に開始する取引日までの取引数量をいう。

清算参加者に対する検査に関する規則

(目的)

第1条 この規則は、業務方法書第20条、第27条の3及び第28条の規定に基づき、本所が行う清算参加者の検査及びその結果に基づく措置に関し、必要な事項を定める。

2 前項の検査は、清算参加者の本所の業務方法書その他諸規則若しくはこれらに基づく処分又は取引の信義則（以下「業務方法書等」という。）の遵守の状況及び業務又は財産の状況及び清算参加者の本所に対する債務の履行の确实性並びに清算参加者の指数先物取引、個別証券オプション取引、指数オプション取引及び取引所FX取引に係る業務の状況を調査し、当該調査の結果に基づき必要な措置を講じることによって、本所による金融商品債務引受業をより确实ならしめるものとするを目的とする。

(検査員)

第2条 検査は、本所の職員のうちから取締役社長が任命した者（以下「検査員」という。）が行う。ただし、取締役社長が必要があると認めるときは、補助員を使用することができる。

(検査員の権限)

第3条 検査員は、清算参加者の役員又は従業員に対し、第1条第2項に規定する調査を行うため必要があると認める帳簿、書類その他の物件の提示若しくは閲覧、資料の提出又は事実の説明及び当該説明の内容を記載した文書の作成を要求することができる。

(検査員の義務)

第4条 検査員は、次の各号に掲げる事項を遵守しなければならない。

- (1) 検査は、すべて事実に基づいて行わなければならない。
- (2) 事実の認定、処理の判断及び意見の表明を行うに当たっては、常に公正な態度を保持しなければならない。
- (3) 職務上知り得た秘密を、正当な理由なくして他に漏らしてはならない。

(清算参加者の義務)

第5条 清算参加者の役員及び従業員は、検査員から第3条に規定する要求があった場合には、正当な理由なくこれを拒否することができない。

(検査の実施方法及び時期)

第6条 検査は、清算参加者の本店その他の営業所（以下「店舗」という。）において行う。ただし、本所が当該店舗において行う必要がないと認めるときは、当該清算参加者が本所に提出する書類により行うことができる。

2 本所は、必要があると認めるときはいつでも清算参加者に対して前項の検査を行うことができる。

(検査の通知)

第7条 本所は、前条に規定する検査を行う場合は、当該清算参加者に対して、検査の開始日時、方法及び検査員の氏名その他必要な事項を通知する。ただし、本所がその必要がないと認めるときは、この限りでない。

(検査員証明書の提示)

第8条 検査員は、検査業務開始に当たり、清算参加者に検査員証明書を提示するものとする。

(検査の報告)

第9条 検査員は、検査を終了したときは、速やかに検査報告書を取締役社長に提出しなければならない。

(注意の喚起等)

第10条 本所は、検査の結果、清算参加者の行為が業務方法書等に違反している又は違反しているおそれがあると認める場合には、業務方法書による処分を行うときを除き、当該清算参加者に対し、注意を喚起することができる。

2 本所は、前項の規定による注意の喚起を行った場合において必要があると認めるときは、当該清算参加者に対し、改善措置を記載した報告書等の提出を求めることができる。

(要請等)

第11条 本所は、検査の結果、清算参加者の業務若しくは財産の状況が業務方法書等に違反する行為が発生することとなるおそれのある状態であると認める場合又は清算参加者のリスク管理体制が適当でないと認められるときは、業務方法書による勧告を行うときを除き、当該清算参加者に対し、当該状態を改善するための所要の措置を講ずることを要請することができる。

2 本所は、前項の規定による要請を行った場合において必要があると認めるときは、当該清算参加者に対し、改善措置を記載した報告書等の提出を求めることができる。

(処分等の基準)

第12条 本所は、検査の結果に基づき、清算参加者に対し、業務方法書による処分又は第10条第1項の規定による注意の喚起（以下「処分等」という。）を行うかどうかについては、当該清算参加者の役員又は従業員の故意又は過失の有無及びその程度その他の事情を総合的に勘案して判断する。

（措置等の基準）

第13条 本所は、検査の結果に基づき、清算参加者に対し、業務方法書による措置、勧告又は第11条第1項の規定による要請（以下「措置等」という。）を行うかどうかについては、当該清算参加者の本所に対する債務の履行の確実性及びリスク管理体制の状況その他の事情を総合的に勘案して判断する。

（検査結果の通知）

第14条 本所は、検査を終えた場合は、処分等又は措置等の内容を含め、当該検査の結果を当該清算参加者に通知する。

付 則

この規則は、本所が定める日から施行する。

（注）「本所が定める日」は平成18年7月24日

付 則

この規則は、平成19年9月30日から施行する。

付 則

この規則は、平成20年4月21日から施行する。

付 則

この規則は、平成21年6月16日から施行する。

付 則

この規則は、平成24年2月27日から施行する。

付 則

この規則は、平成25年1月1日から施行する。