

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 1 章 総則

(目的)

第 1 条 この特例は、指数先物取引及び指数先物取引（有価証券等清算取次ぎを除く。）の受託等について、業務規程及び受託契約準則の特例を規定する。

2 この特例に定めのないものについては、業務規程及び受託契約準則の定めるところによる。

一部改正〔平成13年11月1日、平成15年1月6日、平成20年6月16日〕

(用語の意義)

第 2 条 この特例において使用する用語の意義については、有価証券の売買契約締結の方法に係る用語の意義に従うものとし、次の各号に定めるところによるほか、各条項中に定めるところによるものとする。

(1) 取引日とは、一の日（休業日を除く。）の第 5 条第 1 項第 3 号においてイブニング・セッション開始時として定める時から、その翌日（休業日に当たるときは、順次繰り下げる。以下同じ。）の午後 4 時まで（半休日においては、正午まで）をいう。

(2) 売付けとは、現実指数（将来の一定の時期における現実の指数の数値をいう。以下同じ。）が約定指数（当事者があらかじめ指数として約定する数値をいう。以下同じ。）を下回った場合に金銭を受領する立場の当事者となる取引をいい、買付けとは、現実指数が約定指数を上回った場合に金銭を受領する立場の当事者となる取引をいう。

(3) 値段とは、指数先物取引における指数の数値をいう。

(4) 値幅とは、値段の幅をいう。

(5) 呼値とは、指数先物取引の当事者となるためになす値段の限度の意思表示をいう。

(6) 売呼値とは、売付けに係る呼値をいい、買呼値とは、買付けに係る呼値をいう。

一部改正〔平成19年9月30日、平成20年1月15日、平成20年1月15日、平成20年6月16日〕

第 2 章 業務規程の特例

第 1 節 取引の対象及び限月取引

(取引の対象)

第 3 条 指数先物取引の対象は、次の各号に掲げる指数とする。

(1) 東証株価指数（当取引所の上場株券（内国法人の発行する株券（無議決権株式（有価証券上場規程第 2 条第 87 号に規定する無議決権株式をいう。））、議決権の少ない株式（同第 205 条第 9 号の 2 b に掲げるものをいう。）及び優先株等（同第 2 条第 90 号に規定する優先株等をいう。）を除く。）に限る。以下同じ。）のうち市場第一部銘柄を対象とする時価総額方式の株価指数であって、当取引所が算出するものをいう。以下同じ。）

(2) S & P / T O P I X 150（当取引所の上場株券のうち市場第一部銘柄の中から当取引所及び The McGraw - Hill Companies, Inc. の一部門である Standard & Poor' s（以下この号において「S & P」という。）が選定した 150 銘柄を対象とする修正時価総額方式（各銘柄の時価総額に、株式の分布状況を勘案し銘柄ごとに定める数値を乗じて得た額に基づき算出する方式をいう。）の株価指数であって、S & P が算出するものをいう。以下同じ。）

(3) T O P I X C o r e 30（当取引所の上場株券のうち市場第一部銘柄の中から当取引所が選定した 30 銘柄を対象とする時価総額方式の株価指数であって、当取引所が算出するものをいう。以下同じ。）

(4) 東証電気機器株価指数（当取引所の上場株券のうち証券コード協議会により電気機器に分類された市場第一部銘柄を対象とする時価総額方式の株価指数であって、当取引所が算出するものをいう。以下同じ。）

(5) 東証輸送用機器株価指数（当取引所の上場株券のうち証券コード協議会により輸送用機器に分類された市場第一部銘柄を対象とする時価総額方式の株価指数であって、当取引所が算出するものをいう。以下同じ。）

(6) 東証銀行業株価指数（当取引所の上場株券のうち証券コード協議会により銀行業に分類された市場第一部銘柄を対象とする時価総額方式の株価指数であって、当取引所が算出するものをいう。以下同じ。）

(7) 東証 R E I T 指数（当取引所の上場不動産投資信託証券（有価証券上場規程第1001条第19号に規定する上場不動産投資信託証券をいう。）を対象とする時価総額方式の指数であって、当取引所が算出するものをいう。以下同じ。）

一部改正〔平成10年1月23日、平成10年3月13日、平成10年4月10日、平成13年6月11日、平成13年11月1日、平成17年2月7日、平成18年5月1日、平成20年6月16日、平成20年7月7日、平成21年1月5日〕

（ラージ取引及びミニ取引）

第3条の2 東証株価指数を対象とする指数先物取引（以下「東証株価指数先物取引」という。）は、ラージ取引とミニ取引に区分して行うものとする。

追加〔平成20年6月16日〕

（限月取引及びその数）

第4条 指数先物取引は、取引対象指数ごと（東証株価指数先物取引にあつては、ラージ取引又はミニ取引の別ごと）に、3月、6月、9月及び12月の第二金曜日（休業日に当たるときは、順次繰り上げる。）の前日（休業日に当たるときは、順次繰り上げる。以下同じ。）に終了する取引日を取引最終日とする取引（以下「限月取引」という。）に区分する。

2 限月取引の数及びその期間は、次の各号に定めるところによる。

(1) 東証株価指数先物取引については、次の a 又は b に掲げる取引の区分に従い、当該 a 又は b に定めるところによるものとする。

a ラージ取引

5 限月取引制とし、各限月取引の期間は1年3か月とする。

b ミニ取引

3 限月取引制とし、各限月取引の期間は9か月とする。

(2) S & P / T O P I X 150、T O P I X C o r e 30、東証電気機器株価指数、東証輸送用機器株価指数、東証銀行業株価指数及び東証 R E I T 指数を対象とする指数先物取引については、それぞれ3限月取引制とし、各限月取引の期間は9か月とする。

3 前項各号に規定する各指数先物取引について、最初に取引最終日が到来する限月取引（以下「直近の限月取引」という。）の取引最終日の終了する日の翌日の午前8時20分から新たな限月取引を開始する。

4 前3項の規定にかかわらず、当取引所は、取引対象指数を新たに定める場合その他当取引所が必要と認める場合には、限月取引の数及びその期間並びに取引最終日及び取引開始日を変更することができる。

一部改正〔平成元年5月1日、平成9年5月16日、平成10年1月23日、平成12年6月5日、平成13年6月11日、平成13年11月1日、平成20年1月15日、平成20年1月15日、平成20年6月16日〕

（限月間スプレッド取引）

第4条の2 取引参加者（取引参加者規程第2条第2項に規定する総合取引参加者又は同条第4項に規定する指数先物等取引参加者をいう。以下同じ。）は、東証株価指数、T O P I X C o r e 30 及び東証 R E I T 指数を対象とする指数先物取引において、二つの限月取引のうち同一数量による一方の限月取引の売付けと他方の限月取引の買付け（同一の顧客又は自己の計算による売付け及び買付けに限る。）を同時に行おうとするときは、限月間スプレッド取引（二つの限月取引のうち取引最終日が後に到来する限月取引の値段から取引最終日が先に到来する限月取引の値段を差し引いて得た値段（以下「スプレッド値段」という。）により呼値を行う取引で、当該呼値について取引が成立したときは成立した呼値に係る数量と同一数量の一方の限月取引の売付け及び他方の限月取引の買付けが成立する取引をいう。以下同じ。）を行うことができるものとする。

2 限月間スプレッド取引は、次の各号に掲げる指数先物取引の区分に従い、当該各号に定める限月取引間について行うものとする。ただし、当取引所が別に定めた場合は、この限りでない。

(1) 東証株価指数先物取引

a ラージ取引

5 限月取引のうち、直近の限月取引と当該直近の限月取引以外の4限月取引との間について行うものとする。

b ミニ取引

3 限月取引のうち、直近の限月取引と当該直近の限月取引以外の 2 限月取引との間について行うものとする。

(2) TOPIX Core30先物取引 (TOPIX Core30を対象とする指数先物取引をいう。以下同じ。)

3 限月取引のうち、直近の限月取引と当該直近の限月取引以外の 2 限月取引との間について行うものとする。

(3) 東証REIT指数先物取引 (東証REIT指数を対象とする指数先物取引をいう。以下同じ。)

3 限月取引のうち、直近の限月取引と当該直近の限月取引以外の 2 限月取引との間について行うものとする。

3 限月間スプレッド取引において、スプレッド売呼値とは、直近の限月取引の買付け及び直近の限月取引以外の限月取引の売付けに係るスプレッド値段による呼値をいい、スプレッド買呼値とは、直近の限月取引の売付け及び直近の限月取引以外の限月取引の買付けに係るスプレッド値段による呼値をいうものとする。

追加〔平成9年5月16日〕、一部改正〔平成10年1月23日、平成13年11月1日、平成20年1月15日、平成20年6月16日〕

第2節 立会及び立会による取引契約締結の方法等

一部改正〔平成10年10月5日〕

(立会の区分及び立会時等)

第5条 指数先物取引の立会は、午前立会、午後立会及びイブニング・セッションに分ち、各立会時は次の各号に定める時間とする。

(1) 午前立会は午前9時から11時まで(半休日においては、午前9時から11時10分まで)とする。

(2) 午後立会は午後0時30分から3時10分までとする。

(3) イブニング・セッションは午後4時30分から7時までとする。

2 当取引所は、必要があると認めるときは、前項の立会時を臨時に変更することができる。この場合においては、あらかじめその旨を取引参加者に通知する。

3 休業日においては、指数先物取引の立会その他一切の業務を行わず、半休日においては、午後立会及びイブニング・セッションを行わない。

一部改正〔平成元年2月1日、平成元年5月1日、平成元年10月2日、平成3年4月30日、平成11年5月1日、平成13年11月1日、平成20年1月15日、平成20年6月16日〕

(立会の臨時停止、臨時挙行)

第6条 当取引所は、必要があると認めるときは、指数先物取引の立会の全部若しくは一部を臨時に停止し又は臨時に挙行することができる。

一部改正〔平成13年11月1日、平成20年6月16日〕

(臨時停止、臨時挙行の通知)

第7条 当取引所は、指数先物取引の立会の臨時停止又は臨時挙行を定めたときは、あらかじめその旨を取引参加者に通知する。

一部改正〔平成元年10月2日、平成11年5月1日、平成13年11月1日、平成20年6月16日〕

(売買システムによる取引)

第8条 指数先物取引については、売買システムによる取引を行う。

一部改正〔平成20年1月15日、平成20年6月16日〕

(競争取引における呼値の順位)

第9条 指数先物取引は、競争取引によるものとする。

2 指数先物取引の競争取引における呼値の順位は、次の各号に定めるところによる。

(1) 低い値段の売呼値は、高い値段の売呼値に優先し、高い値段の買呼値は、低い値段の買呼値に優先する。

(2) 同一値段の呼値については、次に定めるところによる。

a 呼値が行われた時間の先後により、先に行われた呼値は、後に行われた呼値に優先する。

b 同時に行われた呼値及び行われた時間の先後が明らかでない呼値の順位は、当取引所が定める。

- (3) 成行呼値は、それ以外の呼値に値段的に優先し、成行呼値相互間の順位は、同順位とする。
- 3 立会の始めの約定指数が決定されるまでに行われたすべての呼値及び当取引所が定めるところにより特定の限月取引について取引が中断された場合の中断後最初の約定指数が決定されるまでに行われたすべての呼値は、それぞれ同時に行われたものとみなす。
 - 4 午後立会（半休日においては、午前立会）終了時において第11条第4項の規定により定める値幅の限度の値段により対当されることとなる場合の成行呼値は、当該値段による呼値とする。この場合において、当該値段による呼値は、すべて同時に行われたものとみなす。
 - 5 限月間スプレッド取引に係る第2項及び第3項の規定の適用については、第2項中「次の各号」とあるのは「第1号及び第2号」と、「値段」とあるのは「スプレッド値段」と、「売呼値」とあるのは「スプレッド売呼値」と、「買呼値」とあるのは「スプレッド買呼値」と、第3項中「約定指数」とあるのは「約定スプレッド値段」と、「限月取引」とあるのは「限月間スプレッド取引」とする。

一部改正〔平成9年5月16日、平成13年11月1日、平成20年1月15日、平成20年6月16日〕
(個別競争取引)

第10条 前条第1項の競争取引は、個別競争取引とする。

- 2 指数先物取引における個別競争取引においては、次の各号に掲げる約定指数を定める場合を除き、売呼値の競合、買呼値の競合及び売呼値と買呼値との争合により、最も低い値段の売呼値と最も高い値段の買呼値とが合致するとき、その値段を約定指数とし、前条第2項に定める呼値の順位に従って、対当する呼値の間に取引を成立させる。
 - (1) 立会の始めの約定指数
 - (2) 当取引所が定めるところにより、特定の限月取引について取引が中断された場合の中断後最初の約定指数
 - (3) 立会終了時における約定指数
 - (4) 前各号に定めるもののほか、当取引所が定めるところにより気配表示が行われている場合の約定指数及び当取引所が呼値の状況から必要があると認める場合の約定指数
- 3 前項各号の約定指数を定める場合においては、売呼値の競合、買呼値の競合及び売呼値と買呼値との争合により、次の各号に掲げる売呼値の合計数量と買呼値の合計数量とが一定の値段で合致するとき、その値段を約定指数とし、前条第2項に定める呼値の順位に従って、対当する呼値の間に取引を成立させる。ただし、当該各号に掲げる売呼値の合計数量と買呼値の合計数量とが合致する一定の値段がない場合には、売呼値の競合、買呼値の競合及び売呼値と買呼値の争合により、当該各号（第3号bを除く。）に掲げる売呼値の合計数量と買呼値の合計数量とが一定の値段で合致するとき、その値段を前項各号の約定値段とし、前条第2項に定める呼値の順位に従って、対当する呼値の間に取引を成立させる。
 - (1) 成行呼値の全部の数量
 - (2) 当該値段に満たない値段による売呼値及び当該値段を超える値段による買呼値の全部の数量
 - (3) 当該値段による呼値について、次に掲げる数量
 - a 売呼値又は買呼値のいずれか一方の全部の数量
 - b 他方の呼値の数量については、当取引所が定める数量
- 4 前項の場合において、売呼値の合計数量と買呼値の合計数量とが合致する一定の値段が二つ以上あるときの約定指数は、これらの値段のうち直前の約定指数（限月間スプレッド取引による約定指数を除く。この項及び次項における「直前の約定指数」について同じ。）と同一の値段があるときは、当該値段とし、直前の約定指数と同一の値段がないときは、直前の約定指数に最も近接する値段とする。ただし、当取引所が直前の約定指数を基準とすることが適当でないとき認めるときは、当取引所がその都度定める値段とする。
- 5 第3項の規定にかかわらず、第2項第3号の約定指数を定める取引の値段が、直前の約定指数（当取引所が定めるところにより気配表示が行われているときは、当該気配値段）を基準として、当取引所が定める値幅を超えるときは、取引を不成立とする。
- 6 限月間スプレッド取引に係る第2項から前項までの規定の適用については、第2項から前項までの規定中第4項かっこ書に規定する約定指数を除き「約定指数」とあるのは「約定スプレッド値段」と、「値段」とあるのは「スプレッド値段」と、第2項から第4項までの規定中「売呼値」とある

のは「スプレッド売呼値」と、「買呼値」とあるのは「スプレッド買呼値」と、第 2 項及び第 3 項中「前条第 2 項」とあるのは「前条第 5 項の規定により読み替えて適用する同条第 2 項」と、第 2 項中「限月取引」とあるのは「限月間スプレッド取引」と、第 4 項中「（限月間スプレッド取引による約定指数を除く。この項及び次項における「直前の約定指数」について同じ。）と同一」とあるのは「と同一」と、前項中「気配値段」とあるのは「気配スプレッド値段」とする。

一部改正〔平成 9 年 5 月 16 日、平成 10 年 10 月 5 日、平成 12 年 6 月 5 日、平成 12 年 7 月 17 日、平成 13 年 6 月 10 日、平成 13 年 11 月 1 日、平成 13 年 12 月 1 日、平成 20 年 1 月 15 日、平成 20 年 1 月 15 日、平成 20 年 6 月 16 日〕

（限月間スプレッド取引の呼値について取引が成立したときの売付け又は買付けに係る約定指数）

第 10 条の 2 限月間スプレッド取引の呼値について取引が成立したときの各限月取引の売付け又は買付けに係る約定指数は、次の各号に掲げる限月取引の区分に従い、当該各号に定める値段とする。

(1) 直近の限月取引

同一取引日の立会による直近の限月取引の直前の約定指数（当取引所が定めるところにより気配表示が行われているときは、当該気配値段）。ただし、当該直前の約定指数がない場合は、当取引所が定める値段

(2) 直近の限月取引以外の限月取引

前号の規定に基づき直近の限月取引の約定指数とする値段に限月間スプレッド取引の当該呼値に係る約定スプレッド値段を加えて得た値段

2 前項の場合において、前項第 2 号の規定により算出する値段が直近の限月取引以外の限月取引の第 11 条第 4 項の規定により定める値幅の限度を超える値段となるときは、次の各号に掲げる限月取引の区分に従い、当該各号に定める値段とする。

(1) 直近の限月取引

次号の規定に基づき直近の限月取引以外の限月取引の約定指数とする値段から限月間スプレッド取引の当該呼値に係る約定スプレッド値段を減じて得た値段

(2) 直近の限月取引以外の限月取引

次の a 又は b に定める値段とする。

a 前項第 2 号の規定により算出される値段が直近の限月取引以外の限月取引の第 11 条第 4 項の規定により定める値幅の上限の値段を上回る場合には、当該値幅の上限の値段

b 前項第 2 号の規定により算出される値段が直近の限月取引以外の限月取引の第 11 条第 4 項の規定により定める値幅の下限の値段を下回る場合には、当該値幅の下限の値段

追加〔平成 9 年 5 月 16 日〕、一部改正〔平成 10 年 10 月 5 日、平成 13 年 11 月 1 日、平成 15 年 1 月 14 日、平成 16 年 2 月 2 日、平成 20 年 1 月 15 日、平成 20 年 6 月 16 日〕

（取引の取消し）

第 10 条の 3 当取引所は、過誤のある注文により取引が成立した場合において、その決済が極めて困難であり、当取引所の市場が混乱するおそれがあると認めるときは、当取引所が定める取引を取り消すことができる。

2 当取引所は、天災地変その他のやむを得ない理由により当取引所のシステム上の取引記録が消失した場合において、消失したすべての取引記録を復元することが困難であると認めるときは、当取引所がその都度定める取引を取り消すことができる。

3 第 1 項又は前項の規定により当取引所が取引を取り消した場合には、当該取引は初めから成立しなかったものとみなす。

4 取引参加者は、第 1 項の規定により当取引所が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、過誤のある注文を発注した取引参加者に対して、その損害の賠償を請求できないものとする。ただし、過誤のある注文の発注に際して、取引参加者に故意又は重過失が認められる場合は、この限りでない。

5 取引参加者は、第 1 項又は第 2 項の規定により当取引所が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、当取引所に対して、その損害の賠償を請求できないものとする。ただし、当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。

追加〔平成 19 年 9 月 30 日〕、一部改正〔平成 20 年 6 月 16 日〕

（呼値）

第11条 取引参加者は、指数先物取引を行おうとするときは、呼値を行わなければならない。この場合において、取引参加者は、当該呼値が顧客の委託に基づくものか自己の計算によるものかの別を、当取引所に対し明らかにしなければならない。

- 2 指数先物取引の呼値は、当該取引参加者の取引参加者端末装置から入力する方法による呼値によるものとする。
- 3 指数先物取引の呼値の単位は、次の各号に掲げる指数先物取引の区分に従い、当該各号に定めるところによる。
 - (1) 東証株価指数先物取引
 - a ラージ取引
0.5ポイントとする。ただし、限月間スプレッド取引については0.1ポイントとする。
 - b ミニ取引
0.25ポイントとする。ただし、限月間スプレッド取引については0.05ポイントとする。
 - (2) S&P/TOPIX150先物取引（S&P/TOPIX150を対象とする指数先物取引をいう。以下同じ。）、東証電気機器株価指数先物取引（東証電気機器株価指数を対象とする指数先物取引をいう。以下同じ。）及び東証輸送用機器株価指数先物取引（東証輸送用機器株価指数を対象とする指数先物取引をいう。以下同じ。）
0.5ポイントとする。
 - (3) TOPIX Core30先物取引及び東証REIT指数先物取引
0.5ポイントとする。ただし、限月間スプレッド取引については0.1ポイントとする。
 - (4) 東証銀行業株価指数先物取引（東証銀行業株価指数を対象とする指数先物取引をいう。以下同じ。）
0.1ポイントとする。
- 4 指数先物取引の呼値は、当取引所が定める値幅の限度を超える値段により行うことができない。ただし、限月間スプレッド取引の呼値を行う場合の値幅の限度は定めない。
- 5 当取引所は、呼値について、取引の成立を促進するために必要があると認めるときは、その存在を周知するものとする。
- 6 この特例に定めるもののほか、指数先物取引の呼値に関し必要な事項については、当取引所が定める。

一部改正〔平成元年10月2日、平成9年5月16日、平成10年1月23日、平成10年3月13日、平成10年4月10日、平成10年11月2日、平成12年7月17日、平成13年6月10日、平成13年6月11日、平成13年11月1日、平成20年1月15日、平成20年6月16日〕

（取引単位）

第12条 指数先物取引は、次の各号に掲げる指数先物取引の区分に従い、当該各号に定める額に取引対象指数の数値を乗じて得た額を1単位として行う。

- (1) 東証株価指数先物取引
 - a ラージ取引
1万円
 - b ミニ取引
1,000円
- (2) 東証電気機器株価指数先物取引、東証輸送用機器株価指数先物取引及び東証銀行業株価指数先物取引
1万円
- (3) S&P/TOPIX150先物取引、TOPIX Core30先物取引及び東証REIT指数先物取引
1,000円

一部改正〔平成10年1月23日、平成13年6月11日、平成20年6月16日〕

（約定指数等の公表）

第13条 当取引所は、指数先物取引が成立したときは、当取引所が定めるところにより、その約定指数（限月間スプレッド取引にあっては、その約定スプレッド値段及び約定指数）を公表する。

一部改正〔平成9年5月16日、平成11年5月1日、平成13年6月10日、平成13年11月1日、

平成20年 6 月 16 日]

(取引の通知及び確認)

第14条 当取引所は、取引が成立したときは、直ちにその内容を売買システムにより、売付けを行った取引参加者及び買付けを行った取引参加者に通知するものとする。

2 取引参加者は、指数先物取引について取引参加者端末装置により取引の内容の通知を受けたときは、直ちにその内容を確認するものとする。

一部改正〔平成元年10月 2 日、平成12年 7 月 17日、平成13年11月 1 日、平成15年 1 月 6 日、平成20年 6 月 16日〕

(取引の一時中断)

第14条の 2 当取引所は、指数先物取引（ミニ取引を除く。）の各限月取引について、次の各号のいずれかに該当した場合には、当該各号に該当した時から当取引所が定める時間を経過するまでの間、取引対象指数が当該限月取引と同一の指数先物取引を一時中断する。ただし、当取引所が定める場合には、取引の一時中断を行わない。

(1) 直前の約定指数（限月間スプレッド取引による約定指数を除き、当取引所が定めるところにより気配表示が行われている場合には、当該気配値段を含む。以下この条において同じ。）が、当取引所が基準値段として定める値段を当取引所が定める第一値幅を超えて下回っている場合（第 3 号に掲げる場合を除く。）

(2) 直前の約定指数が、当取引所が基準値段として定める値段を当取引所が定める第一値幅を超えて上回っている場合（第 4 号に掲げる場合を除く。）

(3) 直前の約定指数が、当取引所が基準値段として定める値段を当取引所が定める第二値幅を超えて下回っている場合

(4) 直前の約定指数が、当取引所が基準値段として定める値段を当取引所が定める第二値幅を超えて上回っている場合

追加〔平成 6 年 2 月 14日〕、一部改正〔平成 9 年 5 月 16日、平成10年 1 月 23日、平成10年 10 月 5 日、平成13年11月 1 日、平成13年12月 1 日、平成15年 9 月 16日、平成20年 1 月 15日、平成20年 1 月 15日、平成20年 6 月 16日、平成20年12月 15日、平成21年10月 5 日〕

(取引の停止)

第15条 当取引所は、次の各号に掲げる場合には、当取引所が定めるところにより、指数先物取引を停止することができる。

(1) 指数先物取引の状況に異常があると認める場合又はそのおそれがあると認める場合その他取引管理上取引を継続して行わせることが適当でないと認める場合

(2) 売買システムの稼働に支障が生じた場合等において売買システムによる取引を継続して行わせることが困難であると認める場合

一部改正〔平成13年11月 1 日、平成20年 6 月 16日〕

第 3 節 ストラテジー取引により成立する指数先物取引

一部改正〔平成21年10月 5 日〕

(ストラテジー取引による指数先物取引の成立)

第16条 ストラテジー取引（指数オプション取引に関する業務規程及び受託契約準則の特例第 6 条の 2 第 1 項第 2 号に掲げる取引をいう。以下同じ。）の対象となる指数先物取引は、ストラテジー売呼値（同第 6 条の 2 第 5 項に規定するストラテジー売呼値をいう。）とストラテジー買呼値（同第 6 条の 2 第 5 項に規定するストラテジー買呼値をいう。）とが対当し、かつ、同第 6 条の 2 第 4 項に規定する条件が合致したときに、当取引所が定めるところにより、当該ストラテジー取引の当事者間で立会による取引によらずに成立する。

2 前項のほか、ストラテジー取引の対象となる指数先物取引に関し必要な事項は、当取引所が定める。

一部改正〔平成21年10月 5 日〕

第 4 節 削除

一部改正〔平成13年 6 月 10日、平成20年 1 月 15日、平成21年10月 5 日〕

第17条から第25条まで 削除

一部改正〔平成13年 6 月 10日、平成20年 1 月 15日、平成20年 1 月 15日、平成21年10月 5 日〕

第 5 節 過誤訂正等のための取引

一部改正〔平成10年10月5日〕

(過誤訂正等のための取引)

第26条 取引参加者は、顧客の注文を真にやむを得ない事由による過誤等により、委託の本旨に従って当取引所の市場において執行することができなかつたときは、当取引所が定めるところにより、あらかじめ当取引所の承認を受け、当該承認に係る売付け又は買付けを、当取引所が適正と認める値段により、自己がその相手方となって立会による取引によらずに執行することができる。

2 前項の売付け又は買付けに係る決済は、当該顧客の委託に基づく売付け又は買付けを、委託の本旨に従って執行することができた場合における決済日に行うものとする。

3 限月間スプレッド取引に係る前2項の規定の適用については、前2項中「売付け」とあるのは「直近の限月取引の買付け及び直近の限月取引以外の限月取引の売付け」と、「買付け」とあるのは「直近の限月取引の売付け及び直近の限月取引以外の限月取引の買付け」と、第1項中「値段」とあるのは「スプレッド値段」とする。

一部改正〔平成元年10月2日、平成9年5月16日、平成10年10月5日、平成13年11月1日、平成13年12月1日、平成15年1月6日、平成20年1月15日〕

第 6 節 最終決済等

一部改正〔平成15年1月14日〕

(最終決済)

第27条 指数先物取引の各限月取引について取引最終日までの間に転売（買建玉（各限月取引の決済が未了である約定（以下「未決済約定」という。）に係る数量（以下「建玉」という。）のうち買付けの約定に係る数量をいう。）についての反対の取引をいう。以下同じ。）又は買戻し（売建玉（建玉のうち売付けの約定に係る数量をいう。）についての反対の取引をいう。以下同じ。）が行われなかつた建玉については、次条第1項に基づき最終清算指数を定める日の翌日（以下「最終決済期日」という。）に次条に規定する最終清算指数による決済（以下「最終決済」という。）を行う。

一部改正〔平成15年1月14日、平成16年2月2日、平成20年6月16日〕

(最終清算指数)

第28条 最終清算指数は、指数先物取引の当該限月取引の取引最終日の終了する日の翌日に定めるものとし、当該取引最終日の終了する日の翌日における取引対象指数の対象である有価証券の各銘柄に係る売買立会の始めの約定値段（取引最終日の終了する日の翌日に約定値段がない銘柄については、当取引所が定める値段）に基づき当取引所が算出した特別な指数（以下「特別清算指数」という。）とする。ただし、当該取引最終日の終了する日の翌日に有価証券の売買立会が停止された場合（業務規程第29条第3号又は第4号の規定により有価証券の売買が停止された場合を含む。）において必要と認めるときは、最終清算指数は、当取引所がその都度定める日に、当取引所がその都度定める。

2 当取引所は、前項の規定にかかわらず、最終決済期日前に特別清算指数に誤りがあると認められた場合には、再算出された特別清算指数を最終清算指数とすることができる。

3 取引参加者は、指数の算出若しくは配信の不能、遅延若しくは誤り又は前項の規定による最終清算指数の変更により損害を被つた場合においても、当取引所及び指数の算出者（当該算出者から指数の算出に関して業務委託を受けた者を含む。）に対してその損害の賠償請求をすることができない。

追加〔平成15年1月14日〕、一部改正〔平成20年6月16日〕

第 7 節 ギブアップ

追加〔平成20年1月15日〕

(ギブアップ)

第29条 取引参加者は、指数先物取引（過誤訂正等のための取引を含み、ギブアップの成立により新たに発生した指数先物取引を除く。以下この節において同じ。）について、この節に定めるところにより、ギブアップを行うことができる。

2 ギブアップとは、指数先物取引の売付け又は買付けを将来に向かって消滅させ、同時に、当該売付け又は買付けと同一内容の指数先物取引の売付け又は買付けを他の取引参加者の名において（当

該他の取引参加者が非清算参加者（取引参加者規程第24条の2第5項に規定する非清算参加者をいう。以下同じ。）である場合にあっては、当該他の取引参加者の計算により、その指定清算参加者（当該非清算参加者が取引参加者規程第24条の4第1項の規定に基づいて指定した指定清算参加者をいう。以下同じ。）の名において新たに発生させることをいう。

- 3 注文執行取引参加者とは、ギブアップの成立により消滅することとなる指数先物取引の売付け又は買付けを行う取引参加者をいう。
- 4 清算執行取引参加者とは、ギブアップの成立により他の取引参加者の名において又は他の取引参加者の計算によりその指定清算参加者の名において、指数先物取引の売付け又は買付けが新たに発生することとなる場合における当該他の取引参加者をいう。
- 5 この特例に定めるもののほか、ギブアップに関し必要な事項については、当取引所が定める。

追加〔平成20年1月15日〕、一部改正〔平成20年1月15日、平成20年6月16日〕

（ギブアップ申告）

第30条 注文執行取引参加者は、指数先物取引の売付け又は買付けについてギブアップを行おうとする場合は、当取引所が定める時限までに、その旨、当該売付け又は買付けの内容、当該ギブアップに係る清算執行取引参加者の名称その他当取引所が定める内容を、当取引所に申告するものとする。

- 2 前項の規定により申告を受けた場合は、当取引所は、直ちにその内容を当該清算執行取引参加者に通知する。

追加〔平成20年1月15日〕、一部改正〔平成20年6月16日〕

（テイクアップ申告）

第31条 前条第2項の規定により通知を受けた場合は、当該清算執行参加者は、当取引所が定める時限までに、当該ギブアップについて次の各号に掲げる事項を、当取引所に申告する。

- (1) ギブアップを承諾する場合には、その旨
- (2) ギブアップを承諾しない場合には、その旨

- 2 前項に規定する時限までに同項の規定による申告が行われなかった場合には、当取引所は、当該清算執行取引参加者から同項第2号に掲げる事項の申告を受けたものとみなす。
- 3 第1項の規定により申告を受けた場合（前項の規定により第1項第2号に掲げる事項の申告を受けたものとみなされる場合を含む。）は、当取引所は、直ちにその内容を当該ギブアップに係る注文執行取引参加者に通知する。

追加〔平成20年1月15日〕

（ギブアップの成立時期）

第32条 ギブアップは、当取引所が前条第1項第1号に掲げる事項の申告を受けた時に成立する。

追加〔平成20年1月15日〕

第8節から第10節まで 削除

一部改正〔平成15年1月14日、平成20年1月15日〕

第33条から第36条まで 削除

一部改正〔平成15年1月14日、平成20年1月15日〕

第11節 雑則

追加〔平成11年4月1日〕

（取引に関する通知書の送付）

第37条 取引参加者は、指数先物取引（過誤訂正等のための取引を含む。以下この項において同じ。）に係る未決済勘定がある顧客に対して、当該指数先物取引に関する通知書を毎月送付するものとする。ただし、顧客が日本証券業協会に所属する金融商品取引業者である場合については、この限りでない。

- 2 前項に規定する通知書には、取引対象指数、限月取引、東証株価指数先物取引にあってはラージ取引又はミニ取引の別、売付け又は買付けの別、取引契約数量、約定指数、取引成立日（取引が成立した取引日の終了する日をいう。）及び取引最終日（当該限月取引の終了する日をいう。）を記載しなければならない。
- 3 取引参加者は、第1項の規定による通知書の送付に代えて、顧客に対し、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（平成19年内閣府令第52号）第56条（第1項第1号ニ、第2項第3号ロ及び

第 4 号を除き、同項第 3 号中「に掲げられた取引を最後に行った」とあるのは「を記録した」と読み替えるものとする。)に定める方法と同様の方法をいう。以下この項及び次項において同じ。)の種類及び内容を提示し、当該顧客の書面又は電磁的方法による承諾を得た場合には、当該通知書に記載すべき事項を電磁的方法により提供することができる。この場合において、当該取引参加者は当該通知書を送付したものとみなす。

- 4 前項の規定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提供を受けない旨の申出があったときは、当該顧客に対し当該通知書に記載すべき事項の提供を電磁的方法によってしてはならない。ただし、当該顧客が再び前項の規定による承諾をした場合は、この限りでない。

一部改正〔平成元年10月2日、平成10年1月23日、平成13年11月1日、平成14年2月1日、平成19年9月30日、平成20年1月15日、平成20年1月15日、平成20年3月10日、平成20年6月16日〕

(当取引所の市場における指数先物取引又はその受託に関する規制措置)

第38条 当取引所は、当取引所の市場における指数先物取引の状況に異常があると認める場合又はそのおそれがあると認める場合には、当取引所の市場における指数先物取引又はその受託に関し、当取引所が規則により定める規制措置のうち、必要な措置を行うことができる。

一部改正〔平成元年10月2日、平成13年11月1日、平成20年6月16日〕

第39条 削除

一部改正〔平成10年12月1日、平成11年5月1日〕

第40条 削除

一部改正〔平成元年10月2日、平成9年5月16日、平成11年5月1日、平成13年11月1日、平成16年6月30日、平成19年9月30日〕

(当取引所の市場における指数先物取引の方法等)

第41条 取引参加者は、当取引所の市場における指数先物取引を、当取引所が適当と認める取引参加者端末装置等により行わなければならない。

- 2 取引参加者は、当取引所が定めるところにより取引参加者端末装置に関する事項について当取引所に報告するとともに、売買システムが安定的に稼働するよう協力するものとする。
- 3 取引参加者は、当取引所の市場における指数先物取引の業務を担当する役員又はその責任者の地位にある従業員のうちから、当該指数先物取引の業務の統轄及びこれに関連する事項の処理に当たる指数先物取引等責任者1人を選任し、あらかじめ当取引所に届け出なければならない。ただし、当取引所が、指数先物取引等責任者の行うべき事務のうち一部のものについて、別に責任者を設けるべき事務として定める場合は、指数先物取引等責任者に代わって当該事務に当たる責任者を選任し、あらかじめ当取引所に届け出るものとする。

一部改正〔平成元年10月2日、平成10年12月1日、平成11年5月1日、平成13年11月1日、平成19年10月1日、平成20年6月16日〕

第42条及び第43条 削除

一部改正〔平成13年11月1日〕

(売買システムの稼働に支障が生じた場合等における非常措置)

第44条 売買システムの稼働に支障が生じた場合において、当取引所が必要であると認めるときは、指数先物取引について、臨時に売買システムによる取引以外の取引を行うことができる。

- 2 売買システム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呼値を行うことが困難である取引参加者(以下「システム障害取引参加者」という。)は、あらかじめ他の取引参加者の承諾及び当取引所の承認を受けて、当該他の取引参加者(以下「取引代行取引参加者」という。)を通じて呼値を行うことができる。この場合において、当該呼値により指数先物取引が成立したときは、当該システム障害取引参加者及び当該取引代行取引参加者は、当取引所が定めるところにより、その内容を当取引所に申告しなければならない。
- 3 前2項の規定による指数先物取引に関し必要な事項は、当取引所がその都度定める。

一部改正〔平成11年10月1日、平成13年6月10日、平成13年11月1日、平成20年6月16日〕

第45条 削除

一部改正〔平成元年5月1日、平成元年10月2日、平成10年1月23日、平成13年6月11日、

平成13年11月 1 日]

(業務規程の読替え)

第46条 指数先物取引に係る業務規程第74条から第76条まで及び第77条の2の規定の適用については、同第74条及び第75条の規定中「よる当取引所の市場における毎日」とあるのは「より行う当取引所の市場における毎取引日」と、同第76条及び第77条の2の規定中「取引参加者」とあるのは「取引参加者（取引参加者規程第2条第2項に規定する総合取引参加者又は同条第4項に規定する指数先物等取引参加者をいう。）」とする。

一部改正〔平成元年10月2日、平成11年5月1日、平成13年11月1日、平成18年5月1日、平成20年6月16日〕

第3章 受託契約準則の特例

第1節 指数先物取引の受託

一部改正〔平成20年6月16日〕

(先物・オプション取引口座設定約諾書の差入れ)

第47条 顧客が指数先物取引の委託をしようとするときは、取引参加者に先物・オプション取引口座を設定しなければならない。

- 2 前項の規定にかかわらず、顧客がギブアップに係る指数先物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注文執行取引参加者に、清算執行取引参加者の顧客は清算執行取引参加者に、それぞれ先物・オプション取引口座を設定しなければならない。
- 3 先物・オプション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。
- 4 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、当取引所が定める様式による先物・オプション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、取引参加者に差し入れるものとする。
- 5 顧客は、前項の規定による約諾書の差入れに代えて、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60条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。

一部改正〔平成元年10月2日、平成9年10月29日、平成13年11月1日、平成20年1月15日、平成20年3月10日、平成20年6月16日〕

(ギブアップ契約の締結)

第47条の2 顧客がギブアップに係る指数先物取引の委託をしようとする場合は、当該顧客は、当該ギブアップに係る注文執行取引参加者及び清算執行取引参加者との間で、ギブアップに関する契約を締結するものとする。

- 2 前項の契約には、次の各号に掲げる事項を定めなければならない。
 - (1) 委託手数料の額並びにその徴収者及び徴収方法
 - (2) ギブアップが成立しなかった場合における取扱い
- 3 第1項の規定にかかわらず、顧客がギブアップに係る指数先物取引の委託をしようとする場合において、当該顧客が取引取次者（注文執行取引参加者に指数先物取引を委託した顧客が、金融商品取引業者又は外国証券業者である場合であって、当該委託が注文執行取引参加者に対する指数先物取引の委託の取次ぎによるものであるときの当該顧客をいう。次項において同じ。）であるときは、当該顧客は、当該顧客に委託の取次ぎの申込みをする者及び当該ギブアップに係る清算執行取引参加者との間で、前2項に規定する契約に準じた契約を締結するものとする。
- 4 第1項及び前項の規定にかかわらず、注文執行取引参加者の顧客がギブアップに係る指数先物取引の委託をしようとする場合において、清算執行取引参加者の顧客が決済取次者（清算執行取引参

加者に指数先物取引の決済の委託をした顧客が、金融商品取引業者又は外国証券業者である場合であって、当該委託が清算執行取引参加者に対する指数先物取引の決済の委託の取次ぎによるものであるときの当該顧客をいう。以下同じ。) であるときは、当該清算執行取引参加者の顧客は、当該注文執行取引参加者(当該注文執行取引参加者の顧客が取引取次者である場合にあっては、当該注文執行取引参加者の顧客に委託の取次ぎの申込みをする者)及び当該注文執行取引参加者の顧客との間で第1項及び第2項に規定する契約に準じた契約を締結するものとする。

- 5 第1項、第3項又は前項の場合において、当該各項に規定する契約を締結したときは、注文執行取引参加者又は清算執行取引参加者は、ギブアップに係る指数先物取引の委託を受けることができる。

追加〔平成20年1月15日〕、一部改正〔平成20年6月16日〕

(顧客の通告事項)

第48条 顧客が指数先物取引を委託する場合には、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の権限
- 一部改正〔平成元年10月2日、平成13年11月1日、平成20年6月16日〕

(委託の際の指示事項)

第49条 顧客が指数先物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(ストラテジー取引による場合は、第2号、第4号、第5号、第8号及び第9号を除く。)

- (1) 取引対象指数及び限月取引
 - (2) 東証株価指数先物取引にあっては、レンジ取引又はミニ取引の別
 - (3) 新規の売付け若しくは新規の買付け又は転売若しくは買戻しの区別
 - (4) 限月間スプレッド取引により行おうとするときは、その旨
 - (5) 数量
 - (6) 値段の限度(限月間スプレッド取引にあってはスプレッド値段の限度)
 - (7) ストラテジー取引により行おうとするときは、デルタ値
 - (8) 立会時
 - (9) 委託注文の有効期間
- 2 前項の規定にかかわらず、同項第3号に掲げる事項の指示について、あらかじめ顧客が指定した方法に従い取り扱うことに取引参加者が同意している場合には、顧客は、その都度、当該事項の指示を行うことを要しない。この場合において、取引参加者は、当該事項について、当該顧客が指定した方法に従い取り扱うものとする。
- 3 第1項の規定にかかわらず、顧客は、取引参加者とあらかじめ合意することにより、同項第3号に掲げる事項の指示を取引が成立した取引日の終了する日の午後4時30分まで(半休日においては、午後0時30分まで)の取引参加者の指定する時限までに行うことができる。この場合において、顧客が取引参加者に当該取引参加者の指定する時限までに当該事項の指示を行わないときは、新規の売付け又は新規の買付けの指示を行ったものとみなす。

一部改正〔平成元年10月2日、平成9年5月16日、平成10年1月23日、平成10年10月5日、平成13年11月1日、平成13年12月1日、平成15年1月14日、平成18年12月31日、平成20年1月15日、平成20年1月15日、平成20年6月16日、平成21年10月5日〕

(ギブアップに係る委託の際の指示事項等)

第49条の2 前条の規定にかかわらず、顧客がギブアップに係る指数先物取引を委託する場合には、その都度、注文執行取引参加者に対し、同条第1項各号(第3号を除く。)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) ギブアップに係る指数先物取引である旨
- (2) 当該ギブアップに係る清算執行取引参加者の名称
- (3) 当該清算執行取引参加者において、当該ギブアップの成立により新たに発生する指数先物取

引の売付け又は買付けがいずれの顧客によるものかを確認するために必要な事項

- 2 前項の規定にかかわらず、顧客は注文執行取引参加者とあらかじめ合意することにより、同項各号に掲げる事項の指示を、ギブアップに係る取引が成立した取引日の終了する日の午後 4 時まで（半休日においては、正午まで）の注文執行取引参加者の指定する時限までに行うことができる。

追加〔平成20年 1 月 15 日〕、一部改正〔平成20年 6 月 16 日〕

（取引再開時における委託注文の効力）

- 第49条の 3 委託注文は、第49条又は前条に規定する顧客が指示した当該委託注文の有効期間内においては、当取引所が指数先物取引の停止を行った場合においても、その効力を有する。ただし、顧客が当該場合に委託注文を失効させる旨の指示を行っているときは、この限りでない。

追加〔平成10年 7 月 1 日〕、一部改正〔平成13年11月 1 日、平成20年 1 月 15 日、平成20年 6 月 16 日〕

（ギブアップが成立した場合の委託の効力）

- 第49条の 4 ギブアップに係る指数先物取引の売付け又は買付けが、当該ギブアップの成立により消滅した場合には、当該指数先物取引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、当該ギブアップの成立により新たに発生した指数先物取引の売付け又は買付けについての顧客と清算執行取引参加者との間の決済の委託が新たに成立するものとする。

追加〔平成20年 1 月 15 日〕、一部改正〔平成20年 6 月 16 日〕

（ギブアップに係る取引が成立した場合の転売・買戻しの指示）

- 第49条の 5 第49条の規定にかかわらず、当該ギブアップに係る指数先物取引についてギブアップが成立したときは、当該ギブアップに係る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対し、当該ギブアップに係る指数先物取引が成立した取引日の終了する日の午後 4 時30分まで（半休日においては、午後 0 時30分まで）の当該清算執行取引参加者の指定する時限までに、新たに発生した指数先物取引の売付け又は買付けに係る同条第 1 項第 3 号に掲げる事項を指示するものとする。この場合において、顧客が当該時限までに当該事項の指示を行わないときは、新規の売付け又は新規の買付けの指示を行ったものとみなす。

- 2 第49条第 2 項の規定は、ギブアップの成立により新たに発生する指数先物取引に係る同条第 1 項第 3 号に掲げる事項の指示について準用する。

追加〔平成20年 1 月 15 日〕、一部改正〔平成20年 6 月 16 日〕

第 2 節 証拠金等

一部改正〔平成10年11月30日〕

（証拠金）

- 第50条 証拠金に関する事項は、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。）をもって定める。

一部改正〔平成 2 年10月 1 日、平成 4 年 2 月 1 日、平成 6 年 2 月 14 日、平成 9 年10月 29 日、平成10年 1 月 23 日、平成10年 6 月 1 日、平成10年11月 30 日、平成13年11月 1 日、平成15年 1 月 14 日、平成16年 2 月 2 日〕

- 第51条から第57条まで 削除

一部改正〔平成10年11月30日〕

第 3 節 決済

一部改正〔平成 9 年10月 29 日〕

（決済のために授受する金銭）

- 第58条 顧客と取引参加者との間で指数先物取引の決済のために授受する金銭は、当該顧客が転売又は買戻しにより決済を行う場合には当該転売又は買戻しに相当する当該顧客の委託に基づく未決済約定に係る約定指数と当該転売又は買戻しに係る約定指数の差に相当する金銭とし、当該顧客の委託に基づく未決済約定が最終決済により決済される場合には当該顧客の委託に基づく未決済約定に係る約定指数と最終清算指数との差に相当する金銭とする。

- 2 顧客が指数先物取引の決済を行う場合において、損失が生じているときは、当該顧客は当該損失に相当する金銭を、転売又は買戻しにより決済を行う場合には当該決済に係る転売又は買戻しが成立した取引日の終了する日の翌日（当該顧客が非居住者（外国為替及び外国貿易法（昭和24年法律第228号）第 6 条第 1 項第 6 号に規定する非居住者をいう。以下この項において同じ。）である場合

は、当該取引日の終了する日から起算して 3 日目（休業日を除外する。以下日数計算について同じ。）の日）までの取引参加者が指定する日時までに、最終決済により決済される場合には当該限月取引の最終決済期日まで（当該顧客が非居住者である場合は、その翌日まで）の取引参加者が指定する日時までに、取引参加者に差し入れるものとする。

一部改正〔平成元年10月2日、平成9年10月29日、平成10年11月30日、平成11年10月1日、平成12年6月5日、平成13年11月1日、平成14年12月1日、平成15年1月6日、平成15年1月14日、平成20年6月16日〕

（証拠金の決済のために授受する金銭への充当）

第59条 取引参加者は、顧客が前条第2項の規定により当該取引参加者に差し入れるべき金銭については、当該顧客が当該差入れをすべき日において証拠金として差し入れ若しくは預託している金銭又は当該顧客に係る証拠金規則に定める計算上の利益額に相当する額の金銭をもって充てることができる。

一部改正〔平成元年10月2日、平成9年10月29日、平成10年11月30日、平成13年11月1日、平成16年2月2日〕

（顧客の決済不履行の場合の措置）

第60条 顧客が所定の時限までに、指数先物取引に関し取引参加者に差し入れるべき証拠金を差し入れない若しくは預託すべき証拠金を預託しない場合又は支払うべき金銭を支払わない場合は、当該取引参加者は、任意に、当該指数先物取引を決済するために、当該顧客の計算において、転売若しくは買戻し（これらの委託を含む。）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）に基づく口座に記録する金銭及び有価証券をもって、その損害の賠償に充当し、なお不足があるときは、その不足額の支払を顧客に対し請求することができる。

一部改正〔平成元年10月2日、平成10年11月30日、平成13年11月1日、平成15年1月6日、平成16年2月2日、平成20年6月16日、平成21年1月5日〕

第4節 未決済約定の引継ぎ等

追加〔平成9年11月5日〕、一部改正〔平成13年11月1日、平成15年1月6日、平成20年1月15日〕

（顧客の委託に基づく未決済約定の取扱い等）

第60条の2 顧客の委託に基づく未決済約定の引継ぎ等に関する事項は、証拠金規則をもって定める。

追加〔平成9年11月5日〕、一部改正〔平成10年11月30日、平成13年11月1日、平成15年1月6日、平成15年1月14日、平成16年2月2日、平成20年1月15日〕

第5節 雑則

追加〔平成9年11月5日〕、一部改正〔平成11年10月1日〕

（外貨による金銭の授受）

第61条 顧客と取引参加者との間における指数先物取引に係る金銭の授受は、取引参加者が同意した場合には、顧客が指定する外貨により行うことができるものとする。

一部改正〔平成元年10月2日、平成2年4月10日、平成9年6月1日、平成10年4月1日、平成11年10月1日、平成13年11月1日、平成20年6月16日〕

（取引の取消しの効果等）

第61条の2 当取引所が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、当取引所が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、過誤のある注文を発注した取引参加者に対して、その損害の賠償を請求できないものとする。ただし、過誤のある注文の発注に際して、取引参加者に故意又は重過失が認められる場合は、この限りでない。

3 顧客は、当取引所が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、当取引所に対して、その損害の賠償を請求できないものとする。ただし、当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。

追加〔平成19年9月30日〕

（受託契約準則の読替え）

第62条 指数先物取引に係る受託契約準則第2条の規定の適用については、同条中「取引参加者（取引所の総合取引参加者をいう。以下同じ。）」とあるのは「取引参加者（取引所の総合取引参加者又は指数先物等取引参加者をいう。）」とする。

一部改正〔平成元年10月2日、平成4年2月1日、平成11年10月1日、平成13年11月1日、平成20年6月16日〕

第4章 雑則

追加〔平成15年1月6日〕

（有価証券等清算取次ぎに対する適用）

第63条 指数先物取引に係る有価証券等清算取次ぎについては、有価証券等清算取次ぎを委託する取引参加者を当該指数先物取引を行う者とみなして第2章（第6節を除く。）の規定を適用する。

追加〔平成15年1月6日〕、一部改正〔平成15年1月14日、平成20年6月16日〕

付 則

- 1 この特例は、昭和63年8月26日から施行する。
- 2 第4条第2項本文及び同条第3項本文後段の規定にかかわらず、第1号から第4号までに掲げる日を最終決済期日とする限月取引の取引開始日は、昭和63年9月3日とし、第5号に掲げる日を最終決済期日とする限月取引の取引開始日は、昭和63年9月8日とする。
 - (1) 昭和63年12月12日
 - (2) 昭和64年3月10日
 - (3) 昭和64年6月12日
 - (4) 昭和64年9月11日
 - (5) 昭和64年12月11日

付 則

この改正規定は、昭和64年2月1日から施行する。

一部改正〔平成元年5月1日〕

付 則

この改正規定は、平成元年4月1日から施行し、同日以後の徴収分について適用する。

付 則

- 1 この改正規定は、平成元年5月1日から施行する。ただし、この改正規定施行の際平成元年6月12日を最終決済期日として行われている限月取引に係る取引については、なお従前の例による。
- 2 この改正規定施行の際、前項ただし書に規定する取引以外の現に行われている取引については、改正規定施行後においては、改正後の規定により行われた取引とみなす。
- 3 付則第1項ただし書に規定する取引以外の取引に係る午後立会の立会時については、本所が定める日まで、午後1時から3時15分までとする。

（注）第3項の「本所が定める日」は平成3年4月29日

付 則

この改正規定は、平成元年10月2日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成2年4月10日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成2年6月1日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成2年10月1日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成3年1月4日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成3年4月30日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成3年6月10日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成4年2月1日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成 4 年 3 月 23 日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成 4 年 7 月 20 日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成 5 年 4 月 1 日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成 6 年 2 月 14 日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成 6 年 4 月 1 日以降の日で、本所が定める日から施行する。

(注) 「本所が定める日」は平成 6 年 4 月 1 日

付 則

この改正規定は、平成 7 年 5 月 1 日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成 7 年 11 月 1 日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成 9 年 4 月 1 日から施行し、同日以後の徴収分について適用する。

付 則

この改正規定は、平成 9 年 5 月 16 日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成 9 年 6 月 1 日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成 9 年 10 月 29 日から施行する。ただし、第 35 条の 9 から第 35 条の 19 まで及び第 60 条の 2 から第 60 条の 6 までの改正規定は、平成 9 年 11 月 5 日から施行する。

一部改正〔平成 10 年 11 月 30 日〕

付 則

この改正規定は、平成 9 年 12 月 1 日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成 10 年 1 月 23 日から施行する。ただし、改正後の第 3 条第 3 号及び第 4 号並びに第 11 条第 3 項第 3 号及び第 4 号の規定は、本所が当該株価指数の上場について大蔵大臣に承認申請を行った日以降の日で、本所が定める日から施行する。

一部改正〔平成 10 年 11 月 30 日〕

(注) 第 3 条第 3 号及び第 11 条第 3 項第 3 号の「本所が定める日」は平成 10 年 3 月 13 日、第 3 条第 4 号及び第 11 条第 3 項第 4 号の「本所が定める日」は平成 10 年 4 月 10 日

付 則

この改正規定は、本所が定める日から施行する。

(注) 「本所が定める日」は平成 10 年 11 月 2 日

付 則

この改正規定は、平成 10 年 4 月 1 日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成 10 年 4 月 1 日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成 10 年 4 月 1 日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成 10 年 7 月 1 日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成 10 年 6 月 1 日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成 10 年 9 月 1 日以降の日で、本所が定める日から施行する。

(注) 「本所が定める日」は平成 10 年 11 月 2 日

付 則

この改正規定は、平成10年10月 5 日から施行する。

付 則

- 1 この改正規定は、平成10年11月30日から施行する。ただし、第25条の 4、第39条、第40条及び第42条の改正規定は、平成10年12月 1 日から、第10節の節名及び第36条の改正規定は、平成11年 4 月 1 日から施行する。
- 2 前項の規定にかかわらず、この改正規定施行の日に預託を行う取引証拠金及び差入れを行う委託証拠金については、なお従前の例による。
- 3 第 1 項の規定にかかわらず、平成10年11月26日及び27日における清算指数との差に係る第29条及び第30条に規定する正会員又は株価指数先物取引等特別参加者に係る金銭の授受は、同年12月 1 日に行うものとし、同年11月26日及び27日に成立した転売又は買戻しに係る第58条第 2 項及び改正前の第59条に規定する顧客に係る金銭の授受は、同年12月 1 日までの正会員又は株価指数先物取引等特別参加者が指定する日時までに行うものとする。
- 4 第36条の規定については、平成10年12月 1 日から平成11年 3 月31日までの間においては、同条中「正会員又は株価指数先物取引等特別参加者」とあるのは「正会員又は株価指数先物取引等特別参加者（金融システム改革のための関係法律の整備等に関する法律（平成10年法律第107号）附則第12条第 2 項に規定するみなし登録証券会社又は同第59条第 2 項に規定するみなし登録外国証券会社に限る。）」と、「行うものとする。」とあるのは「行うものとする。ただし、当該金銭を証券取引法第47条に定める方法により自己の固有財産と分別して保管している場合は、この限りでない。」と、「金銭又は有価証券（再預託に係る取引証拠金として本所に預託した金銭又は有価証券を除く。）」とあるのは「金銭又は有価証券」と、「売買取引等」とあるのは「売買等」とする。

付 則

この改正規定は、平成11年 1 月 1 日から施行する。

付 則

- 1 この改正規定は、平成11年 4 月 1 日から施行する。
- 2 この改正規定施行の日に行われた株価指数先物取引に課せられる取引所税に相当する金額の徴収については、なお従前の例による。

付 則

- 1 この改正規定は、平成11年 5 月 1 日から施行する。
- 2 この改正規定施行の際、現に改正前の定款第95条の 4 第 1 項の規定により選任されている売買システム売買責任者（改正前の立会場代表者等に関する規則第11条の 2 の規定により株価指数先物取引等売買システム取引責任者を選任している場合にあつては、当該者）及び現に改正前の定款第97条の11第 1 項において準用する同第95条の 4 の規定により選任されている株価指数先物取引等取引責任者については、施行日において、正会員又は株価指数先物取引等特別参加者が、改正後の第41条第 2 項の規定により、株価指数先物取引等責任者として選任及び届出をしたものとみなす。

付 則

- 1 この改正規定は、平成11年 5 月 1 日から施行する。
- 2 この改正規定施行の日（以下「施行日」という。）前に成立した株価指数先物取引で施行日において未決済のものについては、施行日をもって第26条の 2 の規定に基づく債務の引受けが行われたものとする。

付 則

この改正規定は、金融システム改革のための関係法律の整備等に関する法律（平成10年法律第107号）附則第 1 条第 3 号に定める政令で定める日から施行し、同日以後の取引分から適用する。

（注）「金融システム改革のための関係法律の整備等に関する法律（平成10年法律第107号）附則第 1 条第 3 号に定める政令で定める日」は平成11年10月 1 日

付 則

この改正規定は、平成11年10月 1 日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成12年 5 月 1 日以降の日で、本所が定める日から施行する。

（注）「本所が定める日」は平成12年 7 月17日

付 則

- 1 この改正規定は、平成12年6月5日から施行する。
- 2 改正後の第4条第2項第2号から第4号までの規定にかかわらず、この改正規定施行の際、現に行われている限月取引の取引期間は、なお従前の例による。
- 3 改正後の第4条第3項の規定にかかわらず、第3条第2号から第4号までに掲げる株価指数を対象とする株価指数先物取引において、この改正規定施行の際、現に行われている限月取引のうち最初に取引最終日が到来する限月取引及び当該限月取引の次に取引最終日が到来する限月取引の取引最終日の翌日には、新たな限月取引を開始しないものとする。

付 則

この改正規定は、平成12年12月1日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成13年4月1日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成13年5月31日までの本所が定める日から施行する。

(注)「本所が定める日」は平成13年5月1日

付 則

この改正規定は、平成13年6月10日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成13年6月11日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成13年11月1日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成13年12月1日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成14年2月1日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成14年12月1日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成15年1月6日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成15年1月14日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成15年9月16日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成16年2月2日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成16年6月30日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成17年2月7日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成18年5月1日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成18年5月1日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成18年12月31日までの当取引所が定める日から施行する。

(注)「当取引所が定める日」は平成18年12月31日

付 則

この改正規定は、平成19年9月30日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成19年9月30日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成19年10月 1 日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成20年 1 月 15日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成20年 1 月 15日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成20年 3 月 10日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成20年 6 月 16日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成20年 6 月 16日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成20年 7 月 7 日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成20年12月 15日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成21年 1 月 5 日から施行する。

付 則

この改正規定は、当取引所が定める日から施行する。

(注) 「当取引所が定める日」は平成21年10月 5 日