

有価証券オプション取引に関する業務規程、信用取引・貸借取引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、有価証券オプション取引及び有価証券オプション取引（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、信用取引・貸借取引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、信用取引・貸借取引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〕

(有価証券オプション取引に関する定義)

第 2 条 この特例において有価証券オプション取引とは、有価証券オプションを相手方が当事者の一方に付与し、当事者の一方がこれに対して対価を支払うことを約する取引をいう。

2 この特例において有価証券オプションとは、権利取得者（当該有価証券オプションを付与された者をいう。）の意思表示により当事者間において有価証券の売買を成立させることができる権利をいう。

3 この特例において権利行使とは、有価証券オプションの行使をいう。

一部改正〔平成10年12月1日、平成20年6月16日〕

(用語の意義)

第 3 条 この特例において使用する用語（有価証券の売買について使用する用語を除く。）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) 売付けとは、有価証券オプションを付与する立場の当事者となる取引をいい、買付けとは、有価証券オプションを取得する立場の当事者となる取引をいう。

(2) 値段とは、有価証券オプションの売付け又は買付けにおける対価となる額をいう。

(3) 値幅とは、値段の幅をいう。

(4) 呼値とは、有価証券オプション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い、次の a から c までに掲げるものをいう。

a 指値呼値

値段の限度を指定する呼値

b 成行呼値

立会時になされる値段の限度を指定しない呼値

c 寄付呼値

立会開始前又は当取引所が定めるところにより、特定の銘柄について取引が中断された場合の立会再開前になされる値段の限度を指定しない呼値をいい、第14条第5項（同条第6項の規定により読み替えて適用する場合を含む。）に規定するところにより、約定値段を定めた後に取引が成立しないときは、当該約定値段を値段の限度とする指値呼値になる呼値

(5) 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10年12月1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〕

第 2 章 業務規程の特例

第 1 節 取引の対象及び限月取引等

(取引の対象)

第 4 条 有価証券オプション取引の対象は、次条第 1 項各号に定める基準のいずれかに適合するものの中から当取引所が選定した有価証券（以下「対象有価証券」という。）に係る次の各号に掲げる有価証券オプションとする。

(1) 権利行使を行う場合の約定値段としてあらかじめ設定した価格（以下「権利行使価格」という。）で売買単位（業務規程第15条に規定する売買単位をいう。以下同じ。）の売付けを成立させることができる有価証券オプション

(2) 権利行使価格で売買単位の買付けを成立させることができる有価証券オプション

2 前項のほか、当取引所が対象有価証券の売買について、業務規程第25条第1項の規定により配当

落等の期日（普通取引に係るものに限る。剰余金の配当若しくは人的分割（分割に際し、分割する会社の株主に承継会社又は新設会社の株式の全部又は一部を交付する会社の分割をいう。以下同じ。）による有価証券を受ける権利のみに係る日を除く。）を定める場合若しくは同第25条の2の規定により株式併合後の株券の売買開始の期日（普通取引に係るものに限る。）を定める場合又は国内の他の金融商品取引所がこれらに相当する措置を行う場合において、当該配当落等の期日（以下「権利落の期日」という。）の前日（休業日に当たるときは、順次繰り上げる。以下同じ。）において設定されている銘柄のうち当取引所が定めるものについての当該権利落の期日以降の日における有価証券オプション取引の対象は、対象有価証券に係る次の各号に掲げる有価証券オプションとする。

(1) 権利行使価格で売買単位に当取引所が定める数値を乗じて得た数量の売付けを成立させることができる有価証券オプション

(2) 権利行使価格で売買単位に当取引所が定める数値を乗じて得た数量の買付けを成立させることができる有価証券オプション

3 有価証券オプション取引において、有価証券プットオプションとは、第1項第1号及び前項第1号に規定する有価証券オプションをいい、有価証券コールオプションとは、第1項第2号及び前項第2号に規定する有価証券オプションをいうものとする。

4 有価証券オプション取引において、銘柄とは、対象有価証券、権利行使日、権利行使価格及び最小単位の権利行使により成立する対象有価証券の売買に係る数量を同一とする有価証券プットオプション及び有価証券コールオプションをいうものとする。

一部改正〔平成10年12月1日、平成11年8月1日、平成13年4月1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21年11月16日〕

（対象有価証券の選定基準）

第5条 対象有価証券の選定基準は、次の各号に掲げる有価証券の区分に従い、当該各号に定めるところによる。

(1) 当取引所、株式会社大阪証券取引所又は株式会社名古屋証券取引所（以下「3取引所」という。）に上場されている株券

次のa又はbに適合すること。

a 次の(a)から(c)までに適合すること。

(a) 3取引所のいずれかにおいて市場第一部銘柄に指定されていること。

(b) 流通株式（有価証券上場規程第2条第96号に規定する流通株式をいう。以下同じ。）の数（当取引所に上場されていない株券にあっては、上場株式数。以下この号において同じ。）が10万単位（1単位は、業務規程第15条（当取引所に上場されていない有価証券にあっては、これに相当する規定）に定める売買単位をいう。以下同じ。）以上50万単位未満であること。

(c) 最近1年間（上場後1年未満の有価証券である場合には、上場日以降の期間。以下同じ。）の月平均売買高（当取引所の市場及び国内の他の金融商品取引所が開設する取引所金融商品市場における売買高の合計の月割高をいう。以下同じ。）が、原則として3,000単位以上であること。

b 次の(a)及び(b)に適合すること。

(a) 3取引所のいずれかにおいて市場第一部銘柄に指定されていること。

(b) 流通株式の数が50万単位以上であること。

(2) 3取引所以外の国内の金融商品取引所に上場されている株券（前号に掲げる有価証券を除く。）

次のa又はbに適合すること。

a 次の(a)から(c)までに適合すること。

(a) 株主数（1単位以上の株券を所有する者の数をいう。以下同じ。）が、2,200人以上であること。

(b) 上場株式数が10万単位以上50万単位未満であること。

(c) 最近1年間の月平均売買高が、原則として3,000単位以上であること。

b 次の(a)及び(b)に適合すること。

(a) 株主数が、2,200人以上であること。

- (b) 上場株式数が50万単位以上であること。
 - (3) E T F (有価証券上場規程第1001条第1号に規定するE T Fをいう。以下同じ。)及び不動産投資信託証券(同規程第1001条第35号に規定する不動産投資信託証券をいう。以下同じ。)次のa又はbに適合すること。
 - a 次の(a)から(c)までに適合すること。
 - (a) 投資主又は受益者の数(1単位以上の投資口又は受益権を所有する者の数をいう。以下同じ。)が、2,200人以上であること。
 - (b) 上場投資口数又は上場受益権口数が10万単位以上50万単位未満であること。
 - (c) 最近1年間の月平均売買高が、原則として3,000単位以上であること。
 - b 次の(a)及び(b)に適合すること。
 - (a) 投資主又は受益者の数が、2,200人以上であること。
 - (b) 上場投資口数又は上場受益権口数が50万単位以上であること。
 - 2 前項第1号aの(c)、第2号aの(c)及び第3号aの(c)の規定は、次の各号に掲げる有価証券については、当該有価証券の上場日の属する月の翌月末日までの間は、適用しない。
 - (1) 有価証券上場規程第208条又は1207条第1項の規定(当取引所に上場されていない有価証券にあっては、これに相当する規定)の適用を受けて上場される有価証券(当該規定に規定する行為の当事者の発行する有価証券が対象有価証券である場合に限る。)
 - (2) 上場会社が人的分割である新設分割により会社を設立する場合又は人的分割である吸収分割により他の会社に事業を承継させる場合においてその分割前の上場申請により上場される当該設立された会社又は事業を承継した会社の株券(当該上場会社の発行する株券が対象有価証券である場合に限る。)
 - (3) 有価証券上場規程第303条の規定(当取引所に上場されていない有価証券にあっては、これに相当する規定)の適用を受けて上場される株券(当該規定に規定する上場廃止となる銘柄に係る株式が対象有価証券である場合に限る。)
 - 一部改正〔平成10年3月1日、平成10年12月1日、平成11年8月1日、平成11年9月1日、平成11年11月10日、平成11年11月11日、平成12年3月1日、平成13年4月1日、平成13年10月1日、平成13年11月1日、平成18年5月1日、平成19年9月30日、平成19年11月1日、平成20年6月16日〕
- (限月取引及びその数)
- 第6条 有価証券オプション取引は、有価証券プットオプション及び有価証券コールオプションについて、毎月の第二金曜日(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 有価証券オプション取引は、4限月取引(直近の2限月取引とそれ以外の限月取引のうち3月、6月、9月及び12月に取引最終日が到来する直近の2限月取引)制とし、限月取引の期間は、3月、6月、9月及び12月に取引最終日が到来する限月取引にあっては8か月、その他の限月取引にあっては2か月とする。
 - 3 4限月取引のうち、最初に取引最終日が到来する限月取引の取引最終日の翌日(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、対象有価証券を新たに選定す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13年11月1日、平成20年1月15日、平成20年6月16日〕
- (権利行使価格及びその数)
- 第7条 有価証券オプション取引は、有価証券プットオプション及び有価証券コールオプションについて、各限月取引に設定する権利行使価格に区分して行うものとする。
- 2 前項に規定する権利行使価格は、対象有価証券1株(対象有価証券が株券以外の有価証券である場合にあっては1口。以下同じ。)につき、次に定める価格の刻みで設定する当該価格の刻みの整数倍の価格とし、当該限月取引の取引開始日に当取引所が定めるところにより5種類設定する。ただし、当取引所が必要と認める場合には、設定する権利行使価格及びその数を変更することができる。

権利行使価格		価格の刻み	
500円未満のもの		25円	
500円以上		50円	
1,000円	〃	2,000円	〃
2,000円	〃	5,000円	〃
5,000円	〃	1万円	〃
1万円	〃	5万円	〃
5万円	〃	10万円	〃
10万円	〃	20万円	〃
20万円	〃	50万円	〃
50万円	〃	100万円	〃
100万円	〃	200万円	〃
200万円	〃	500万円	〃
500万円	〃	1,000万円	〃
1,000万円	〃	2,000万円	〃
2,000万円	〃	5,000万円	〃
5,000万円以上のもの		500万円	

3 前項のほか、当取引所が定めるところにより、全部又は一部の限月取引について、新たな権利行使価格を設定することができる。

4 対象有価証券の売買に係る権利落の期日の前日において設定されている銘柄については、当該権利落の期日に当取引所が定めるところにより権利行使価格を変更する。

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

(ストラテジー取引)

第8条 総合取引参加者(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をいう。以下同じ。)は、次の各号に掲げる取引(以下「ストラテジー取引」という。)を、有価証券オプション取引参加者(同第2条第5項に規定する有価証券オプション取引参加者をいう。以下同じ。)は、第1号に掲げる取引を、それぞれ行うことができる。

(1) 対象有価証券を同一とする複数の銘柄の有価証券オプションの売付け又は買付けを同時に成立させる取引

(2) 対象有価証券(当取引所が定める有価証券に限る。)の売付け又は買付けと同時に成立させることを条件として行う当該対象有価証券に係る一又は複数の銘柄の有価証券オプションの売付け又は買付けを成立させる取引

2 ストラテジー売取引及びストラテジー買取引により成立する有価証券オプションの売付け又は買付けの組合せは、当取引所が定めるストラテジー取引の種類ごとに当取引所が定める。

3 取引参加者(総合取引参加者又は有価証券オプション取引参加者をいう。第3章を除き、以下同じ。)は、ストラテジー取引を行おうとするときは、当取引所が定めるストラテジー取引の値段の算出方法により得た数値(以下「ストラテジー値段」という。)を用いて呼値を行うものとする。

4 取引参加者は、第1項第2号に掲げる取引を行おうとするときは、当取引所が定める条件を付して呼値を行わなければならない。

5 ストラテジー取引において、ストラテジー売呼値とはストラテジー売取引に係る呼値をいい、ストラテジー買呼値とはストラテジー買取引に係る呼値をいう。

一部改正〔平成13年11月1日、平成16年2月2日、平成21年10月5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19年3月12日〕

(立会の区分及び立会時等)

第9条 有価証券オプション取引の立会は、午前立会及び午後立会に分ち、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。

- 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、有価証券オプション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、午後立会を行わない。

一部改正〔平成11年5月1日、平成13年11月1日、平成15年1月14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〕

(立会の臨時停止、臨時挙行)

- 第10条 当取引所は、必要があると認めるときは、有価証券オプション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11条 当取引所は、有価証券オプション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12条 有価証券オプション取引については、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13条 有価証券オプション取引は、競争取引によるものとする。

- 2 有価証券オプション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、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。
 - (3) 成行呼値は、それ以外の呼値に値段的に優先する。
 - (4) 前3号のほか、呼値の順位に関し必要な事項は、当取引所が定める。
- 3 ストラテジー取引に係る前項の規定の適用については、前項中「値段」とあるのは「ストラテジー値段」と、「売呼値」とあるのは「ストラテジー売呼値」と、「買呼値」とあるのは「ストラテジー買呼値」とする。

一部改正〔平成13年11月1日、平成20年6月16日、平成21年10月5日〕

(個別競争取引)

- 第14条 前条第1項の競争取引は、個別競争取引とする。

- 2 有価証券オプション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値段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) 立会開始時の約定値段
 - (2) 当取引所が定めるところにより、特定の銘柄について取引が中断された場合の中断後再開時の約定値段
- 3 前項各号の約定値段を定める場合においては、売呼値（指値呼値に限る。以下この項及び次項において同じ。）の競合、買呼値（指値呼値に限る。以下この項及び次項において同じ。）の競合、売呼値及び買呼値の争合により、次の各号に掲げる区分に応じて当該各号に定める値段を約定値段とし、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。ただし、第1号及び第4号に定める平均値が最小の呼値の単位の整数倍の数値にならない場合は、当該平均値が正の場合には当該平均値より低い数値のうち最も高い最小の呼値の単位の整数倍の数値とし、当該平均値が負の場合には当該平均値より高い数値のうち最も低い最小の呼値の単位の整数倍の数値とする。
 - (1) すべての売呼値及び買呼値について取引が成立するとき
すべての売呼値の値段のうち最も高い値段と、すべての買呼値のうち最も低い値段の平均値
 - (2) すべての買呼値について取引が成立するが一部の売呼値については取引が成立しないとき

取引が成立する売呼値の値段のうち最も高い値段

- (3) すべての売呼値について取引が成立するが一部の買呼値については取引が成立しないとき
取引が成立する買呼値の値段のうち最も低い値段

- (4) 売呼値及び買呼値双方に残数量が発生するとき

次の a 及び b に掲げる値段の平均値

a 取引が成立する買呼値の値段のうち最も低い値段と、取引が成立しない売呼値のうち最も低い値段を比較して低い方の値段

b 取引が成立する売呼値の値段のうち最も高い値段と、取引が成立しない買呼値の値段のうち最も高い値段を比較して高い方の値段

- 4 前項の規定により約定値段を定める場合において、売付け及び買付けを行おうとする寄付呼値がともに行われ、かつ、次の各号のいずれかの数値があるときは、当該数値を約定値段として呼値の順位に従って、対当する寄付呼値の間に取引を成立させる。ただし、第 2 号に掲げる数値が第 15 条第 7 項に定める値段となる場合は、当該数値はないものとして、取引を成立させないものとする。

(1) 前項各号に定める約定値段

(2) 前項各号に定める約定値段がない場合は、買呼値の値段のうち最も高い値段と、売呼値の値段のうち最も低い値段の平均値。ただし、平均値が最小の呼値の単位の整数倍の数値にならないときは、当該平均値が正の場合には当該平均値より低い数値のうち最も高い最小の呼値の単位の整数倍の数値、当該平均値が負の場合には当該平均値より高い数値のうち最も低い最小の呼値の単位の整数倍の数値

(3) 前 2 号に掲げる数値がない場合は、当取引所が定める値段

- 5 前項に定めるところに従って取引が成立しなかった寄付呼値は、前項各号のいずれかの数値が定まった後は、当該数値を値段の限度として行われた指値呼値とし、前項各号のいずれの数値もない場合は、その効力を失うものとする。

- 6 ストラテジー取引における第 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「約定値段」とあるのは「ストラテジー取引の約定値段」と、第 2 項から第 4 項までの規定中「売呼値」とあるのは「ストラテジー売呼値」と、「買呼値」とあるのは「ストラテジー買呼値」と、第 2 項、第 3 項及び前項中「値段」とあるのは「ストラテジー値段」と、第 2 項及び第 3 項中「前条第 2 項」とあるのは「前条第 3 項の規定により読み替えて適用する同条第 2 項」と、第 4 項中「売付け」とあるのは「ストラテジー売取引」と、「買付け」とあるのは「ストラテジー買取引」と、「第 15 条第 7 項」とあるのは「第 15 条第 8 項の規定により読み替えて適用する同条第 7 項」とする。

- 7 ストラテジー取引が成立したときは、その組合せに従い成立する有価証券オプションの売付け又は買付けに係る約定値段は、ストラテジー取引の約定値段に基づき当取引所が定める。

一部改正〔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 19 年 3 月 12 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〕

(取引の取消し)

第 14 条の 2 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15条 取引参加者は、有価証券オプション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 有価証券オプション取引の呼値は、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 有価証券オプション取引の呼値の単位は、対象有価証券1株につき、有価証券オプション取引の呼値の値段に応じて、次に定めるところによる。

有価証券オプション取引の呼値の値段		呼値の単位
	1,000円未満の場合	50銭
1,000円以上	3,000円〃	1円
3,000円〃	30,000円〃	5円
30,000円〃	50,000円〃	25円
50,000円〃	100,000円〃	50円
100,000円〃	1,000,000円〃	500円
	1,000,000円以上の場合	5,000円

- 4 売買単位の数が奇数である対象有価証券に係る有価証券オプション取引における前項の規定の適用については、有価証券オプション取引の呼値の値段が1,000円未満の場合の呼値の単位について「50銭」とあるのは「1円」とする。
- 5 ストラテジー取引における呼値の単位は、対象有価証券1株につき、ストラテジー取引の呼値のストラテジー値段に応じて、次に定めるところによる。

ストラテジー取引の呼値のストラテジー値段		呼値の単位
-1,000円以上	1,000円未満の場合	50銭
1,000円以上	3,000円未満の場合	1円
又は-3,000円以上	-1,000円未満の場合	
3,000円以上	30,000円未満の場合	5円
又は-30,000円以上	-3,000円未満の場合	
30,000円以上	50,000円未満の場合	25円
又は-50,000円以上	-30,000円未満の場合	
50,000円以上	100,000円未満の場合	50円
又は-100,000円以上	50,000円未満の場合	
100,000円以上	1,000,000円未満の場合	500円
又は-1,000,000円以上	-100,000円未満の場合	
	1,000,000円以上の場合	5,000円
	又は-1,000,000円未満の場合	

- 6 売買単位の数が奇数である対象有価証券に係るストラテジー取引における前項の規定の適用については、ストラテジー取引の呼値のストラテジー値段が-1,000円以上1,000円未満の場合の呼値の単位について「50銭」とあるのは「1円」とする。
- 7 有価証券オプション取引の呼値は、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。
- 8 ストラテジー取引における前項の規定の適用については、「値段」とあるのは「ストラテジー値段」とする。
- 9 この特例に定めるもののほか、有価証券オプション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10年3月1日、平成10年4月13日、平成10年11月2日、平成12年7月17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15年1月14日、平成20年

1 月 15 日、平成 20 年 6 月 16 日、平成 20 年 7 月 22 日、平成 21 年 10 月 5 日]

(インプライドイン)

第 15 条の 2 当取引所は、当取引所が定める種類のストラテジー取引において、ストラテジー取引の対象となる有価証券オプション取引の呼値を組み合わせたことにより、当該組み合わせた呼値を当該ストラテジー取引の呼値に対当する呼値として取り扱うことができる。ただし、売買システムの稼働に支障が生じた場合その他当取引所が必要と認めた場合は、この限りでない。

追加〔平成 21 年 10 月 5 日〕

(インプライドアウト)

第 15 条の 3 当取引所は、当取引所が定める種類のストラテジー取引について、ストラテジー取引及びその対象となる有価証券オプション取引の呼値の状況に応じ、当該ストラテジー取引の呼値を当該ストラテジー取引の対象となる有価証券オプション取引における呼値として取り扱うことができる。ただし、売買システムの稼働に支障が生じた場合その他当取引所が必要と認めた場合は、この限りでない。

追加〔平成 21 年 10 月 5 日〕

(リクエスト・フォー・クォート)

第 15 条の 4 取引参加者は、有価証券オプション取引を行おうとする場合に呼値の状況が当該取引を行うために十分でないときは、他の取引参加者に対し、立会時において当該有価証券オプション取引の呼値の提示を求めること（以下「リクエスト・フォー・クォート」という。）ができる。

2 当取引所は、呼値について、その存在を周知させることができる。

3 当取引所は、取引参加者がリクエスト・フォー・クォートを行うことが適当でないことを認めた場合には、リクエスト・フォー・クォートの提示を停止することができる。

4 前 3 項に定めるもののほか、有価証券オプション取引に係るリクエスト・フォー・クォートに関し必要な事項については、当取引所が別に定めるところによる。

追加〔平成 21 年 10 月 5 日〕

(取引単位)

第 16 条 有価証券オプション取引は、有価証券プットオプション又は有価証券コールオプション 1 単位を最小単位として行う。

一部改正〔平成 20 年 6 月 16 日〕

(約定値段の公表)

第 17 条 当取引所は、有価証券オプション取引が成立したときは、当取引所が定めるところにより、その約定値段（ストラテジー取引にあつては、そのストラテジー取引の約定値段）を公表する。

一部改正〔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、平成 21 年 10 月 5 日〕

(取引の通知及び確認)

第 18 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、有価証券オプション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 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〕

(取引の停止)

第 19 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、有価証券オプション取引を停止することができる。

(1) 対象有価証券について、業務規程第 29 条若しくは T o S T N e T 市場に関する業務規程及び受託契約準則の特例第 19 条の規定により売買の停止が行われた場合又は国内の他の金融商品取引所が開設する取引所金融商品市場におけるこれに相当する措置が行われた場合

(2) 有価証券オプション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ことを認める場合

(3) 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 10 年 12 月 1 日、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対象有価証券の売買

一部改正〔平成13年 6 月10日、平成19年 3 月12日、平成20年 1 月15日、平成21年10月 5 日〕

(ストラテジー取引による対象有価証券の売買の成立)

第20条 ストラテジー取引(第 8 条第 1 項第 2 号に掲げる取引に限る。以下この条において同じ。)の対象有価証券の売買は、ストラテジー売呼値とストラテジー買呼値とが対当し、かつ、同条第 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売買立会による売買によらずに成立する。

- 2 前項の規定における有価証券の売買に係る業務規程の適用については、これを普通取引とする。
- 3 前 2 項のほか、ストラテジー取引により成立する対象有価証券の売買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21条から第29条まで 削除

一部改正〔平成13年 6 月10日、平成19年 3 月12日、平成20年 1 月15日、平成21年10月 5 日〕

第 4 節 過誤訂正等のための取引

(過誤訂正等のための取引)

第30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 ストラテジー取引についての前 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「ストラテジー売取引」と、「買付け」とあるのは「ストラテジー買取引」と、第 1 項中「値段」とあるのは「ストラテジー値段」とする。

一部改正〔平成13年11月 1 日、平成15年 1 月 6 日、平成19年 3 月12日、平成20年 1 月15日、平成21年10月 5 日〕

第 5 節 権利行使

一部改正〔平成15年 1 月14日〕

(権利行使日等)

第31条 有価証券オプション取引における権利行使日は、各銘柄の取引最終日とする。

- 2 前項の規定にかかわらず、当取引所が必要と認める場合には、全部又は一部の銘柄について権利行使日(前項に規定する権利行使日をいう。以下同じ。)を変更することができる。
- 3 有価証券オプション取引における権利行使により成立する対象有価証券の売買については、権利行使日から起算して 5 日目の日(権利行使日が対象有価証券の売買に係る業務規程第25条第 1 項に規定する配当落等の期日(普通取引に係るものに限る。以下同じ。))若しくは同第25条の 2 に規定する株式併合後の株券の売買開始の期日(普通取引に係るものに限る。以下同じ。))又は国内の他の金融商品取引所が開設する取引所金融商品市場におけるこれらに相当する日の前日に当たるときは、権利行使日から起算して 4 日目の日)に決済を行うものとする。

一部改正〔平成15年 1 月14日、平成20年 6 月16日、平成21年11月16日〕

(権利行使の停止)

第32条 当取引所は、有価証券オプション取引が停止された場合又は当取引所が取引の管理上権利行使を行わせることが適当でないとする場合には、全部又は一部の銘柄について権利行使を停止することができる。

追加〔平成15年 1 月14日〕、一部改正〔平成20年 6 月16日〕

(有価証券オプションの消滅)

第33条 権利行使日において、権利行使の申告が行われなかつた有価証券プットオプション及び有価証券コールオプションは、当取引所が定める時限に消滅するものとする。

追加〔平成15年 1 月14日〕、一部改正〔平成20年 6 月16日〕

第 6 節 ギブアップ

追加〔平成20年 1 月15日〕

(ギブアップ)

第34条 取引参加者は、有価証券オプション取引（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有価証券オプション取引を除く。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、有価証券オプション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有価証券オプション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有価証券オプション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、有価証券オプション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35条 注文執行取引参加者は、有価証券オプション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36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い場合には、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37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7節から第9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38条から第42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10節 雑則

一部改正〔平成9年11月5日〕

(上場廃止等)

第43条 対象有価証券について、いずれの国内の金融商品取引所においても上場されなくなる場合には、当取引所が定める日に、当該対象有価証券に係る有価証券オプションの上場を廃止する。

2 同一の対象有価証券に係る有価証券オプションを対象とする有価証券オプション取引について、毎年3月末日からさかのぼって1年間に取引が成立していない場合で、当取引所が当該有価証券オ

プシヨンの上場の継続を必要としないと認めたときは、当取引所が定める日に、当該対象有価証券に係る有価証券オプションの上場を廃止する。

- 3 前2項の場合において、当該有価証券オプションを対象とする有価証券オプション取引（過誤訂正等のための取引を含む。以下第46条までにおいて同じ。）の限月取引及びその数は、第6条の規定にかかわらず、当取引所が別に定めるところによる。
- 4 有価証券オプション取引における対象有価証券の発行者が人的分割を行う場合において、当該対象有価証券に係る有価証券オプションを対象とする有価証券オプション取引の限月取引及びその数は、第6条の規定にかかわらず、当取引所が別に定めるところによる。

一部改正〔平成13年4月1日、平成13年11月1日、平成15年2月1日、平成18年12月31日、平成19年9月30日、平成19年11月1日、平成20年1月15日、平成20年6月16日〕

（自己計算による取引の制限及び大口建玉の報告）

第44条 取引参加者は、同一の対象有価証券に係る有価証券オプションを対象とする有価証券オプション取引を行う場合には、自己の計算による次の各号に掲げる数量が、第3項に規定する制限数量を超えることとなる新規の売付け若しくは新規の買付け又は転売（各銘柄の権利行使に係る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（以下「買建玉」という。）についての反対の取引をいう。以下同じ。）若しくは買戻し（各銘柄の建玉のうち売付けの約定に係る数量（以下「売建玉」という。）についての反対の取引をいう。以下同じ。）を行ってはならない。この場合において、当該対象有価証券に係る有価証券オプションが、国内の他の金融商品取引所が開設する取引所金融商品市場における有価証券オプション取引の対象であるときは、当該有価証券オプション取引における建玉の数量を、次の各号に掲げる数量に含めるものとする。

- (1) 有価証券プットオプションに係る売建玉と買建玉の差引数量
- (2) 有価証券コールオプションに係る売建玉と買建玉の差引数量
- (3) 前2号に掲げる差引数量のうち、いずれか一方において売建玉が買建玉を超え、他方において買建玉が売建玉を超えている場合には、第1号の差引数量に前号の差引数量を加えた数量

2 前項各号の規定にかかわらず、次の各号に掲げる場合には、当該各号に定める数量を前項各号に規定する数量から減じるものとする。

- (1) 当該対象有価証券を所有している場合その他の場合で、前項各号の数量の全部又は一部について、当該対象有価証券の価格の変動により発生し得る危険が消滅又は減少するものとして当取引所が認めたときは、当該全部又は一部の数量
- (2) 当該対象有価証券に係る有価証券オプションを対象とする有価証券オプション取引において、顧客の注文を執行するために必要と認められる売付け又は買付けを行った場合には、当該売付け又は買付けに係る建玉の数量

3 第1項に規定する制限数量は、対象有価証券の3月末日（以下この項において「基準日」という。）現在における上場有価証券の数（対象有価証券の上場日が基準日後の日である場合には、当取引所がその都度定める日現在における上場有価証券の数をいう。）又は国内の他の金融商品取引所が開設する取引所金融商品市場におけるこれに相当する数の1%（基準日からさかのぼって1年間における対象有価証券の当取引所の市場及び国内の他の金融商品取引所が開設する取引所金融商品市場における年間売買高の合計（対象有価証券の上場日が基準日の1年前の応当日の翌日後の日である場合には、最近の対象有価証券の売買高を勘案して当取引所がその都度定める。）が上場有価証券の数又は国内の他の金融商品取引所が開設する取引所金融商品市場におけるこれに相当する数の10%未満の場合にあっては、0.7%）に当たる有価証券の数に相当する取引単位（100単位の数量に満たない端数は切り捨てる。）とし、当該制限数量は、基準日以降の当取引所がその都度定める日から起算して、原則として1年間適用する。

4 前項の規定にかかわらず、当取引所は、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。）の業務方法書の規定により建玉の変更が行われた場合その他対象有価証券の売買状況等を勘案して当取引所が必要と認める場合は、対象有価証券の上場有価証券の数、取引単位その他の事項を勘案して制限数量をその都度定めることができる。

5 取引参加者は、自己の計算による第1項各号に掲げる数量（第2項第1号に該当する場合には、同号に定める数量を減じた数量。以下この項において同じ。）又は一の顧客の委託に基づく第1項

各号に掲げる数量が、当取引所が報告数量として定める数値以上となったときは、当取引所が定めるところにより、その内容を当取引所に報告するものとする。

一部改正〔平成10年1月23日、平成10年3月1日、平成10年12月1日、平成11年8月1日、平成12年7月1日、平成13年10月1日、平成13年11月1日、平成13年12月1日、平成16年2月2日、平成18年12月31日、平成19年9月30日、平成19年11月1日、平成20年6月16日、平成21年1月5日〕

第45条 削除

一部改正〔平成9年10月29日、平成11年4月1日〕

(取引に関する通知書の送付)

第46条 取引参加者は、有価証券オプション取引に係る未決済勘定がある顧客に対して、当該有価証券オプション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、対象有価証券、有価証券プットオプション又は有価証券コールオプションの別、限月取引、権利行使価格、最小単位の権利行使により成立する対象有価証券の売買に係る数量、売付け又は買付けの別、取引契約数量、約定値段、取引成立日、当該限月取引の取引最終日及び当該限月取引の権利行使日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つ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。)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つたときは、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つてしてはならない。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10年12月1日、平成13年11月1日、平成14年2月1日、平成15年1月14日、平成19年9月30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〕

(権利行使の割当て及び顧客への割当て通知)

第47条 取引参加者は、クリアリング機構の業務方法書の規定に基づき顧客の委託に基づく建玉についての権利行使の割当ての通知を受けた場合には、あらかじめ定めた方法により、顧客に対して直ちに権利行使の割当てを行うものとする。

2 前項の場合において、取引参加者は、当該顧客に当該割当てに係る銘柄及び数量を速やかに通知するものとする。

一部改正〔平成10年11月2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〕

(当取引所の市場における有価証券オプション取引又はその受託に関する規制措置)

第48条 当取引所は、当取引所の市場における有価証券オプション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有価証券オプション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13年11月1日、平成20年6月16日〕

(公開買付期間中における取引参加者の自己買付け等)

第49条 金融商品取引法施行令(昭和40年政令第321号。)第12条第2号及び同第14条の3の7第5号に規定する金融商品取引所の定める規則において有価証券の流通の円滑化を図るため認められている買付け等は、当取引所の市場における次の各号に掲げる有価証券コールオプションの買付けとする。

(1) 第30条の規定による過誤訂正等のための買付け

(2) 顧客の注文を執行する際に生じた過誤による買付け等で当取引所が真にやむを得ない事由が

あると認めるもの

一部改正〔平成10年12月1日、平成13年7月1日、平成13年11月1日、平成17年4月1日、平成18年12月13日、平成19年3月12日、平成19年9月30日、平成20年6月16日〕

第50条 削除

一部改正〔平成10年12月1日、平成11年5月1日〕

第51条 削除

一部改正〔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有価証券オプション取引の方法等)

第52条 取引参加者は、当取引所の市場における有価証券オプション取引を、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有価証券オプション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、当該有価証券オプション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有価証券オプション取引責任者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、有価証券オプション取引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、有価証券オプション取引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53条から第55条まで 削除

一部改正〔平成13年6月10日、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56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、有価証券オプション取引について、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、当該呼値により有価証券オプション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項の規定による有価証券オプション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〕

(業務規程の適用除外)

第57条 有価証券オプション取引における権利行使により成立する対象有価証券の売買については、業務規程第9条の規定は適用しない。

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

(業務規程の読替え)

第58条 有価証券オプション取引に係る業務規程第76条及び第77条の2の規定の適用については、これらの規定中「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5項に規定する有価証券オプション取引参加者をいう。)」とする。

一部改正〔平成11年5月1日、平成11年5月1日、平成11年10月1日、平成13年4月27日、平成13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 信用取引・貸借取引規程の特例

一部改正〔平成13年11月1日〕

(権利行使等に伴う貸借取引)

第59条 信用取引・貸借取引規程第11条の規定にかかわらず、総合取引参加者は、有価証券オプション取引の権利行使により成立する対象有価証券(信用取引・貸借取引規程第10条第1項に規定する貸借銘柄であるものに限る。)の売買(制度信用取引(信用取引・貸借取引規程第2条第1項に規

定する制度信用取引をいう。)に基づくもの又は自己の信用売り若しくは信用買いに係るものに限る。)及びストラテジー取引(第8条第1項第2号に掲げる取引に限る。次条において同じ。)により成立する対象有価証券の売買に係る決済(第4条第2項に規定する有価証券オプションを対象とする有価証券オプション取引における権利行使である場合には、清算・決済規程第25条第1項第1号b及び第2号又はクリアリング機構が定める業務方法書第55条第1項第1号b及び第2号に規定する金銭の授受を除く。)のために、信用取引・貸借取引規程第1条第1項に定める貸借取引を行うことができる。

一部改正〔平成10年11月2日、平成10年12月1日、平成10年12月1日、平成13年5月1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6月16日、平成21年10月5日〕

(権利行使等に係る自己の信用売り又は信用買いの決済期限)

第59条の2 総合取引参加者は、自己の信用売り若しくは信用買いに係る対象有価証券の売買(有価証券オプション取引の権利行使により成立するものに限る。)を行った場合は、権利行使日の翌日(権利行使日が対象有価証券の売買に係る業務規程第25条第1項に規定する配当落等の期日若しくは同第25条の2に規定する株式併合後の株券の売買開始の期日又はこれらに相当する日の前日に当たるときは、権利行使日)の6か月目の応当日(応当日がないときは、その月の月末とし、応当日が休業日に当たるときは、順次繰り上げる。以下同じ。)から起算して4日目(休業日を除外する。以下日数計算について同じ。)の日までに、当該信用売り又は信用買いの決済を行わなければならない。

2 総合取引参加者は、自己の信用売り若しくは信用買いに係る対象有価証券の売買(ストラテジー取引により成立するものに限る。)を行った場合は、売買成立の日の6か月目の応当日から起算して4日目の日までに当該信用売り又は信用買いの決済を行わなければならない。

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

(信用取引・貸借取引規程の読替え)

第60条 有価証券オプション取引に係る信用取引・貸借取引規程第3条、第5条から第7条まで及び第14条の規定の適用については、これらの規定中「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5項に規定する有価証券オプション取引参加者をいう。)」と、同第14条の規定中「この規程(第12条を除く。)」とあるのは「第3条、第5条から第7条までの規定」とする。

一部改正〔平成10年12月1日、平成13年11月1日、平成15年1月14日、平成20年6月16日〕

第4章 受託契約準則の特例

第1節 有価証券オプション取引の受託

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61条 顧客が有価証券オプション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有価証券オプション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 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 61 条の 2 顧客がギブアップに係る有価証券オプション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有価証券オプション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有価証券オプション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有価証券オプション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有価証券オプション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有価証券オプション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有価証券オプション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つては、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、ギブアップに係る有価証券オプション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〕

(米国顧客に対する開示資料の交付等)

第 61 条の 3 取引参加者は、アメリカ合衆国に住所又は居所を有する顧客から有価証券オプション取引の委託を受けようとするときは、あらかじめ、当該顧客に対し、取引の特徴、制度の仕組み等有価証券オプション取引に関する当取引所が必要と認める事項を記載した当取引所所定の書面を交付しなければならない。

- 2 前項の場合において、取引参加者は、当該顧客から、あらかじめ当取引所が必要と認める事項を記載した当取引所所定の確認書の提出を受けなければならない。

追加〔平成 11 年 8 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〕

(顧客の通告事項)

第 62 条 顧客が有価証券オプション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13年11月1日、平成20年6月16日〕

(委託の際の指示事項)

第63条 顧客が有価証券プットオプション又は有価証券コールオプションの売付け又は買付けを委託する場合には、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) 対象有価証券
 - (2) 有価証券プットオプション又は有価証券コールオプションの別
 - (3) 限月取引
 - (4) 権利行使価格
 - (5) 前4号に掲げる事項を同一とする銘柄が複数ある場合には、最小単位の権利行使により成立する対象有価証券の売買に係る数量
 - (6) 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
 - (7) ストラテジー取引により行おうとするときは、その旨
 - (8) 数量
 - (9) 値段の限度（ストラテジー取引にあつては、ストラテジー値段の限度）
 - (10) 呼値の種類
 - (11) 呼値に条件を付すときは、その条件
 - (12) 立会時
 - (13) 委託注文の有効期間
- 2 前項の規定にかかわらず、同項第6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6号に掲げる事項の指示を当日の午後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10年12月1日、平成13年11月1日、平成18年12月31日、平成19年3月12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1月5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63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有価証券オプション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6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) ギブアップに係る有価証券オプション取引である旨
 - (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有価証券オプション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、平成21年1月5日〕

(取引再開時における委託注文の効力)

第63条の3 委託注文は、第63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、当取引所が有価証券オプション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63条の4 ギブアップに係る有価証券オプション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、当該有価証券オプション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有価証券オプション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63条の5 第63条の規定にかかわらず、当該ギブアップに係る有価証券オプション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有価証券オプション取引が成立した日の午後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、新たに発生した有価証券オプション取引の売付け又は買付けに係る同条第1項第6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63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有価証券オプション取引に係る同条第1項第6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〕

(ストラテジー取引の委託の際の指示事項)

第63条の6 受託契約準則第6条第1項の規定にかかわらず、顧客がストラテジー取引(第8条第1項第2号に掲げる取引に限る。)により、その対象となる有価証券の売買を委託する場合には、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) 売付け又は買付けの区別

(2) 値段

(3) デルタ値

(4) 信用取引により行おうとするときは、その旨

(5) 信用取引により貸付けを受けた買付代金又は売付有価証券の弁済のために行おうとするときは、その旨

(6) 顧客が取次者(取引参加者に有価証券の売買の委託をした顧客が、金融商品取引業者である場合であって、当該委託が取引参加者に対する有価証券の売買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。)である場合において、信用取引に係る売買の委託の取次ぎを引き受けたときは、その旨

(7) 顧客が取次者である場合において、信用取引により貸付けを受けた買付代金又は売付有価証券の弁済に係る売買の委託の取次ぎを引き受けたときは、その旨

2 信用取引口座を有する顧客が前項の規定における有価証券の売買の委託につき、前項第4号の指図を行わなかった場合には、当該売買は信用取引によることができない。

追加〔平成21年10月5日〕

第2節 証拠金等

一部改正〔平成10年11月30日〕

(証拠金)

第64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9年10月29日、平成10年6月1日、平成10年11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14日、平成16年2月2日〕

第65条から第70条まで 削除

一部改正〔平成10年11月30日〕

(取引代金の差入れ)

第71条 顧客は、有価証券オプション取引の買付けの委託については、当該買付けに係る取引代金を、取引成立の日の翌日(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。))である場合は、当該取引成立の日から起算して3日目(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10年11月30日、平成11年10月1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]

(証拠金の決済のために授受する取引代金への充当)

第71条の2 取引参加者は、顧客が前条の規定により当該取引参加者に差し入れるべき取引代金については、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。

追加〔平成10年11月30日〕、一部改正〔平成13年11月1日、平成16年2月2日〕

第3節 顧客の権利行使等

(権利行使の指示)

第72条 顧客は、有価証券オプション取引における権利行使を委託する場合には、銘柄ごとに権利行使に係る数量を、権利行使日の午後4時まで取引参加者に指示するものとする。

2 権利行使日において次の各号に定める場合に該当する銘柄については、前項に規定する時限までに同項の指示が行われないうちであっても、当該指示が行われたものとみなす。ただし、当該銘柄について、顧客が当該時限までに権利行使を行わない旨の指示を行った場合には、この限りでない。

(1) 有価証券プットオプションについては、権利行使価格がオプション清算値段(クリアリング機構の業務方法書に規定するオプション清算値段をいう。以下同じ。)を上回っている場合

(2) 有価証券コールオプションについては、権利行使価格がオプション清算値段を下回っている場合

3 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、前項本文の規定により権利行使の申告が行われたものとみなすことが適当でないとき、当該取引所が認めるときは、同項本文の規定は適用しないものとする。

一部改正〔平成11年9月1日、平成13年11月1日、平成14年12月1日、平成15年1月14日、平成16年2月2日、平成19年3月12日、平成20年1月15日、平成20年6月16日〕

(顧客の受渡時限等)

第73条 顧客が前条第1項に規定する指示を行った場合及び有価証券オプション取引における権利行使の割当てを受けた場合に成立する対象有価証券の売買については、権利行使日から起算して5日目(権利行使日が当該対象有価証券の売買に係る業務規程第25条第1項に規定する配当落等の期日又は同第25条の2に規定する株式併合後の株券の売買開始の期日の前日に当たる場合には、権利行使日から起算して4日目)の日の午前9時まで、当該権利行使により成立する対象有価証券の売買に係る売付有価証券又は買付代金を取引参加者に交付するものとし、当該権利行使により成立する対象有価証券の売買に係る受託契約準則の適用については、これを普通取引により当該対象有価証券の売付け又は買付けを委託し、当該委託に係る契約が締結されたものとみなす。

2 前項の規定にかかわらず、取引参加者が権利行使の受託又は割当てに際し、クリアリング機構が定める決済時限までの間の日時を別に指定した場合には、顧客は、その日時までに、売付有価証券又は買付代金を取引参加者に交付するものとする。

一部改正〔平成10年12月1日、平成10年12月1日、平成11年5月1日、平成11年9月1日、平成13年4月24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16年5月6日、平成20年6月16日、平成21年1月5日、平成21年11月16日〕

(DVP決済を利用する場合の顧客の受渡し)

第73条の2 顧客が第72条第1項に規定する指示を行った場合及び有価証券オプション取引における権利行使の割当てを受けた場合に成立する対象有価証券の売買について、顧客と取引参加者との合意により、株式会社ほふりクリアリング(以下「ほふりクリアリング」という。)の業務方法書に規定するDVP決済を利用する場合には、顧客は、前条第1項に定める日のほふりクリアリングが定める決済時限(有価証券の引渡しについては、合意に際して取引参加者が指定したクリアリング機構が定める決済時限までの間の日時)までに、ほふりクリアリングに有価証券を引き渡し又は資金を支払うものとする。

2 顧客が前項の規定に基づき有価証券の引渡し又は資金の支払いをした場合は、当該有価証券の引渡し又は資金の支払いは、前条第1項の売付有価証券の交付又は買付代金の交付とみなす。

追加〔平成16年5月6日〕、一部改正〔平成20年6月16日、平成21年1月5日〕

(決済のために交付する有価証券又は金銭の特例)

第74条 顧客が有価証券オプション取引における権利行使を委託した又は権利行使の割当てを受けた銘柄が、最小単位の権利行使により成立する対象有価証券の売買に係る数量が当該対象有価証券の売買単位でない銘柄である場合には、当該銘柄を対象とする有価証券オプション取引における権利行使の委託の指示を行った場合又は権利行使の割当てを受けた場合に成立する対象有価証券の売買の決済のために当該顧客が取引参加者に交付する金銭又は有価証券は、次の各号に定める区分に従い、当該各号に定めるところによる。

(1) 最小単位の権利行使により成立する対象有価証券の売買に係る数量が当該対象有価証券の売買単位を上回る場合において、権利行使により成立する対象有価証券の売買に係る買付顧客であるときは a に規定する買付代金を、当該売買に係る売付顧客であるときは b に規定する金銭及び c に規定する有価証券を交付するものとする。

a 権利行使により成立する対象有価証券の売買に係る買付代金（最小単位の権利行使により成立する対象有価証券の売買に係る数量に権利行使価格を乗じた額（円位未満の端数を生じた場合は、切り捨てる。）に、当該権利行使に係る有価証券オプションの数量を乗じて算出した額。次号において同じ。）

b 最小単位の権利行使により成立する対象有価証券の売買に係る数量から当該対象有価証券の売買単位の整数倍の数量を差し引いた数量で当該売買単位に満たない数量（以下この条において「売買単位未満数量」という。）にオプション清算値段を乗じた額（円位未満の端数を生じた場合は、切り捨てる。次号において同じ。）に、当該権利行使に係る有価証券オプションの数量を乗じて算出した額に相当する金銭

c 最小単位の権利行使により成立する対象有価証券の売買に係る数量から売買単位未満数量を差し引いた数量に当該権利行使に係る有価証券オプションの数量を乗じて算出した数量の有価証券

(2) 最小単位の権利行使により成立する対象有価証券の売買に係る数量が当該対象有価証券の売買単位を下回る場合において、権利行使により成立する対象有価証券の売買に係る買付顧客であるときは a に規定する買付代金を、当該売買に係る売付顧客であるときは b に規定する金銭を交付するものとする。

a 権利行使により成立する対象有価証券の売買に係る買付代金

b 最小単位の権利行使により成立する対象有価証券の売買に係る数量にオプション清算値段を乗じて得た額に、当該権利行使に係る有価証券オプションの数量を乗じて算出した額に相当する金銭

2 前項に規定する金銭を顧客と取引参加者との間で授受する場合には、前項第 1 号 a に規定する買付代金と同号 b に規定する金銭との差引額に相当する額又は前項第 2 号 a に規定する買付代金と同号 b に規定する金銭との差引額に相当する額の金銭を授受するものとする。

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

（顧客の権利行使に対する取引参加者の信用供与）

第75条 顧客は、有価証券オプション取引における権利行使の委託の指示を行った場合又は権利行使の割当てを受けた場合に成立する対象有価証券（信用取引を行うことができる銘柄であるものに限る。以下この条において同じ。）の売買の決済（前条第 1 項に規定する有価証券オプション取引における権利行使である場合には、同項第 1 号 c に規定する数量の有価証券に係るものに限る。）のため、取引参加者から信用の供与を受ける場合には、あらかじめ受託契約準則第 5 条の規定に基づき信用取引口座を設定しなければならない。

2 取引参加者に信用取引口座を設定した顧客が、権利行使又は権利行使の割当てにより成立する対象有価証券の売買を信用取引により行う旨を権利行使日の翌日（権利行使日が当該対象有価証券の売買に係る業務規程第25条第 1 項に規定する配当落等の期日又は同第25条の 2 に規定する株式併合後の株券の売買開始の期日の前日に当たる場合には、権利行使日。以下この項において同じ。）までに当該取引参加者に申し込んだ場合であって、制度信用取引によるものか一般信用取引によるものかの別を当該取引参加者に指示したときは、権利行使日の翌日の信用取引による当該対象有価証券の売付け又は買付けが成立する。

3 前項の場合において、顧客は、証拠金規則第30条第 1 項に定める受入証拠金が、クリアリング機構が業務方法書の規定に基づき定める取引証拠金等に関する規則に定める顧客の証拠金所要額（当

該権利行使に係る額を除く。)を超えている場合には、証拠金規則第33条第1項の規定にかかわらず、当該超過額(金銭の場合には、同条第1項第1号に定める現金超過額を限度とする。)を引き出し、当該顧客が受託契約準則第39条の規定に基づき差し入れるべき信用取引に係る委託保証金に充当することができる。

- 4 第2項の場合において、顧客が、当該信用取引を、当該対象有価証券と同一銘柄の対当する数量の反対売買(当該反対売買に係る当取引所の定める決済日が当該信用取引による対象有価証券の売付け又は買付けに係る当取引所の定める決済日と同一日であるものに限る。)により決済する場合には、受託契約準則第39条の規定は適用しない。

一部改正〔平成10年12月1日、平成10年12月1日、平成11年8月1日、平成13年4月1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6月16日、平成21年11月16日〕

(ストラテジー取引により成立する対象有価証券の売買に係る顧客の受渡時限等)

第76条 ストラテジー取引(第8条第1項第2号に掲げる取引に限る。)により成立する対象有価証券の売買に係る受託契約準則の適用については、これを普通取引とする。

一部改正〔平成13年11月1日、平成21年10月5日〕

(顧客の決済不履行の場合の措置)

第77条 顧客が所定の時限までに、有価証券オプション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、支払うべき金銭若しくは買付けに係る取引代金を支払わない場合又は権利行使により成立する対象有価証券の売買の決済に係る売付有価証券若しくは買付代金を交付しない場合は、当該取引参加者は、任意に、当該有価証券オプション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、権利行使又は有価証券の売付契約若しくは買付契約の締結(これらの委託を含む。)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10年12月1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〕

(顧客の取引の制限)

第78条 顧客は、同一の対象有価証券に係る有価証券オプションを対象とする有価証券オプション取引を取引参加者(当該顧客が他の取引参加者に先物・オプション取引口座を設定している場合には、当該他の取引参加者を含む。)に委託する場合には、次の各号に掲げる数量が、第4項に規定する制限数量を超えることとなる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委託を行ってはならない。この場合において、当該対象有価証券に係る有価証券オプションが、国内の他の金融商品取引所が開設する取引所金融商品市場における有価証券オプション取引の対象であるときは、当該有価証券オプション取引における建玉の数量を、次の各号に掲げる数量に含めるものとする。

(1) 有価証券プットオプションに係る総売建玉と総買建玉の差引数量

(2) 有価証券コールオプションに係る総売建玉と総買建玉の差引数量

(3) 前2号に掲げる差引数量のうち、いずれか一方において総売建玉が総買建玉を超え、他方において総買建玉が総売建玉を超えている場合には、第1号の差引数量に前号の差引数量を加えた数量

- 2 前項各号の規定にかかわらず、当該対象有価証券を所有している場合その他の場合で、前項各号の数量の全部又は一部について、当該対象有価証券の価格の変動により発生し得る危険が消滅又は減少するものとして当取引所が認めた場合には、当該全部又は一部の数量を前項各号に規定する数量から減じるものとする。

- 3 第1項の規定は、顧客が日本証券業協会に所属する金融商品取引業者又は外国において金融商品取引業に類似する業を行う外国法人である場合であって、当該顧客に係る有価証券オプション取引の委託が2以上の者の計算によるものであることを当該顧客が取引参加者を通じて当取引所に申告し、これを当取引所が認めた場合には適用しない。この場合において、当該顧客は、自己の計算に

よる第 1 項各号に掲げる数量（前項に該当する場合には、同項に定める数量を減じた数量。以下この項において同じ。）又は一の当該顧客以外の者の委託に基づく第 1 項各号に掲げる数量が、次項に規定する制限数量を超えることとなる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を取引参加者に委託してはならない。

4 第 1 項に規定する制限数量は、対象有価証券の 3 月末日（以下この項において「基準日」という。）現在における上場有価証券の数（対象有価証券の上場日が基準日後の日である場合には、当取引所がその都度定める日現在における上場有価証券の数をいう。）又は国内の他の金融商品取引所が開設する取引所金融商品市場におけるこれに相当する数の 1%（基準日からさかのぼって 1 年間における対象有価証券の当取引所の市場及び国内の他の金融商品取引所が開設する取引所金融商品市場における年間売買高の合計（対象有価証券の上場日が基準日の 1 年前の応当日の翌日後の日である場合には、最近の対象有価証券の売買高を勘案して当取引所がその都度定める。）が上場有価証券の数又は国内の他の金融商品取引所が開設する取引所金融商品市場におけるこれに相当する数の 10%未満の場合にあっては、0.7%）に当たる有価証券の数に相当する取引単位（100単位の数量に満たない端数は切り捨てる。）とし、当該制限数量は、基準日以降の当取引所がその都度定める日から起算して、原則として 1 年間適用する。

5 前項の規定にかかわらず、当取引所は、クリアリング機構の業務方法書の規定により建玉の変更が行われた場合その他対象有価証券の売買状況等を勘案して当取引所が必要と認める場合は、対象有価証券の上場有価証券の数、取引単位その他の事項を勘案して制限数量をその都度定めることができる。

一部改正〔平成 9 年 10 月 29 日、平成 10 年 1 月 23 日、平成 10 年 3 月 1 日、平成 10 年 12 月 1 日、平成 11 年 8 月 1 日、平成 12 年 7 月 1 日、平成 13 年 10 月 1 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 16 年 2 月 2 日、平成 18 年 12 月 31 日、平成 19 年 9 月 30 日、平成 20 年 1 月 15 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 78 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 79 条 顧客と取引参加者との間における有価証券オプション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 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 79 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〕

（受託契約準則の適用除外）

第 80 条 有価証券オプション取引における権利行使により成立する対象有価証券の売買については、受託契約準則第 11 条の規定は適用しない。

一部改正〔平成 10 年 12 月 1 日、平成 11 年 10 月 1 日、平成 20 年 6 月 16 日〕

(受託契約準則の読替え)

第81条 有価証券オプション取引に係る受託契約準則第2条、第5条、第17条、第26条、第27条、第41条、第44条から第48条まで、第50条、第52条及び第53条の適用については、同第2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有価証券オプション取引参加者をいう。）」と、同第5条、第17条、第26条、第27条、第41条、第44条から第48条まで、第50条、第52条及び第53条中「取引参加者」とあるのは「取引参加者（取引所の総合取引参加者又は有価証券オプション取引参加者をいう。）」とする。

一部改正〔平成10年4月1日、平成10年12月1日、平成11年5月1日、平成11年10月1日、平成13年5月1日、平成13年11月1日、平成15年1月14日、平成18年5月1日、平成20年6月16日、平成21年1月5日〕

第5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82条 有価証券オプション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有価証券オプション取引を行う者とみなして第2章（第5節を除く。）及び第3章の規定を適用する。

2 貸借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貸借取引を行う者とみなして第3章の規定を適用する。

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、平成9年7月1日から施行する。

2 第6条第2項及び第3項の規定にかかわらず、第1号から第3号までに掲げる日を取引最終日とする限月取引の取引開始日は、平成9年7月18日とし、第4号に掲げる日を取引最終日とする限月取引の取引開始日は、平成9年8月8日とする。

- (1) 平成9年9月11日
- (2) 平成9年12月11日
- (3) 平成10年3月12日
- (4) 平成9年10月8日

一部改正〔平成10年11月30日、平成11年8月1日〕

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42条の9から第42条の19まで及び第78条の2から第78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、第15条第3項の改正規定は、平成10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10年4月13日

付 則

この改正規定は、平成10年3月1日から施行する。

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12月 1 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 2 条から第 5 条まで、第 7 条及び第19条の改正規定、第38条の改正規定（「売買取引」を「売買」に改める部分に限る。）並びに第 39条、第40条、第44条、第46条、第49条から第51条まで、第53条、第57条、第59条、第60条、第63条、第73条から第75条まで、第77条、第78条、第84条及び第85条の改正規定は、平成10年12月 1 日から、第45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日に成立した取引に係る第32条に規定する正会員又は株券オプション取引特別参加者に係る取引代金の授受は、同年12月 1 日に行うものとし、同年11月26日及び27日に成立した買付けに係る第71条に規定する顧客に係る取引代金の差入れは、同年12月 1 日までの正会員又は株券オプション取引特別参加者が指定する日時までに行うものとする。
- 4 第 1 項ただし書前段に規定する改正規定施行の際、弁済が行われていない信用取引は、当該改正規定施行後においては、制度信用取引とみなす。ただし、当該信用取引に係る弁済期限については、改正後の第75条の規定にかかわらず、なお従前の例による。
- 5 第45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「正会員又は株券オプション取引特別参加者」とあるのは「正会員又は株券オプション取引特別参加者（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前に行われた株券オプション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 3 の規定により株券オプション取引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券オプション取引責任者については、施行日において、正会員又は株券オプション取引特別参加者が、改正後の第52条第 2 項の規定により、株券オプション取引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。）前に成立した株券オプション取引で施行日に

において未決済のものについては、施行日をもって第30条の2の規定に基づくオプションの付与者としての地位の承継及び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、平成11年8月1日から施行する。ただし、第35条、第39条及び第72条から第74条までの改正規定は、平成11年9月1日から、第61条の2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11年8月1日

付 則

この改正規定は、平成11年9月1日から施行する。

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、同日以後の取引及び売買分から適用する。

(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11年11月10日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成11年11月11日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成12年3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。ただし、第7条の改正規定及び第15条第3項の改正規定中呼値の単位に係る部分は、平成12年6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、ただし書の「本所が定める日」は平成12年7月17日

付 則

この改正規定は、本所が定める日から施行する。ただし、第44条及び第78条の改正規定は、平成12年7月1日から施行する。

(注)「本所が定める日」は平成12年10月30日

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。ただし、第58条の改正規定（業務規程第48条の5第1項に係る部分に限る。）は、この改正規定施行の日の前日（休業日に当たるときは、順次繰り上げる。）から施行し、第73条第2項の改正規定は、この改正規定施行の日の4日前（休業日を除外する。）の日から施行する。

(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7月1日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成13年10月1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

- 1 この改正規定は、平成13年12月 1 日から施行する。
- 2 平成14年 3 月末日以降に、改正後の第44条第 3 項及び第78条第 4 項の規定に基づき同年 3 月末日を基準日とする制限数量を適用する日として当取引所が定める日の前日までの間は、同項中「基準日以降の当取引所がその都度定める日から起算して、原則として 1 年間」とあるのは「この改正規定の施行の日から当取引所が定める日の前日までの間」とする。
- 3 改正後の第44条第 3 項及び第 4 項並びに第78条第 4 項及び第 5 項の規定にかかわらず、改正前の制限数量が改正後の第44条第 3 項若しくは第 4 項又は第78条第 4 項若しくは第 5 項の規定に基づく制限数量を上回る場合は、前項の当取引所が定める日の前日までの間は、なお従前の例による。

(注) 「当取引所が定める日」は平成14年 8 月 1 日

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 2 月 1 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 5 月 6 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17年 4 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 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13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 3 月12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 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19年11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 22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

付 則

この改正規定は、平成21年11月 16日から施行する。