

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 1 章 総則

(目的)

第 1 条 この特例は、指数オプション取引及び指数オプション取引（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〕

(指数オプション取引に関する定義)

第 2 条 この特例において指数オプション取引とは、指数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 この特例において指数オプションとは、権利取得者（当該オプションを付与された者をいう。以下同じ。）の意思表示により当事者間において、当該意思表示を行う場合の指数としてあらかじめ設定した数値（以下「権利行使価格」という。）と現に当該意思表示を行った時期における現実の当該指数の数値（以下「現実指数」という。）との差に基づいて算出される金銭を授受することとなる取引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、指数オプションの行使をいう。

一部改正〔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 7 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、指数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、指数オプションを取得する立場の当事者となる取引をいう。

(3) 値段とは、指数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。

(4) 値幅とは、値段の幅をいう。

(5) 呼値とは、指数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 13 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

(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〕

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 指数オプション取引の対象は、次項に規定する対象指数に係る次の各号に掲げる指数オプションとする。

(1) 現実指数が権利行使価格を下回った場合にその差に当該対象指数に係る取引基準額を乗じて得た額の金銭を権利取得者が相手方から受領することとなる取引を成立させることができる指数オプション（以下「指数プットオプション」という。）

- (2) 現実指数が権利行使価格を上回った場合にその差に当該対象指数に係る取引基準額を乗じて得た額の金銭を権利取得者が相手方から受領することとなる取引を成立させることができる指数オプション（以下「指数コールオプション」という。）
- 2 指数オプション取引における対象指数は、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 第 1 項各号に規定する取引基準額は、次の各号に定めるところによる。
- (1) 東証株価指数に係る指数オプション（以下「東証株価指数オプション」という。）については、1 万円とする。
- (2) S & P / T O P I X 150 に係る指数オプション（以下「S & P / T O P I X 150 オプション」という。）については、1,000 円とする。
- 4 指数オプション取引において、銘柄（第 2 項において使用する場合を除く。）とは、対象指数、権利行使日及び権利行使価格を同一とする指数プットオプション及び指数コールオプションをいうものとする。

一部改正〔平成 9 年 11 月 14 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〕

（限月取引及びその数）

第 5 条 指数オプション取引は、指数プットオプション及び指数コールオプションについて、対象指数ごとに、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（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 前項の限月取引のうち、3 月、6 月、9 月及び 12 月に取引最終日が到来する限月取引（以下「四半期限月取引」という。）は、5 限月取引制とし、各四半期限月取引の期間は 1 年 3 か月とする。この場合において、5 限月取引のうち、最初に取引最終日が到来する四半期限月取引の取引最終日の終了する日の翌日の午前 8 時 20 分から新たな四半期限月取引を開始する。
- 3 第 1 項の限月取引のうち、3 月、6 月、9 月及び 12 月以外の月に取引最終日が到来する限月取引（以下「四半期限月取引以外の限月取引」という。）は、3 限月取引制とし、各四半期限月取引以外の限月取引の期間は 4 か月又は 5 か月とする。この場合において、3 限月取引のうち、最初に取引最終日が到来する四半期限月取引以外の限月取引の取引最終日の終了する日の翌日の午前 8 時 20 分から新たな四半期限月取引以外の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、取引対象指数オプション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 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〕

（権利行使価格及びその数）

第 6 条 指数オプション取引は、指数プットオプション及び指数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、次の各号に掲げる指数オプションの区分に従い、当該限月取引の取引開始日に当該各号に定める方法により設定する。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。
- (1) 東証株価指数オプション

次の a 又は b に掲げる限月取引の区分に従い、当該 a 又は b に定める方法により設定する。

- a 四半期限月取引以外の限月取引（期間が 5 か月であるものに限る。）及び四半期限月取引指数オプション取引における東証株価指数の数値につき、50ポイント刻みで設定する50ポイントの整数倍の数値とし、当取引所が定めるところにより13種類設定する。
- b 四半期限月取引以外の限月取引（期間が 4 か月であるものに限る。）
指数オプション取引における東証株価指数の数値につき、25ポイント刻みで設定する25ポイントの整数倍の数値とし、当取引所が定めるところにより19種類設定する。

(2) S & P / T O P I X 150 オプション

次の a 又は b に掲げる限月取引の区分に従い、当該 a 又は b に定める方法により設定する。

- a 四半期限月取引以外の限月取引（期間が 5 か月であるものに限る。）及び四半期限月取引指数オプション取引における S & P / T O P I X 150 の数値につき、50ポイント刻みで設定する50ポイントの整数倍の数値とし、当取引所が定めるところにより13種類設定する。
- b 四半期限月取引以外の限月取引（期間が 4 か月であるものに限る。）
指数オプション取引における S & P / T O P I X 150 の数値につき、25ポイント刻みで設定する25ポイントの整数倍の数値とし、当取引所が定めるところにより19種類設定する。

3 前項第 1 号 a 又は第 2 号 a に掲げる限月取引においては、当該限月取引の取引最終日の属する月の 4 か月前の月の第二金曜日に、指数オプション取引における対象指数の数値につき、25ポイント刻みで設定する25ポイントの整数倍の数値の権利行使価格を、当取引所が定めるところにより連続して19種類以上となるよう設定する。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。

4 前 2 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。

一部改正〔平成 9 年 11 月 14 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、平成 21 年 10 月 5 日〕

(ストラテジー取引)

第 6 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第 2 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、次の各号に掲げる取引（以下「ストラテジー取引」という。）を行うことができる。

(1) 対象指数を同一とする複数の銘柄の指数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) 対象指数を同一とする指数先物取引（当取引所が定める指数先物取引に限る。）の売付け又は買付け（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（以下「指数先物特例」という。）第 2 条第 1 号に規定する売付け又は買付けをいう。）と同時に成立させることを条件として行う一又は複数の銘柄の指数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指数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。

追加〔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 7 条 指数オプション取引の立会は、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、午後立会及びイブニング・セッションを行わない。

一部改正〔平成 3 年 4 月 30 日、平成 9 年 11 月 14 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、平成 21 年 10 月 5 日〕

(立会の臨時停止、臨時挙行)

第 8 条 当取引所は、必要があると認めるときは、指数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 9 条 当取引所は、指数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 10 条 指数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〕

(値段の表示)

第 11 条 指数オプション取引における値段の表示は、次の各号に定めるところによる。

(1) 東証株価指数オプションについては、1 万円を 1 ポイントとする。

(2) S & P / T O P I X 150 オプションについては、1,000 円を 1 ポイントとする。

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

(競争取引における呼値の順位)

第 12 条 指数オプション取引は、競争取引によるものとする。

2 指数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 13 条 前条第 1 項の競争取引は、個別競争取引とする。

2 指数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。）の競合及び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 0.1 ポイント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 0.1 ポイント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 0.1 ポイント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取引を成立させる。ただし、第 2 号に掲げる数値が第 14 条第 5 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 0.1 ポイント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 0.1 ポイントの整数倍の数値、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 0.1 ポイントの整数倍の数値

(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 14 条第 5 項」とあるのは「第 14 条第 6 項の規定により読み替えて適用する同条第 5 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指数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 13 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14条 取引参加者は、指数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 指数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 指数オプション取引の呼値の単位は、20ポイント以下の呼値については0.1ポイント、20ポイントを超える呼値については0.5ポイントとする。
- 4 ストラテジー取引における呼値の単位は、マイナス20ポイント以上20ポイント以下の呼値については0.1ポイント、マイナス20ポイントに満たない呼値及び20ポイントを超える呼値については0.5ポイントとする。
- 5 指数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。
- 6 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。
- 7 この特例に定めるもののほか、指数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6月16日、平成21年10月5日〕

(インプライドイン)

第14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指数オプション取引の呼値を組み合わせるにより、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14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指数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指数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14条の4 取引参加者は、指数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指数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とした場合には、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、指数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15条 指数オプション取引は、指数プットオプション又は指数コールオプション 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16条 当取引所は、指数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17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〕

(取引の一時中断)

第17条の2 当取引所は、指数先物取引について指数先物特例第14条の2の規定により取引を一時中断した場合には、当該指数先物取引を一時中断している間、対象指数が当該指数先物取引と同一の指数オプション取引を一時中断する。

追加〔平成 6 年 2 月14日〕、一部改正〔平成10年 1 月23日、平成11年 5 月 1 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、平成21年10月 5 日〕

(取引の停止)

第18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、指数オプション取引を停止することができる。

(1) 指数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 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〕

第19条から第28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〕

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29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30条 指数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の終了する日の翌日とする。

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 指数オプション取引における権利行使が行われたときは、権利行使日の翌日に次条に規定するオプション清算指数により権利行使に係る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〕

（オプション清算指数）

第31条 オプション清算指数は、当取引所が対象指数を同一とする指数オプションごとに、権利行使日に定めるものとし、当該権利行使日における当該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（権利行使日において約定値段がない銘柄については、当取引所が定める値段）に基づき算出した特別な指数（以下この条において「特別清算指数」という。）とする。ただし、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。）のオプション清算指数は、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、権利行使に係る決済の日の前日まで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オプション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オプション清算指数の変更により損害を被った場合においても、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〕

（権利行使の停止）

第32条 当取引所は、指数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認める場合には、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〕

（指数オプションの消滅）

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った指数プットオプション及び指数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、指数オプション取引（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指数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、指数オプション取引の売付け又は買付けについて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オプション取引の売付け又は買付けについて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指数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、指数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44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

追加〔平成11年4月1日〕

(取引に関する通知書の送付)

第45条 取引参加者は、指数オプション取引(過誤訂正等のための取引を含む。)に係る未決済勘定がある顧客に対して、当該指数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、対象指数、指数プットオプション又は指数コールオプションの別、限月取引、権利行使価格、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(取引が成立した取引日の終了する日をいう。)、取引最終日(当該限月取引の終了する日をいう。)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。)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9年11月14日、平成13年6月11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通知)

第46条 取引参加者は、株式会社日本証券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（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。）に係る数量をいう。以下同じ。）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指数オプション取引又はその受託に関する規制措置）

第47条 当取引所は、当取引所の市場における指数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指数オプション取引又はその受託に関し、当取引所の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〕

第48条 削除

一部改正〔平成10年12月1日、平成11年5月1日〕

第49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指数オプション取引の方法等）

第50条 取引参加者は、当取引所の市場における指数オプション取引を、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 指数先物特例第41条第3項に規定する指数先物取引等責任者は、併せて、指数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ものとする。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51条及び第52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53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、当該呼値により指数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項の規定による指数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〕

第54条 削除

一部改正〔平成9年11月14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55条 指数オプション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56条 顧客が指数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指数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56条の2 顧客がギブアップに係る指数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指数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指数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指数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指数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指数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指数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、ギブアップに係る指数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56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指数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、制度の仕組み等指数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57条 顧客が指数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58条 顧客が指数プットオプション又は指数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) 対象指数
- (2) 指数プットオプション又は指数コールオプションの別
- (3) 限月取引
- (4) 権利行使価格
- (5) 新規の売付け若しくは新規の買付け又は転売（買建玉（各銘柄の建玉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。）若しくは買戻し（売建玉（各銘柄の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。）

の区別

- (6) ストラテジー取引により行おうとするときは、その旨
- (7) 数量
- (8) 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）
- (9) 呼値の種類
- (10) 呼値に条件を付すときは、その条件
- (11) 立会時
- (12) 委託注文の有効期間

2 前項の規定にかかわらず、同項第 5 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 5 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13年 6 月 11 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10月 5 日〕

(ギブアップに係る委託の際の指示事項等)

第58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 5 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した指数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58条の3 委託注文は、第58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58条の4 ギブアップに係る指数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、当該指数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指数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58条の5 第58条の規定にかかわらず、当該ギブアップに係る指数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指数オプション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 5 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58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オプション取引に係る同条第 1 項第 5 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59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60条から第65条まで 削除

一部改正〔平成10年11月30日〕

第3節 顧客の権利行使

（権利行使の指示）

第66条 顧客は、指数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（次の各号に定める場合に該当する銘柄を除く。）ごとに権利行使に係る数量を、権利行使日の午後 4 時までに取引参加者に指示するものとする。

- (1) 指数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指数の数値以下である場合

(2) 指数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指数の数値以上である場合

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) 指数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指数の数値を上回っている場合

(2) 指数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指数の数値を下回っている場合

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

第 4 節 顧客の決済等

(決済のために授受する金銭)

第 67 条 顧客と取引参加者との間で指数オプション取引の決済のために授受する金銭は、当該顧客の委託に基づく売付け又は買付けが成立した場合の取引代金及び当該顧客の委託に基づく権利行使に係る決済の場合における権利行使価格とオプション清算指数との差に相当する金銭とする。

一部改正〔平成 9 年 11 月 14 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〕

(顧客の決済時限)

第 68 条 顧客が前条に掲げる決済を行う場合には、買付けに係る取引代金又は権利行使の割当てを受けたことに伴う金銭を、取引が成立した取引日の終了する日又は権利行使日の翌日（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。）の場合は、当該取引日の終了する日又は権利行使日から起算して 3 日目（休業日を除外する。）の日）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 9 年 11 月 14 日、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 20 年 6 月 16 日〕

(証拠金の決済のために授受する取引代金等への充当)

第 68 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又は金銭については、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。

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〕

(顧客の決済不履行の場合の措置)

第 69 条 顧客が所定の時限までに、指数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又は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は、当該取引参加者は、任意に、当該指数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又は権利行使（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 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 5 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 69 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 6 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 70 条 顧客と取引参加者との間における指数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 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 70 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 71 条 指数オプション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 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 72 条 指数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指数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。）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、平成元年 10 月 2 日から施行する。

2 第 5 条第 2 項本文後段及び同条第 3 項本文の規定にかかわらず、次の各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、平成元年 10 月 20 日とする。

(1) 平成元年 11 月 9 日

(2) 平成元年 12 月 7 日

(3) 平成 2 年 1 月 11 日

(4) 平成 2 年 2 月 8 日

3 午後立会の立会時については、第 7 条第 1 項本文の規定にかかわらず、本所が定める日まで、午後 1 時から午後 3 時 15 分までとする。

4 特定限月取引以外の限月取引の取引最終日における午後立会の立会時は、第 7 条第 1 項ただし書の規定にかかわらず、本所が定める日まで、午後 1 時から 3 時までとする。

(注) 第 3 項及び第 4 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 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 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 43 条の 9 から第 43 条の 19 まで及び第 69 条の 2 から第 69 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

- 1 この改正規定は、平成 9 年 11 月 14 日から施行する。
- 2 この改正規定施行の際、現に取引が行われている限月取引については、改正規定施行の日（以下「施行日」という。）に、各限月取引について、既存の権利行使価格と権利行使価格との間に、25 ポイントの整数倍の数値の新たな権利行使価格を設定するとともに、次の各号の一に該当する場合には、当該各号に規定する方法により新たな権利行使価格を設定するものとする。
 - (1) 各限月取引について、施行日の前日の最終の東証株価指数の数値に最も近接する 25 ポイントの整数倍の数値（当該数値が 2 種類ある場合は、高い方の数値。以下同じ。）を上回る権利行使価格が 3 種類以下となる場合
当該限月取引について、当該権利行使価格が 4 種類となるまで、既存の最も高い権利行使価格から 25 ポイント刻みで設定する。
 - (2) 各限月取引について、施行日の前日の最終の東証株価指数の数値に最も近接する 25 ポイントの整数倍の数値を下回る権利行使価格が 3 種類以下となる場合
当該限月取引について、当該権利行使価格が 4 種類となるまで、既存の最も低い権利行使価格から 25 ポイント刻みで設定する。
- 3 前 2 項の規定にかかわらず、この改正規定施行の際、現に転売若しくは買戻しの申告又は権利行使の申告若しくは割当てが行われていない未決済約定がある銘柄の取引最終日を取引最終日とする限月取引及び当該限月取引の取引最終日前に取引最終日が到来する限月取引については、なお従前の例による。

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。

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、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 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

- 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48条、第49条及び第51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44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31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68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44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前に行われた株価指数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

この改正規定は、平成11年 5 月 1 日から施行する。

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日（以下「施行日」という。）前に成立した株価指数オプション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29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9月1日から施行する。ただし、第56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、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

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。ただし、第56条の2の規定は、S&P/TOP I X150に係る株価指数オプション取引については、当取引所が定める日までの間は、適用しない。

一部改正〔平成13年11月1日〕

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14年2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 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