

金融先物取引所に関する省令（平成十年大蔵省令第百号）

改 正 案

現 行

（取引証拠金の預託を受けない取引）

第三条 法第三十七条第一項に規定する大蔵大臣の定めるものは、次の各号に掲げる取引について、当該各号に定める場合のものとする。

- 一 金融先物取引（法第二条第四項第三号に掲げる取引（以下「金融オプシオン取引」という。）を除く。以下この号において同じ。）先物銘柄（金融先物取引において取引されるものうち取引対象通貨等及び期限を同一とするもの。以下同じ。）ごとに、買建玉（決済を結了していない買付け（法第二条第四項第二号に規定する取引にあつては、現実数値（将来の一定の時期における現実の金融指標の数値をいう。以下同じ。）が約定数値を上回った場合に金銭を受領する立場となる取引をいう。）の約定に係る数量をいう。以下同じ。）と売建玉（決済を結了していない売付け（法第二条第四項第二号に規定する取引にあつては、現実数値が約定数値を上回った場合に金銭を支払う立場となる取引をいう。以下同じ。）の約定に係る数量をいう。以下同じ。）が同量である場合

- 二 金融オプシオン取引 オプション銘柄（金融オプシオン取引において取引されるものうち、取引対象通貨等、期限、オプションの種類（金融オプシオンの行使をした者が当該行使により成立する取引において売主）（法第二条第四項第三号に規定する取引にあつては、現実

数値が約定数値を上回った場合に金銭を支払う立場の当事者をいう。

( )としての地位を取得するか買主(法第二条第四項第三号に規定する取引にあつては、現実数値が約定数値を上回った場合に金銭を受領する立場の当事者をいう。 )としての地位を取得するかの別をいう。

以下同じ。 )及び権利行使価格(当事者の一方の意思表示により成立する取引に係る価格又は金融指標をいう。 )を同一とするものをいう。以下同じ。 )ことに、売建玉と買建玉が同量である場合又は買建玉が売建玉を上回る場合

(取引証拠金の預託方法)

第四条 金融先物取引所は、法第三十七条第一項の規定に基づき委託者(同項第二号に規定する委託者をいう。以下同じ。 )、取次者(同号に規定する取次者をいう。以下同じ。 )又は申込者(同項第四号に規定する申込者をいう。以下同じ。 )から取引証拠金の預託を受けるときは、次の各号に掲げる場合の区分に応じ、当該各号に定める者を代理人として当該取引証拠金の預託を受けなければならない。

一 法第三十七条第一項第二号又は第三号に規定する場合(金融先物取引を受託した会員が他の会員を清算会員(会員が他の会員に取引証拠金の預託を委託する場合の当該他の会員をいう。以下同じ。 )として届け出た場合を除く。 ) 当該金融先物取引を受託した会員

二 法第三十七条第一項第二号又は第三号に規定する場合(金融先物取引を受託した会員が他の会員を清算会員として届け出た場合に限る。

( ) 当該金融先物取引を受託した会員及び当該会員が届け出た清算会

員

三 法第三十七条第一項第四号に規定する場合（金融先物取引を受託した会員が他の会員を清算会員として届け出た場合を除く。） 金融先物取引に係る取次者及び当該金融先物取引を受託した会員

四 法第三十七条第一項第四号に規定する場合（金融先物取引を受託した会員が他の会員を清算会員として届け出た場合に限る。） 金融先物取引に係る取次者、当該金融先物取引を受託した会員及び当該会員が届け出た清算会員

2 金融先物取引所は、法第三十七条第一項の規定に基づき取引証拠金の預託を受けるときは、金融先物取引を行う会員その他の同項各号に定める者に代えて、当該会員が届け出た清算会員から当該取引証拠金の預託を受けすることができる。

（取次証拠金の預託に係る顧客の同意）

第五条 取次者は、法第三十七条第二項の規定により、申込者をして取次証拠金を預託させるときは、当該申込者から、自己に対して当該取次証拠金を預託させることについての書面による同意を得なければならない。

（委託証拠金の預託に係る顧客の同意等）

第六条 会員は、法第三十七条第三項の規定により、委託者、取次者又は申込者をして委託証拠金を預託させるときは、当該委託者、取次者又は申込者から、自己に対して当該委託証拠金を預託させることについての

書面による同意を得なければならない。

- 2 | 会員は、法第三十七条第三項の規定により、申込者をして委託証拠金を預託させるときは、当該申込者の取次者を代理人として当該委託証拠金の預託を受けなければならない。

(金融先物取引所における取引証拠金の分別管理)

第七条 金融先物取引所は、法第三十七条第四項の規定に基づき取引証拠金を管理するときは、次の各号に掲げる区分ごとかつ会員ごとに、自己の固有財産その他の取引証拠金以外の財産と分別して管理しなければならない。

- 一 | 法第三十七条第一項第一号に掲げる場合のうち会員が自己の計算において金融先物取引を行うときに、同項の規定に基づき当該会員から預託を受けた取引証拠金
- 二 | 法第三十七条第一項第一号に掲げる場合のうち会員が受託した金融先物取引を同条第三項の規定に基づき当該会員から預託を受けた取引証拠金並びに同項各号に掲げる場合に、同項及び第四条第二項の規定に基づき清算会員から預託を受けた取引証拠金
- 三 | 法第三十七条第一項第二号又は第四号に掲げる場合に、同項の規定に基づき委託者又は申込者から預託を受けた取引証拠金
- 四 | 法第三十七条第一項第三号に掲げる場合に、同項の規定に基づき取次者から預託を受けた取引証拠金

- 2 | 金融先物取引所は、法第三十七条第四項の規定に基づき取引証拠金を管理するときは、次項の規定に基づき管理されるものを除くほか、次に

掲げる方法により当該取引証拠金を管理しなければならない。

一 大蔵大臣の指定する金融機関への預金（取引証拠金であることがその名義により明らかなものに限る。）

二 信託会社又は信託業務を営む銀行への金銭信託（信託業法（大正十一年法律第六十五号）第九条の規定により元本の補てんの契約をしたものであって、取引証拠金であることがその名義により明らかなものに限る。）

3 | 金融先物取引所は、法第三十七条第四項の規定に基づき充当有価証券等（同条第五項の規定により取引証拠金に充てられる有価証券等）同項に規定する有価証券その他第九条で定めるものをいう。以下同じ。）をいう。以下同じ。）を管理するときは、次の各号に掲げる有価証券等の区分に応じ、当該各号に定める方法により当該充当有価証券等を管理しなければならない。

一 金融先物取引所が保管することにより管理する有価証券等（混蔵して保管される有価証券等を除く。次号において同じ。） 充当有価証券等の保管場所については自己の固有財産である有価証券等その他の充当有価証券等以外の有価証券等（以下「固有有価証券等」という。）の保管場所と明確に区分し、かつ、当該充当有価証券等についてどの会員から又はどの会員を通じ預託を受けた有価証券等であるかが直ちに判別できる状態で保管することにより管理する方法

二 金融先物取引所が第三者をして保管させることにより管理する有価証券等 当該第三者をして、当該充当有価証券等の保管場所については固有有価証券等の保管場所と明確に区分させ、かつ、充当有価証券

等についてどの会員から又はどの会員を通じ預託を受けた有価証券等であるかが直ちに判別できる状態で保管させることにより管理する方法

三 金融先物取引所が保管することにより管理する有価証券等（混蔵して保管される有価証券等に限る。次号において同じ。） 充当有価証券等の保管場所については固有有価証券等の保管場所と明確に区分し、かつ、各会員から又は各会員を通じ預託を受けた充当有価証券等に係る持分が自己の帳簿により直ちに判別できる状態で保管することにより管理する方法

四 金融先物取引所が第三者をして保管させることにより管理する有価証券等 当該第三者をして、充当有価証券等を預託する者のための口座については金融先物取引所の自己の口座と区分する等の方法により、充当有価証券等に係る持分が直ちに判別でき、かつ、各会員から又は各会員を通じ預託を受けた充当有価証券等に係る持分が自己の帳簿により直ちに判別できる状態で保管させることにより管理する方法

五 証券取引法第二条第二項の規定により有価証券とみなされる権利 第三者をして、充当有価証券等を会員から又は会員を通じ預託を受けた有価証券等として明確に管理させ、かつ、当該管理状況が自己の帳簿により直ちに把握できる状態で管理する方法

（取引証拠金等の充当有価証券等の充当価格）

第八条 法第三十七条第一項の取引証拠金、同条第二項の取次証拠金及び同条第三項の委託証拠金の全部又は一部が同条第五項の規定により有価

証券等をもって充てられる場合におけるその充当価格は、金融先物取引所が法第十七条第二項の規定に基づく大蔵大臣の認可（以下「大蔵大臣の認可」という。）を得て定める基準日の時価に株券（端株券を含む。）については百分の七十、その他については金融先物取引所が大蔵大臣の認可を得て定める率を乗じた額を超えない額とする。

（取引証拠金等の充当物）

第九条 法第三十七条第五項に規定する大蔵省令で定めるものは次に掲げるものとする。

- 一 (略)
- 二 (略)

（総取引高及び成立した対価の額等の通知等）

第十条 金融先物取引所は、法第四十二条の規定による通知及び公表を行うときは、別表第一に定める事項についてその業務規程に定める方法により行わなければならない。

（取引証拠金等の充当物）

第三条 法第三十七条第二項（法第四十八条第三項において準用する場合を含む。）に規定する大蔵省令で定めるものは次に掲げるものとする。

- 一 証券取引法（昭和二十三年法律第二十五号）第二条第一項に掲げる有価証券（法第二十七条第二項に規定する有価証券を除く。）
- 二 (略)
- 三 (略)

（相場及び取引高報告書の様式）

第四条 法第四十三条第一項の規定による相場及び取引高報告書は、別表により、作成しなければならない。

(相場等の報告)

第十一条 金融先物取引所は、法第四十三条第一項の規定による相場その他の事項の報告を行うときは、別表第一及び別表第二に定める事項について行わなければならない。

別表第一（第十条及び第十一条関係）

通知、公表及び報告事項	一、法第二条第四項第一号に規定する取引にあっては、取引件数、最初、最高、最低及び最終の成立した対価の額、その日の清算を行うために金融先物取引の額並びに建玉件数（決済を結了していないものの件数をいう。以下同じ。） 二、法第二条第四項第二号に規定する取引にあっては、取引件数、最初、最高、最低及び最終の成立した対価の額、その日の清算を行うために金融先物取引の額並びに建玉件数 三、法第二条第四項第三号に規定する取引にあっては、取引件数、最初、最高、最低及び最終の成立した対価の額、その日の清算を行うために金融先物取引の額、建玉件数並びに金融オプションの行使件数
注 意 事 項	取引の種類及び先物銘柄又はオプション銘柄ごとに区分すること。

別表第二（第十一条関係）

報 告 事 項	会員のうち取引件数の多い順序に従い二十五名について、会員名及びそれぞれの取引件数
注 意 事 項	取引の種類、取引対象通貨等、オプションの種類及び売付け又は買付けごとに区分すること。

別表（第四条関係）

書類の種類	相場表	提出区分	記載事項	記載上の注意
取引高報告書	種別、取引対象通貨等及び毎月の取引高報告書	毎日及び	一、法第二条第四項第一号に規定する取引にあっては、取引件数、最初、最高、最低及び最終の成立した対価の額、その日の清算を行うために金融先物取引の額並びに建玉件数（決済を結了していないものの件数をいう。以下同じ。） 二、法第二条第四項第二号に規定する取引にあっては、取引件数、最初、最高、最低及び最終の成立した対価の額、その日の清算を行うために金融先物取引の額並びに建玉件数 三、法第二条第四項第三号に規定する取引にあっては、取引件数、最初、最高、最低及び最終の成立した対価の額、その日の清算を行うために金融先物取引の額、建玉件数並びに金融オプションの行使件数	一、種類、取引対象通貨等及び期限の異なる取引ごとに区分すること。 二、法第二条第四項第一号に規定する取引にあっては、取引件数、最初、最高、最低及び最終の成立した対価の額、その日の清算を行うために金融先物取引の額並びに建玉件数（決済を結了していないものの件数をいう。以下同じ。） 三、法第二条第四項第二号に規定する取引にあっては、取引件数、最初、最高、最低及び最終の成立した対価の額、その日の清算を行うために金融先物取引の額並びに建玉件数 四、法第二条第四項第三号に規定する取引にあっては、取引件数、最初、最高、最低及び最終の成立した対価の額、その日の清算を行うために金融先物取引の額、建玉件数並びに金融オプションの行使件数

		<p>所の定める方法により決済することをいう。(以下同じ。)</p> <p>別記載し、各々小計を付した上合計すること。</p> <p>ただし、新規の売付又は買付及び転売又は買戻し別については、金額の記載は要しない。</p> <p>三、法第二条第四項第二号に規定する取引にあつては、新規の売付又は買付及び転売又は買戻し別に記載し、各々小計を付した上合計すること。</p> <p>ただし、新規の売付又は買付及び転売又は買戻し別については、金額の記載は要しない。</p> <p>四、法第二条第四項第三号に規定する取引にあつては、新規の売付又は買付及び転売又は買戻し別に記載し、各々小計を付した上合計すること。</p> <p>ただし、新規の売付又は買付及び転売又は買戻し別については、金額の記載は要しない。</p> <p>五、法第二条第四項第三号に規定する取引にあつては、新規の売付又は買付及び転売又は買戻し別に記載し、各々小計を付した上合計すること。</p> <p>ただし、新規の売付又は買付及び転売又は買戻し別については、金額の記載は要しない。</p> <p>また、権利行使及び割当件数を記載すること。</p>
<p>会員別分は、毎月</p>	<p>、会員別の取引高報告書は、会員名、取引件数、取引金額、一日平均取引件数及び建玉件数</p>	<p>一、種類、取引対象通貨等及び期限の異なる取引ごとに区分すること。</p> <p>二、一日平均取引件数については、当該会員のその月における総取引件数を取引日数で除したものを、建玉件数については、当該会員の月末又は期限内に決済を行う建玉件数を記載すること。</p> <p>三、法第二条第四項第一号に規定する取引にあつては、期限ごとに区分し、新規の売付又は買付及び転売又は買戻し別に記載し、各々小計を付した上合計すること。</p> <p>ただし、新規の売付又は買付及び転売又は買戻し別については、金額の記載は要しない。</p> <p>四、法第二条第四項第二号に規定する取引にあつては、新規の売付又は買付及び転売又は買戻し別に記載し、各々小計を付した上合計すること。</p> <p>ただし、新規の売付又は買付及び転売又は買戻し別については、金額の記載は要しない。</p> <p>五、法第二条第四項第三号に規定する取引にあつては、新規の売付又は買付及び転売又は買戻し別に記載し、各々小計を付した上合計すること。</p> <p>ただし、新規の売付又は買付及び転売又は買戻し別については、金額の記載は要しない。</p> <p>また、権利行使及び割当件数を記載すること。</p>