

システム障害時等における先物・オプション取引の取引代行の取扱いに係る実施要綱

平成23年11月21日
株式会社東京証券取引所
株式会社日本証券クリアリング機構

項 目	内 容	備 考
1. 目的	<ul style="list-style-type: none"> 東京証券取引所（以下「東証」という。）の売買システム等に障害が発生し、個々の取引参加者が先物・オプション取引に係る注文入力等が行えない状況にある場合（売買停止措置を講じている場合を除く。）当該取引参加者における取引参加手段の確保及び取引継続を可能とするため、システム障害時における他の取引参加者による取引代行の取扱いを認めることとする。 	<ul style="list-style-type: none"> 東証売買システム、取引参加者の自社システム及び電力・通信網等の社会インフラ障害については、売買に参加できない取引参加者（端末等）の過去の売買シェアが概ね2割超となった等の場合には売買を停止することとしている。
2. 概要	<ul style="list-style-type: none"> 東証売買システム等に障害が生じた場合により、取引が困難となった取引参加者（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東証の承認を受けて、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（国債先物特例第44条第2項第2項、指数先物特例第44条第2項等）。 この場合、取引代行取引参加者が代行した個々の約定については、清算システムのギブアップの機能を利用することによりシステム障害取引参加者へ移すこととする。 	
3. 取引代行の要件 (1) 障害の範囲	<ul style="list-style-type: none"> 東証売買システム、取引参加者の自社側システム又は社会インフラ（電力、通信網等）に障害が生じたことにより、当該システム障害取引参加者がシステム呼値を行うことが困難であると東証が認める場合とする。 	

項 目	内 容	備 考
(2) 取引代行取引参加者の指定	<ul style="list-style-type: none"> ・システム障害取引参加者は、障害発生時に他の取引参加者の中からその承諾を得て、債券先物取引、指数先物取引及びオプション取引でそれぞれ一の取引参加者を限度として取引代行取引参加者を指定することができる。なお、他の取引参加者から承諾を得る際には、本要綱（別途東証が定める事務手続を含む。）に掲げる取引代行に係る手続を履行する旨の了承も得るものとする。 	
(3) 取引代行の承認	<ul style="list-style-type: none"> ・システム障害取引参加者は、既存建玉に係る清算事務及び本要綱に掲げる諸手続を履行することについて了承したうえで、東証の承認を求めものとする。 ・システム障害取引参加者は、取引代行取引参加者として指定する他の取引参加者の承諾を得られた旨を証する書面と共に、東証が定める承認申請書を提出する。 	<ul style="list-style-type: none"> ・システム障害取引参加者は、承認申請を取引代行を開始する前までにファクシミリ等により行う。
(4) 取引代行が可能な取引の範囲	<ul style="list-style-type: none"> ・システム障害取引参加者の自己及び委託取引（新規及び転売・買戻し） 	<ul style="list-style-type: none"> ・取引代行取引参加者が代行する取引の呼値を行う際には、委託取引の区分で行う。
4 . 手続		
(1) 取引代行取引参加者		
a 取引の移管	<p>《取引日当日》</p> <ul style="list-style-type: none"> ・代行した約定について取引日の 16 時 45 分までに、清算システム参加者標準端末（以下「CMF 端末」という。）から、ギブアップ機能を利用してシステム障害取引参加者へ取引を移すこととする。 	<ul style="list-style-type: none"> ・顧客確認コード、補助コードについては、必要に応じて障害参加者と確認のうえ、入力するものとする。 ・ギブアップ契約は不要です。
b 代行数量の申告	<ul style="list-style-type: none"> ・東証が定める時限までに、取引代行により成立した銘柄名並びに個別約定ごとの約定通知番号、約定値段及び約定数量等を、東証が定める様式の書面により東証に申告するものとする。 	<ul style="list-style-type: none"> ・17:00 頃までを目処として、Target 登録もしくはファクシミリで行う。 ・イブニング・セッションの取引代行数量の申告は、翌営業日の 17 時頃

項 目	内 容	備 考
c 転売・買戻し等の申告	<ul style="list-style-type: none"> 取引代行により成立した取引については、取引代行取引参加者において転売・買戻し、権利行使の申告は行わない。したがって、取引代行取引参加者が行う転売・買戻しの申告は、取引代行分を除いた数量についてCMF端末から行うものとする。 	<p>までを目処とする。</p>
d 委託分の取引証拠金所要額の申告	<ul style="list-style-type: none"> 委託分に係る取引証拠金所要額について、取引代行取引参加者は、取引代行分を除いた額を日本証券クリアリング機構（当該取引代行取引参加者が非清算参加者である場合は、その指定清算参加者）に申告するものとする。 	
e CMF 端末「取引明細照会」画面等への表示	<ul style="list-style-type: none"> 取引代行分に係る取引明細等は、取引代行取引参加者の「取引明細照会」画面に表示する。 	
f CMF 端末画面上の建玉残高の表示	<ul style="list-style-type: none"> 建玉残高の表示は、取引代行分を含まない数値となる。 	
g 取引証拠金の預託	<ul style="list-style-type: none"> 取引代行取引参加者による取引代行分の取引証拠金の預託又は差入れは不要とする（システム障害取引参加者が預託又は差入れする）。 	
h 引直差金等の授受	<ul style="list-style-type: none"> 取引代行により成立した先物取引の引直差金（権利行使の申告及び権利行使の割当てに伴う差金を含む。）及びオプション取引の取引代金については、システム障害取引参加者（当該取引代行取引参加者が非清算参加者である場合は、その指定清算参加者）が授受する。 	<ul style="list-style-type: none"> 取引代行取引参加者のCMF 端末画面等上における引直差金及び取引代金には、取引代行分は含まれない。

項 目	内 容	備 考
(2) システム障害取引参加者 a 取引の確定 b 代行数量の申告 c 転売・買戻し等の申告 d 委託分の取引証拠金所要額の申告 e C M F 端末「取引明細照会」画面等の表示	<p>《取引日当日》</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ C M F 端末から、テイクアップ機能を利用して、取引日の 17 時までには代行分の取引を確定するものとする。 ・ 東証が定める時限までに、取引代行取引参加者の取引代行により成立した銘柄名並びに個別約定ごとの約定通知番号、約定値段、約定数量及び、自己・委託の別等を東証が定める様式の書面により東証に申告するものとする。 ・ 転売・買戻し、権利行使申告を行う際は、取引代行分を含んだ数量について C M F 端末から行うものとする。 ・ 委託分に係る取引証拠金所要額について、システム障害取引参加者は、取引代行分を加味した額について日本証券クリアリング機構（当該システム障害取引参加者が非清算参加者である場合は、その指定清算参加者）に申告するものとする。 ・ 取引代行分に係る取引明細等は、取引代行取引参加者の「取引明細照会」画面に表示する。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 17 時頃までを目処として Target 登録もしくはファクシミリにより行う。 ・ イブニング・セッションの取引代行数量の申告は、翌営業日の 17 時頃までを目処とする。

項 目	内 容	備 考
f C M F 端末画面上の建玉残高の表示	<ul style="list-style-type: none"> ・建玉残高の表示は、取引代行分を含む数値となる。 	
g 取引証拠金の預託	<ul style="list-style-type: none"> ・システム障害取引参加者は、取引代行取引参加者による取引代行分及び転売・買戻し等を加味した建玉残高に基づき算出された所要額以上の取引証拠金を預託又は差入れするものとする。 	
h 引直差金等の授受	<ul style="list-style-type: none"> ・取引代行により成立した先物取引の引直差金（権利行使の申告及び権利行使の割当てに伴う差金を含む。）及びオプション取引の取引代金については、システム障害取引参加者が授受する。 	<ul style="list-style-type: none"> ・当該システム障害取引参加者が非清算参加者の場合は、その指定清算参加者を通じて行う。
(3) その他	<ul style="list-style-type: none"> ・先物・オプション取引口座設定約諾書の取引代行取引参加者への差入れは不要とする。 ・取引代行分に係る取引料（国債先物オプション取引の権利行使又は権利行使の割当てにより成立した国債先物取引に係る取引料を除く。）は取引代行取引参加者が、国債先物オプション取引の権利行使又は権利行使の割当てにより成立した国債先物取引に係る取引料及び清算手数料は、システム障害取引参加者が支払うこととする。 	<ul style="list-style-type: none"> ・システム障害取引参加者と取引代行取引参加者の間において契約書を作成する場合には、あくまで非常措置であること、実際に取引代行に伴う両者の関係を一律に規定するのは困難であることから、当事者間で作成することとする。 ・清算手数料については、システム障害参加者が日本証券クリアリング機構に支払うこととなる。 ・ギブアップ手数料は課金しない。

項 目	内 容	備 考
	<p>【連絡先・諸書類提出先】</p> <p>株式会社 東京証券取引所 派生商品部</p> <p>先物取引関係 電話 050-3377-7832 FAX 03 - 3639 - 4688</p> <p>オプション取引関係 電話 050-3377-7855 FAX 03 - 3668 - 2856</p> <p style="text-align: right;">以 上</p>	

- * この実施要綱は、西暦2000年問題対応時に策定されたコンティンジェンシープランを踏まえ、平成11年9月29日に制定されたものです。
- * 平成 16 年 2 月 2 日に東証先物・オプション取引に係る清算機関が東証から日本証券クリアリング機構に変更となったことに伴い、所要の改正を行っています。
- * 平成 18 年 1 月 30 日に日本証券クリアリング機構の清算システムのリブレースに伴い、所要の改正を行っています。
- * 平成 20 年 1 月 15 日にギブアップ制度の導入等に伴い、所要の改正を行なっています。
- * 平成 20 年 6 月 16 日に先物・オプション取引に係る新商品導入に伴い、所要の改正を行なっています。
- * 平成 21 年 12 月 30 日に東証における半休日の廃止等に伴い、所要の改正を行なっています。
- * 平成 23 年 11 月 21 日に先物取引の Tdex+システムへの移行に伴い、

システム障害時等における先物・オプション取引の取引代行の取扱いに関する事務手続きについて

平成23年11月21日
 株式会社東京証券取引所
 株式会社日本証券クリアリング機構

項 目	システム障害取引参加者	取引代行取引参加者	留意事項
1 .取引代行の取扱いの承認申請	<ul style="list-style-type: none"> ・既存建玉に係る清算事務及び取引代行に係る申告書の提出等、一連の手続きの履行が可能であることを確認してください。 ・取引代行取引参加者を指定するに際しては、取引代行に係る手続きを履行する旨の承諾を当該取引代行取引参加者から得てください。具体的には、取引代行取引参加者から、当該取引代行取引参加者が取引代行の取扱いに係る東証規則、実施要綱及び事務手続きに従うことを了承する旨を証した書面を受領してください。 ・取引代行の取扱いの承認申請は、システム障害取引参加者が、以下の書面を東京証券取引所（以下、東証という。）にファクシミリ送信することにより行います。 「取引代行の取扱い適用承認申請書（別紙1）」 取引代行取引参加者が取引代行の取扱いに係る東証規則、実施要綱及び事務手続きに従うことを了承する旨を証した書面 	<ul style="list-style-type: none"> ・取引代行取引参加者となることを了承するに際しては、取引代行の取扱いに係る東証規則、実施要綱及び事務手続きに従うことを了承する旨を証した書面をシステム障害取引参加者に交付してください。 	<ul style="list-style-type: none"> ・東証は、システム障害取引参加者から取引代行の取扱い適用承認申請に係る左記 及び の書面を受信した場合には、電話により、当該取引参加者に対し一連の手続きの履行及び通信手段の確保の状況について確認した後、承認を行います。 ・左記 及び の書面は、取引代行の取扱いを申請する市場を担当する東証部署あてに送信してください。（御面倒でも指数先物取引、債券先物取引及びオプション取引の担当部署にそれぞれ送信してください。）

項 目	システム障害取引参加者	取引代行取引参加者	留意事項
<p>2. 取引代行の取扱いによるギブアップ機能の利用等</p> <p>(1) 取引代行の取扱いによる注文の発注と受託</p> <p>(2) ギブアップ機能の利用</p> <p>(3) 取引代行数量等の申告</p>	<p>・自己及び委託取引について、取引代行取引参加者に発注を行ってください。</p> <p>・取引代行の取扱いによる約定について、清算システム取引参加者端末（以下「CMF 端末」という）より、テイクアップしてください。</p> <p><テイクアップを行う約定></p> <p>・銘柄、約定値段等の約定内容 取引代行取引参加者に発注し、約定に関する通知のあったものと一致している約定</p> <p>・ギブアップ取引参加者 取引代行取引参加者</p> <p>・テイクアップ管理区分 当該約定に関して指示した自己委託区分</p> <p>・顧客確認コード・補助コード 取引代行取引参加者と確認したコード</p> <p>・商品別の「取引代行数量申告書(システム障害取引参加者用)(別紙2-1~2-5)」に、銘柄名、並びに個別約定ごとの約定通知番号、約定値段、約定数量及び自己・委託の別等を記載し、同一取引日の 17 時までに Target 登録</p>	<p>・システム障害取引参加者から取引代行の取扱いによる受託をした場合には、Tdex+システムへ委託注文として注文入力を行ってください。</p> <p>・取引代行の取扱いによる約定について、CMF 端末より、ギブアップしてください。</p> <p><入力内容></p> <p>・テイクアップ取引参加者コード（必須） システム障害取引参加者</p> <p>・テイクアップ管理区分（必須） システム障害取引参加者から受託した際の自己委託区分</p> <p>・顧客確認コード・補助コード（任意） システム障害取引参加者と確認したコード</p> <p>・商品別の「取引代行明細書(取引代行取引参加者用)(別紙3-1~3-5)」に、システム障害取引参加者ごとに、銘柄名、並びに個別約定ごとの約定通知番号、約定値段及び約定数量等を記載し、同一取引日の 17 時ま</p>	<p>・通常のギブアップ・テイクアップと同様の操作方法となっています。</p> <p>・時限は、ギブアップ申告は 16 時 45 分まで、テイクアップ申告は 17 時までです。</p> <p>・東証は、「取引代行数量申告書(システム障害取引参加者用)」と「取引代行明細書(取引代行取引参加者用)」を照合し、照合結果を電話にて連絡いたします。</p>

項 目	システム障害取引参加者	取引代行取引参加者	留意事項
(4) 転売・買戻しの申告	<p>もしくは下記 F A X 送信先まで送信してください。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・当日、システム障害発生前又はシステム障害回復後に成立した取引（以下、「障害発生前取引等」という。）がある場合でも、「取引代行数量申告書（システム障害取引参加者用）」には、<u>取引代行分のみの約定等を御記入ください。</u> ・取引代行分の転売・買戻し、権利行使申告は、障害発生前取引分と合算のうえ、C M F 端末から入力することにより行ってください。なお、国債先物オプション取引の権利行使・割当てに係る国債先物取引の転売・買戻し（権利行使対応分）申告についても同様です。 	<p>でに Target 登録もしくは下記 F A X 送信先まで送信してください。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・取引代行分の転売・買戻し、権利行使申告の必要はありません。取引代行取引参加者が行う転売・買戻し、権利行使の申告は、取引代行分を除いた数量について C M F 端末から入力することにより行ってください。なお、国債先物オプション取引の権利行使・割当てに係る国債先物取引の転売・買戻し（権利行使対応分）申告についても同様です。 	<ul style="list-style-type: none"> ・照合の結果、取引代行数量等が不一致となった場合にも、C M F 端末でギブアップ機能を利用して申告したとおりに取引が移ります。したがって、この場合は、速やかに両参加者間で不一致の内容を確認し、取引代行数量申告書・取引代行明細書を再提出していただきます。 ・時限は 17 時まで。なお、国債先物オプション取引の権利行使・割当てに係る国債先物取引の転売・買戻し（権利行使対応分）申告は翌営業日の 8 時から 8 時 30 分までです（通常どおり）。
(5) 委託分の証拠金所要額の申告	<ul style="list-style-type: none"> ・取引代行分及び障害発生前取引分等を加味した委託分の証拠金所要額を同一取引日の 18 時 30 分までに C M F 端末にて日本証券クリアリング機構（システム障害取引参加者又は取引代行取引参加者が、非清算参加者である場合は、その指定参加者）に申告してください。 	<ul style="list-style-type: none"> ・取引代行分を除いた委託分の証拠金所要額を同一取引日の 18 時 30 分までに C M F 端末にて申告してください。 	<ul style="list-style-type: none"> ・国債先物取引の委託分の証拠金所要額の算出に当たっては、国債先物オプション取引の権利行使及び権利行使割当数量を加味した数量としてください。（通常どおり）

項 目	システム障害取引参加者	取引代行取引参加者	留意事項
3. C M F 端末上の記載数値について	・取引代行分について端末上はテイクアップしたものと表示されます。	・取引代行分について端末上はギブアップしたものと表示されます。	
4. 投資部門別内容報告書の記載数値について	・取引代行分を含めた数値を報告してください。	・取引代行分を除いた数値を報告してください。	

以 上

FAX送信先

株式会社 東京証券取引所 派生商品部

先物取引関係 03(3639)4688

オプション取引関係 03(3668)2856

連絡先(電話)

株式会社 東京証券取引所 派生商品部

先物取引関係 050(3377)7832

オプション取引関係 050(3377)7855