

## 引け値を条件とした取引及びこれに伴う自己取引に関する規則 (平 15. 3. 19)

### (目 的)

**第 1 条** この規則は、引け値を条件とした取引の受託及びこれに伴う自己取引に係る社内管理体制の整備について定めることにより、取引の公正性を図り、もって投資者の保護に資することを目的とする。

### (定 義)

**第 2 条** この規則において、次の各号に掲げる用語の定義は、当該各号に定めるところによる。

1 引け値を条件とした取引

会員が顧客との間で金融商品取引法第 2 条第 17 項に規定する取引所金融商品市場（以下「取引所金融商品市場」という。）に上場している有価証券について、取引所金融商品市場における当日の終値を基にした価格で売買することをあらかじめ約し、終値決定後に当該価格で執行する取引及びこれに準ずる取引をいう。

2 自己取引

引け値を条件とした取引の執行に先立ち、会員が取引所金融商品市場において当該取引により発生する自己ポジションのリスクヘッジのために行う自己勘定による同一銘柄の有価証券の売買（取引所金融商品市場にあつては売買立会による売買に限る。）をいう。

### (社内管理体制の整備)

**第 3 条** 会員は、引け値を条件とした取引及びこれに伴う自己取引を行う場合には、次の各号に掲げる手続きの区分に応じ、当該各号に定める事項を含めた社内規則を制定しなければならない。

1 引け値を条件とした取引を受託する際の手続きについて

受託する場合における顧客への説明に関する事項

2 自己取引を執行する際の手続きについて

イ 個別銘柄の流動性を考慮した執行に関する事項

ロ 終値決定前の取引に係る留意点又は制約に関する事項

2 会員は、引け値を条件とした取引及びこれに伴う自己取引について、他の自己勘定による売買と区分する等、売買管理において、前項に規定する社内規則の遵守状況を適宜確認する体制を整備するとともに、定期的な社内検査においても上記の社内規則の遵守状況を検査する体制を整備しなければならない。

付 則（平 15. 3. 19）

この理事会決議は、本協会が別に定める日から施行する。

（注）「本協会が別に定める日」は、平成 15 年 5 月 1 日。

付 則（平 16. 10. 19）

この改正は、本協会が別に定める日から施行する。

（注） 1 自主規制会議規則第 12 条に基づき、「自主規制会議決議」として取り扱う。

2 改正条項は、次のとおりである。

（1） 2 及び 3 を改正。

（2） 「本協会が別に定める日」は平成 16 年 12 月 13 日。

付 則（平 19. 9. 18）

この改正は、平成 19 年 9 月 30 日から施行する。

（注） 1 本理事会決議を「理事会決議」から「自主規制規則」に改める。

2 改正条項は、次のとおりである。

（1） 条、項、号で表記。

（2） 規則の題名、第 1 条、第 2 条、第 3 条第 1 項本文、第 3 条第 2 項を改正。