

清算基金所要額に関する規則

(目的)

第1条 この規則は、業務方法書第16条の規定に基づき、清算基金所要額を定める。

第2条

(清算基金所要額)

第2条 業務方法書第16条の規定に基づく各清算参加者が有する清算資格の種類ごとの清算基金所要額は、別表「清算基金所要額の算出に関する表」によるものとする。

2 前項の規定にかかわらず、新たに清算資格を取得した者が預託すべき当該清算資格に係る清算基金所要額は、当該清算資格取得申請者の会社規模、その取引実績及び見込み、清算資格の取得の申請を行った日において当該清算資格を有する各清算参加者の当該清算資格に係る清算基金所要額を合計した額を当該清算参加者数で除して得た金額等を勘案のうえ、当社がその都度定める額とし、当社が必要と認める期間これを適用する。

3 当社は、現物清算資格及びFX清算資格に係る各清算参加者の清算基金所要額を、前月の末日を現物等清算基金所要額算出基準日として毎月算出し、当月の4日目(休業日を除く。以下日数計算において同じ。)の日に各清算参加者に通知する。

4 前項の規定により算出した現物清算資格及びFX清算資格に係る各清算参加者の清算基金所要額は、当月の5日目の日から適用する。

5 当社は、国債先物等清算資格、指数先物等清算資格、貴金属先物等清算資格、ゴム先物等清算資格及び農産物先物等清算資格に係る各清算参加者の清算基金所要額を、毎営業日を先物・オプション清算基金所要額算出基準日として算出し、当該先物・オプション清算基金所要額算出基準日の翌日に各清算参加者に通知する。

6 前項の規定により算出した国債先物等清算資格、指数先物等清算資格、貴金属先物等清算資格、ゴム先物等清算資格及び農産物先物等清算資格に係る各清算参加者の清算基金所要額は、先物・オプション清算基金所要額算出基準日の翌日から適用する。

7 業務方法書第16条第3項に規定する当社が定める額は、清算資格の種類ごとの清算基金所要額からそれぞれ10億円を控除した額を2で除して得た額(当該額につき円位未満の端数を生じた場合は、切り上げる。)を合計した額とする。ただし、当該額が負となる場合には、当該額は零とする。

(清算基金所要額の臨時変更)

第3条 前条の規定にかかわらず、清算参加者が合併する場合、新たに非清算参加者の指定清算参加者となる場合その他当社が必要と認める場合は、当該清算参加者に係る清算資格の種類ごとの清算基金所要額を臨時に変更することができる。

付 則

- 1 この規則は、平成 15 年 1 月 10 日から施行する。
- 2 平成 15 年 1 月 10 日以前の期間に係る内国株券等基準値の算定については、別表中「清算約定」とあるのは「売買」とする。
- 3 第 2 条第 2 項の規定にかかわらず、平成 15 年 1 月 14 日において自社清算資格を取得する者の現物取引清算基金所要額は、第 2 条第 1 項の規定によるものとする。

付 則

- 1 この改正規定は、平成 16 年 2 月 2 日から施行する。
- 2 第 2 条第 3 項の規定にかかわらず、平成 16 年 2 月 2 日において株券オプション清算資格、国債先物等清算資格又は株価指数先物等清算資格(各清算資格に係る自社清算資格に限る。)を取得する者の株券オプション清算基金所要額、国債先物等清算基金所要額又は株価指数先物等清算基金所要額は、第 2 条第 1 項の規定によるものとする。

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 7 月 3 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 3 月 23 日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成 24 年 12 月 1 日から施行する。

付 則

- 1 この改正規定は、平成 25 年 7 月 16 日から施行する。ただし、第 2 条及び別表 1 の改正規定は、同年 7 月 12 日から施行する。
- 2 平成 26 年 2 月 6 日までの間に適用される国債先物等清算資格、指数先物等清算資格及び FX 清算資格に係る清算基金所要額の算出においては、この改正規定施行の日以前の

株式会社大阪証券取引所(以下「大証」という。)と大証の清算参加者の間の未決済約定、差金代金額、大証の清算参加者が大証に預託していた取引証拠金及び取引証拠金所要額を、当社と当該清算参加者の間の未決済約定、差金代金額、清算参加者が当社に預託していた取引証拠金及び取引証拠金所要額とそれぞれみなして別表1に基づき算出を行うものとする。

付 則

この改正規定は、平成25年9月9日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成26年1月6日から施行する。

付 則

この改正規定は、平成26年2月28日から施行する。

付 則

- 1 この改正規定は、平成26年3月24日から施行する。
- 2 前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社又は当社以外の機関が設置する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、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、平成26年3月24日以後の当社が定める日から施行する。

付 則(平成27年9月24日)

この改正規定は、平成27年9月24日から施行する。

付 則(平成27年10月13日)

- 1 この改正規定は、平成27年10月13日から施行する。
- 2 前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社又は当社以外の機関が設置する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、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、平成27年10月13日以後の当社が定める日から施行する。

付 則(平成28年1月8日)

- 1 この改正規定は、平成28年1月8日から施行する。
- 2 前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社又は当社以外の機関が設置する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、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、平成 28 年 1 月 8 日以後の当社が定める日から施行する。

付 則(平成 28 年 8 月 10 日)

この改正規定は、平成 28 年 8 月 10 日から施行し、同日を先物オプション清算基金所要額算出基準日とする国債先物等清算資格及び指数先物等清算資格に係る各清算参加者の清算基金所要額から適用する。

付 則(平成 30 年 2 月 13 日)

- 1 この改正規定は、平成 30 年 2 月 13 日から施行する。ただし、第 2 条第 7 項の規定は、同年 2 月 9 日から施行する。
- 2 前項の規定にかかわらず、第 2 条第 7 項の改正規定を除き、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社又は当社以外の機関が設置する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、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、平成 30 年 2 月 14 日以後の当社が定める日から施行する。
- 3 前 2 項の規定にかかわらず、施行日前の未決済約定に係る改正後の別表 2. a(注 1-1-2)に規定する基準 PML 額 J G B、3. a(注 1-1-1)に規定する基準 PML 額 I D X 及び 2. b に規定する個社按分基礎 IM 額 J G B、3. b に規定する個社按分基礎 IM 額 I D X については、なお従前の例による。

付 則(平成 30 年 6 月 25 日)

- 1 この改正規定は、平成 30 年 6 月 25 日から施行する。
- 2 前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社又は当社以外の機関が設置する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、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、平成 30 年 6 月 25 日以後の当社が定める日から施行する。

付 則(平成 30 年 12 月 28 日)

この改正規定は、平成 30 年 12 月 28 日から施行し、同日を先物・オプション清算基金所要額算出基準日とする国債先物等清算資格及び指数先物等清算資格に係る各清算参加者の清算基金所要額から適用する。

付 則(令和 2 年 7 月 27 日)

- 1 この改正規定は、令和 2 年 7 月 27 日から施行する。
- 2 前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社又は当社以外の機関が設置する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、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、令和2年7月27日以後の当社が定める日から施行する。

- 3 前2項の規定にかかわらず、この改正規定施行の日(以下「施行日」という。)に適用する国債先物等清算資格及び指数先物等清算資格に係る各清算参加者の清算基金所要額は、施行日の前日を第2条第5項に定める先物・オプション清算基金所要額算出基準日として、改正後の別表2. から6. に定める方法により算出された額とする。
- 4 改正後の別表2. 及び別表3. の規定にかかわらず、国債先物等清算基金所要額及び指数先物等清算基金所要額の算出のためにこの施行日の前日以前の日を算出対象期間として期間平均基準PML額を計算する場合には、当該日の日次最大基準PML額は、改正前の別表2. 及び別表3. に定める方法により算出された額とする。
- 5 改正後の別表4. から別表6. の規定にかかわらず、貴金属先物等清算基金所要額、ゴム先物等清算基金所要額又は農産物先物等清算基金所要額の算出においては、当分の間、期間平均基準PML額から、清算資格の種類ごとに業務方法書第78条第4項に規定する第三者により受領する金銭として当社が定める額及び清算資格の種類ごとに同条第5項に規定する当社の商品先物等決済保証準備金として当社が定める額を控除した額を、期間平均基準PML額とみなして算出を行うものとする。
- 6 改正後の別表4. から別表6. の規定にかかわらず、貴金属先物等清算基金所要額、ゴム先物等清算基金所要額及び農産物先物等清算基金所要額の算出のためにこの施行日の前日以前の日を算出対象期間として期間平均基準PML額を計算する場合の日次最大基準PML額、個社按分基礎IM額及び按分基礎IM総額にあつては、それぞれ当該算出対象期間の東京商品取引所の貴金属市場、ゴム市場及び農産物・砂糖市場に係る日本商品清算機構における建玉に基づき、別表4. から別表6. に定める方法により当社が算出した額とする。
- 7 第2条第2項の規定にかかわらず、この改正規定施行の日において貴金属先物等清算資格、ゴム先物等清算資格又は農産物先物等清算資格を取得する者の貴金属先物等清算基金所要額、ゴム先物等清算基金所要額又は農産物先物等清算基金所要額は、同条第1項の規定によるものとする。

別表

清算基金所要額の算出に関する表

1. 現物清算資格に係る清算基金所要額(以下「現物清算基金所要額」という。)

現物清算基金所要額は、次に定める計算式により算出される額とする。ただし、当該額が1,000万円を下回る場合は、1,000万円とする。なお、計算式における用語の意義は、次のaからcまでに定めるとおりとする。

現物清算基金所要額

＝現物清算基金総額×個社按分基礎当初証拠金所要額／全社総額按分基礎当初証拠金所要額

- a 現物清算基金総額とは、日次最大担保超過リスク額の算出対象期間(現物等清算基金所要額算出基準日からさかのぼって6か月間をいう。第4項において同じ。)における平均額をいう。

(注1) 日次最大担保超過リスク額とは、各日における現物清算資格に係る担保超過リスク額(清算参加者に関係会社等(財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和38年大蔵省令第59号)第8条第5項に規定する関連会社及び同条第8項に規定する関係会社をいう。))に該当する他の清算参加者が存在する場合には、当該他の清算参加者の担保超過リスク額を合計した額)が上位である清算参加者2社の担保超過リスク額の合計額をいう。

(注1-1) 担保超過リスク額とは、ストレスシナリオ(極端ではあるが現実に起こり得る市場環境として当社が定める価格変動の組合せをいう。)の下で各清算参加者の未決済約定から生じる損失額から担保超過リスク額を計算する日の前日において業務方法書第15条の2の規定により算出した当該各清算参加者の当初証拠金所要額(担保超過リスク額を計算する日において同第15条の3の規定により当初証拠金所要額(日中算出分)が算出され、当該当初証拠金所要額(日中算出分)から担保超過リスク額を計算する日の前日における当初証拠金所要額を控除した額が3,000万円を超える場合には、当該当初証拠金所要額(日中算出分))を差し引いた額をいう。

- b 個社按分基礎当初証拠金所要額とは、現物等清算基金所要額算出基準日の属する月の各日における各清算参加者の現物清算資格に係る当初証拠金所要額(業務方法書第15条の2の規定に基づき算出される所要額に限る。)の平均額をいう。
- c 全社総額按分基礎当初証拠金所要額とは、現物等清算基金所要額算出基準日の属する月の各日におけるすべての清算参加者の現物清算資格に係る当初証拠金所要

額(業務方法書第 15 条の 2 の規定に基づき算出される所要額に限る。)の総額の平均額をいう。

2. 国債先物等清算資格に係る清算基金所要額(以下「国債先物等清算基金所要額」という。)

国債先物等清算基金所要額は、次に定める計算式により算出される額とする。ただし、当該額が 1, 000 万円を下回る場合は、1, 000 万円とする。なお、計算式における用語の意義は、次の a から c までに定めるとおりとする。

国債先物等清算基金所要額

= (期間平均基準 PML 額_{JGB}又は算出基準日における日次最大基準 PML 額_{JGB}のいずれか大きい方の値) × 個社按分基礎 IM 額_{JGB} / 按分基礎 IM 総額_{JGB}

- a 期間平均基準 PML 額_{JGB}とは、日次最大基準 PML 額_{JGB}の算出対象期間(先物・オプション清算基金所要額算出基準日からさかのぼって 6 か月間をいう。次項において同じ。)における平均値をいう。

(注 1) 日次最大基準 PML 額_{JGB}とは、ストレスシナリオ別最大基準 PML 額_{JGB}の各日における最大値をいう。

(注 1-1) ストレスシナリオ別最大基準 PML 額_{JGB}とは、各ストレスシナリオにおける清算参加者の基準 PML 額_{JGB}(清算参加者に関係会社等(ある会社の子会社及び関連会社並びに当該ある会社の親会社、当該親会社の子会社及び当該親会社の関連会社をいう。以下同じ。))に該当する他の清算参加者が存在する場合には、当該他の清算参加者の基準 PML 額_{JGB}を合計した額)が最大となる清算参加者の基準 PML 額_{JGB}及び 2 番目に最大となる清算参加者の基準 PML 額_{JGB}の合計額をいう。

(注 1-1-1) ストレスシナリオとは、極端ではあるが現実に起こり得る市場環境として当社が定める価格変動及びボラティリティ変動の組合せをいう。以下この別表において同じ。

(注 1-1-2) 基準 PML 額_{JGB}とは、国債先物等清算資格に係る各区分口座(業務方法書第 46 条の 3 及び第 46 条の 4 に規定する各区分口座をいう。)に関して、ストレスシナリオの下で未決済約定(算出時にクロスマージン対象国債先物清算約定となっているものを除く。)から生じる損失額から国債先物等清算資格に係る取引証拠金所要相当額(清算資格の種類ごとの建玉について計算した取引証拠金所要額に相当する額をいう。以下同じ。)を控除した額(当該各区分口座のうち業務

方法書第 46 条の 3 第 1 号に規定する区分口座以外の区分口座にあつては、正の額に限る。)を合計した額をいう。

- b 個社按分基礎 IM 額_{JGB}とは、各清算参加者の、先物・オプション清算基金所要額算出基準日からさかのぼって 1 か月間の各取引日の国債先物等清算資格に係る取引証拠金所要相当額の総額(各清算参加者が管理する業務方法書第 46 条の 3 及び第 46 条の 4 に規定する区分口座の国債先物等清算資格に係る取引証拠金所要相当額を合算した額をいう。)の平均額をいう。
- c 按分基礎 IM 総額_{JGB}とは、前 b の個社按分基礎 IM 額_{JGB}を、すべての国債先物等清算参加者について合算した額をいう。

3. 指数先物等清算資格に係る清算基金所要額(以下「指数先物等清算基金所要額」という。)

指数先物等清算基金所要額は、次に定める計算式により算出される額とする。ただし、当該額が 1, 000 万円を下回る場合は、1, 000 万円とする。なお、計算式における用語の意義は、次の a から c までに定めるとおりとする。

指数先物等清算基金所要額

= (期間平均基準 PML 額_{IDX}又は算出基準日における日次最大基準 PML 額_{IDX}のいずれか大きい方の値) × 個社按分基礎 IM 額_{IDX} / 按分基礎 IM 総額_{IDX}

- a 期間平均基準 PML 額_{IDX}とは、日次最大基準 PML 額_{IDX}の算出対象期間における平均値をいう。

(注 1) 日次最大基準 PML 額_{IDX}とは、ストレスシナリオ別最大基準 PML 額_{IDX}の各日における最大値をいう。

(注 1-1) ストレスシナリオ別最大基準 PML 額_{IDX}とは、各ストレスシナリオにおける清算参加者の基準 PML 額_{IDX}(清算参加者に関係会社等に該当する他の清算参加者が存在する場合には、当該他の清算参加者の基準 PML 額_{IDX}を合計した額)が最大となる清算参加者の基準 PML 額_{IDX}及び 2 番目に最大となる清算参加者の基準 PML 額_{IDX}の合計額をいう。

(注 1-1-1) 基準 PML 額_{IDX}とは、指数先物等清算資格に係る各区分口座(業務方法書第 46 条の 3 及び第 46 条の 4 に規定する各区分口座をいう。)に関して、ストレスシナリオの下で未決済約定から生じる損失額から指数先物等清算資格に係る取引証拠金所要相当額を控除した額(当該各区分口座のうち業務方法書第 46 条の 3 第 1 号に規定する区分口座以外の区分口座にあつては、正の額に限る。)を合計した額をいう。

- b 個社按分基礎 IM 額_{IDX}とは、各清算参加者の、先物・オプション清算基金所要額算出基準日からさかのぼって1か月間の各取引日の指数先物等清算資格に係る取引証拠金所要相当額の総額(各清算参加者が管理する業務方法書第46条の3及び第46条の4に規定する区分口座の指数先物等清算資格に係る取引証拠金所要相当額を合算した額をいう。)の平均額をいう。
- c 按分基礎 IM 総額_{IDX}とは、前bの個社按分基礎 IM 額_{IDX}を、すべての指数先物等清算参加者について合算した額をいう。

4. 貴金属先物等清算資格に係る清算基金所要額(以下「貴金属先物等清算基金所要額」という。)

貴金属先物等清算基金所要額は、次に定める計算式により算出される額とする。ただし、当該額が1,000万円を下回る場合は、1,000万円とする。なお、計算式における用語の意義は、次のaからcまでに定めるとおりとする。

貴金属先物等清算基金所要額

$$= (\text{期間平均基準 PML 額}_{\text{PME}} \text{ 又は 算出基準日における日次最大基準 PML 額}_{\text{PME}} \text{ のいずれか大きい方の値}) \times \text{個社按分基礎 IM 額}_{\text{PME}} / \text{按分基礎 IM 総額}_{\text{PME}}$$

- a 期間平均基準 PML 額_{PME}とは、日次最大基準 PML 額_{PME}の算出対象期間における平均値をいう。

(注1)日次最大基準 PML 額_{PME}とは、ストレスシナリオ別最大基準 PML 額_{PME}の各日における最大値をいう。

(注1-1)ストレスシナリオ別最大基準 PML 額_{PME}とは、各ストレスシナリオにおける清算参加者の基準 PML 額_{PME}(清算参加者に関係会社等に該当する他の清算参加者が存在する場合には、当該他の清算参加者の基準 PML 額_{PME}を合計した額)が最大となる清算参加者の基準 PML 額_{PME}及び純財産額(登録金融機関及び当業者等にあつては、純資産額とする。以下この別表において同じ。)が下位の5社の清算参加者の当該ストレスシナリオにおける基準 PML 額_{PME}の合計額をいう。

(注1-1-1)基準 PML 額_{PME}とは、貴金属先物等清算資格に係る各区分口座(業務方法書第46条の3及び第46条の4に規定する各区分口座をいう。)に関して、ストレスシナリオの下で未決済約定から生じる損失額から貴金属先物等清算資格に係る取引証拠金所要相当額を控除した額(当該各区分口座のうち業務方法書第46条の3第1号に規定する区分口座以外の区分口座にあつては、正の額に限る。)を合計した額をいう。

- b 個社按分基礎 IM 額_{PME}とは、各清算参加者の、先物・オプション清算基金所要額算出基準日からさかのぼって1か月間の各取引日の貴金属先物等清算資格に係る取引証拠金所要相当額の総額(各清算参加者が管理する業務方法書第46条の3及び第46条の4に規定する区分口座の貴金属先物等清算資格に係る取引証拠金所要相当額を合算した額をいう。)の平均額をいう。
- c 按分基礎 IM 総額_{PME}とは、前bの個社按分基礎 IM 額_{PME}を、すべての貴金属先物等清算参加者について合算した額をいう。
5. ゴム先物等清算資格に係る清算基金所要額(以下「ゴム先物等清算基金所要額」という。)

ゴム先物等清算基金所要額は、次に定める計算式により算出される額とする。なお、計算式における用語の意義は、次のaからcまでに定めるとおりとする。

ゴム先物等清算基金所要額

= (期間平均基準 PML 額_{RUB}又は算出基準日における日次最大基準 PML 額_{RUB}のいずれか大きい方の値) × 個社按分基礎 IM 額_{RUB} / 按分基礎 IM 総額_{RUB}

- a 期間平均基準 PML 額_{RUB}とは、日次最大基準 PML 額_{RUB}の算出対象期間における平均値をいう。

(注1) 日次最大基準 PML 額_{RUB}とは、ストレスシナリオ別最大基準 PML 額_{RUB}の各日における最大値をいう。

(注1-1) ストレスシナリオ別最大基準 PML 額_{RUB}とは、各ストレスシナリオにおける清算参加者の基準 PML 額_{RUB}(清算参加者に関係会社等に該当する他の清算参加者が存在する場合には、当該他の清算参加者の基準 PML 額_{RUB}を合計した額)が最大となる清算参加者の基準 PML 額_{RUB}及び純財産額が下位の5社の清算参加者の当該ストレスシナリオにおける基準 PML 額_{RUB}の合計額をいう。

(注1-1-1) 基準 PML 額_{RUB}とは、ゴム先物等清算資格に係る各区分口座(業務方法書第46条の3及び第46条の4に規定する各区分口座をいう。)に関して、ストレスシナリオの下で未決済約定から生じる損失額からゴム先物等清算資格に係る取引証拠金所要相当額を控除した額(当該各区分口座のうち業務方法書第46条の3第1号に規定する区分口座以外の区分口座にあっては、正の額に限る。)を合計した額をいう。

- b 個社按分基礎 IM 額_{RUB}とは、各清算参加者の、先物・オプション清算基金所要額算出基準日からさかのぼって1か月間の各取引日のゴム先物等清算資格に係る取引証拠金所要相当額の総額(各清算参加者が管理する業務方法書第46条の3及び第

46条の4に規定する区分口座のゴム先物等清算資格に係る取引証拠金所要相当額を合算した額をいう。)の平均額をいう。

- c 按分基礎 IM 総額_{RUB}とは、前bの個社按分基礎 IM 額_{RUB}を、すべてのゴム先物等清算参加者について合算した額をいう。

6. 農産物先物等清算資格に係る清算基金所要額(以下「農産物先物等清算基金所要額」という。)

農産物先物等清算基金所要額は、次に定める計算式により算出される額とする。なお、計算式における用語の意義は、次のaからcまでに定めるとおりとする。

農産物先物等清算基金所要額

= (期間平均基準 PML 額_{AGR}又は算出基準日における日次最大基準 PML 額_{AGR}のいずれか大きい方の値) × 個社按分基礎 IM 額_{AGR} / 按分基礎 IM 総額_{AGR}

- a 期間平均基準 PML 額_{AGR}とは、日次最大基準 PML 額_{AGR}の算出対象期間における平均値をいう。

(注1) 日次最大基準 PML 額_{AGR}とは、ストレスシナリオ別最大基準 PML 額_{AGR}の各日における最大値をいう。

(注1-1) ストレスシナリオ別最大基準 PML 額_{AGR}とは、各ストレスシナリオにおける清算参加者の基準 PML 額_{AGR} (清算参加者に関係会社等に該当する他の清算参加者が存在する場合には、当該他の清算参加者の基準 PML 額_{AGR}を合計した額) が最大となる清算参加者の基準 PML 額_{AGR}及び純財産額が下位の5社の清算参加者の当該ストレスシナリオにおける基準 PML 額_{AGR}の合計額をいう。

(注1-1-1) 基準 PML 額_{AGR}とは、農産物先物等清算資格に係る各区分口座(業務方法書第46条の3及び第46条の4に規定する各区分口座をいう。)に関して、ストレスシナリオの下で未決済約定から生じる損失額から農産物先物等清算資格に係る取引証拠金所要相当額を控除した額(当該各区分口座のうち業務方法書第46条の3第1号に規定する区分口座以外の区分口座にあつては、正の額に限る。)を合計した額をいう。

- b 個社按分基礎 IM 額_{AGR}とは、各清算参加者の、先物・オプション清算基金所要額算出基準日からさかのぼって1か月間の各取引日の農産物先物等清算資格に係る取引証拠金所要相当額の総額(各清算参加者が管理する業務方法書第46条の3及び第46条の4に規定する区分口座の農産物先物等清算資格に係る取引証拠金所要相当額を合算した額をいう。)の平均額をいう。

- c 按分基礎 IM 総額_{AGR}とは、前bの個社按分基礎 IM 額_{AGR}を、すべての農産物先物等清算参加者について合算した額をいう。

7. FX 清算資格に係る清算基金所要額(以下「FX 清算基金所要額」という。)

FX 清算基金所要額は、次に定める計算式により算出される額とする。ただし、当該額が 100 万円の整数倍でないときは、当該額を超える 100 万円の整数倍である金額のうち最も少ない金額とする。なお、計算式における用語の意義は、次の a から c までに定めるとおりとする。

FX 清算基金所要額

$$= \text{期間最大基準 PML 額}_{FX} \times \text{個社按分基礎 IM 額}_{FX} / \text{按分基礎 IM 総額}_{FX}$$

- a 期間最大基準 PML 額_{FX}とは、日次 PML 基準額の算出対象期間における最大値をいう。

(注 1) 日次 PML 基準額とは、想定価格変動参照期間における日々の上位 2 社想定損失額の 99.74% をカバーすることができる最も小さい額とする。

(注 1-1) 想定価格変動参照期間とは、一の取引日から起算して過去 20 年間をいう。

(注 1-2) 上位 2 社想定損失額とは、想定価格変動参照期間における各日の日別想定損失額が上位となる 2 社の当該日別想定損失額の合計額をいう。

(注 1-2-1) 日別想定損失額とは、想定価格変動参照期間における各日において、想定価格変動が生じた場合に発生する各 FX 清算参加者の評価損失相当額(当該一の取引日における当該 FX 清算参加者が保有する建玉から生じる差金(業務方法書第 73 条の 34、第 73 条の 35 及び第 73 条の 37 に規定する金銭をいう。))の合計のうち当該 FX 清算参加者の支払金額をいう。)から取引所 FX 取引に係る取引証拠金預託額等を差し引いて得た額をいう。

(注 1-2-1-1) 想定価格変動とは、想定価格変動参照期間における各日の各金融指標に係る清算数値に、当該各金融指標に係る 3 日間変動率(当該各日の各金融指標に係る清算数値と 3 取引日前の各金融指標に係る清算数値との差を 3 取引日前の金融指標に係る清算数値で除した数値をいう。)をそれぞれ乗じて得られる各金融指標の変動幅をいう。

(注 1-2-1-2) 取引所 FX 取引に係る取引証拠金預託額等とは、当該 FX 清算参加者が当該一の取引日に取引所 FX 取引に係る自己分の取引証拠金として当社に預託している金銭の額並びに当該一の取引日に取引所 FX 取引に係る取引証拠金等に関する規則第 21 条第 1 項の規定により清算参加者が当社に申告した委託分及び有価証券等清算取次ぎ分の取引証拠金所要額の合計額をいう。

- b 個社按分基礎 IM 額_{FX}とは、各清算参加者の、現物等清算基金所要額算出基準日の属する月の各取引日に適用された取引証拠金所要額(FX 清算参加者が取引所 FX 取引に係る取引証拠金等に関する規則第 21 条第 1 項の規定により当社に申告した自己分並びに委託分及び有価証券等清算取次ぎ分の取引証拠金所要額の合計額をいう。)の平均額をいう。
- c 按分基礎 IM 総額_{FX}とは、前 b の個社按分基礎 IM 額_{FX}を、すべての FX 清算参加者について合算した額をいう。