

商品取引債務引受業に関する業務方法書

目次

第1章 総則

第2章 清算参加者

第1節 通則

第2節 商品取引清算資格の取得

第3節 清算参加者の義務

第4節 商品取引清算資格の喪失

第5節 清算参加者に対する措置等

第3章 商品清算取引

第4章 債務の引受け

第5章 先物取引の区分管理等

第6章 清算約定の決済

第7章 最終決済

第1節 受渡しによる決済

第2節 現金決済先物取引における最終決済

第3節 雑則

第8章 取引証拠金及び未決済約定の引継ぎ等

第9章 建玉の移管

第10章 清算預託金

第11章 清算参加者の支払不能時の措置

第12章 雑則

付則

第1章 総則

(目的)

第1条 この商品取引債務引受業(商品先物取引法(昭和25年法律第239号。以下「法」という。))第2条第17項に規定する商品取引債務引受業をいう。以下同じ。)に関する業務方法書(以下「業務方法書」という。)は、法第175条の規定に基づき、当社が行う商品取引債務引受業及びこれに附帯する業務について必要な事項を定める。

(清算対象取引)

第2条 当社の商品取引債務引受業の対象とする債務の起因となる取引(以下「清算対象取引」という。)は、次の各号に定める取引とする。

- (1) 法第2条第3項第1号に定める取引(以下「現物先物取引」という。)
- (2) 法第2条第3項第2号に定める取引(以下「現金決済先物取引」という。)

(指定商品市場)

第3条 前条に規定する清算対象取引は、次の各号に定める当社が指定する市場開設者(以下「指定市場開設者」という。)の商品市場(以下「指定商品市場」という。)の上場商品に係る取引とする。

- (1) 株式会社東京商品取引所 エネルギー市場
- (2) 株式会社東京商品取引所 中京石油市場
- (3) 大阪堂島商品取引所 農産物市場
- (4) 大阪堂島商品取引所 砂糖市場

(営業日及び休業日)

第4条 当社は、次の各号に掲げる日を休業日とし、その他の日を営業日とする。

- (1) 日曜日
- (2) 国民の祝日に関する法律(昭和23年法律第178号)に規定する休日
- (3) 土曜日
- (4) 年始3日間
- (5) 12月31日

- 2 当社は、必要があると認めるときは、臨時休業日を定めることができる。
- 3 当社は、必要があると認めるときは、商品取引債務引受業に係る業務の全部若しくは一部を臨時に停止し又は臨時に行うことができる。
- 4 前2項の場合には、当社は、あらかじめその旨を清算参加者及び指定市場開

設者に通知する。

第2章 清算参加者

第1節 通則

(清算参加者)

第5条 清算参加者とは、当社が行う商品取引債務引受業の相手方となるための資格(以下「商品取引清算資格」という。)を有する者をいう。

2 前項に規定する商品取引清算資格は、エネルギー先物等清算資格、堂島農産物先物等清算資格及び堂島砂糖先物等清算資格の3種類とし、指定商品市場はそれぞれ次の各号に定めるものとする。

(1) エネルギー先物等清算資格は、清算対象取引(ガソリン、灯油、軽油、原油及び電力に係るものに限る。)について当社が行う商品取引債務引受業の相手方となるための資格とし、その指定商品市場は株式会社東京商品取引所のエネルギー市場及び中京石油市場とする。

(2) 堂島農産物先物等清算資格は、清算対象取引(大豆、小豆、とうもろこし及び米穀に係るものに限る。)について当社が行う商品取引債務引受業の相手方となるための資格とし、その指定商品市場は大阪堂島商品取引所の農産物市場とする。

(3) 堂島砂糖先物等清算資格は、清算対象取引(粗糖に係るものに限る。)について当社が行う商品取引債務引受業の相手方となるための資格とし、その指定商品市場は大阪堂島商品取引所の砂糖市場とする。

3 前項第1号に定めるエネルギー先物等清算資格を有する者をエネルギー先物等清算参加者と、同項第2号に定める堂島農産物先物等清算資格を有する者を堂島農産物先物等清算参加者と、同項第3号に定める堂島砂糖先物等清算資格を有する者を堂島砂糖先物等清算参加者という。

4 第1項に規定する商品取引清算資格は、当社が行う商品取引債務引受業に関して、商品取引清算資格の種類ごとに、商品清算取引(法第2条第20項の商品清算取引をいう。以下同じ。)を行うことができない商品取引清算資格(以下「自社清算資格」という。)と、第3章に定めるところにより商品清算取引を行うことができる商品取引清算資格(以下「他社清算資格」という。)に区分し、自社清算資格を有する清算参加者を自社清算参加者と、他社清算資格を有する清算参加者を他社清算参加者と称する。

第2節 商品取引清算資格の取得

(商品取引清算資格の取得の申請及び承認)

第 6 条 商品取引清算資格を取得しようとする者は、前条第 2 項に定める商品取引清算資格の種類ごとに、自社清算資格又は他社清算資格の別を示して、当社が定めるところにより、当社に商品取引清算資格の取得の申請を行わなければならない。

- 2 前項の規定による商品取引清算資格の取得の申請に際し、親会社等(取得申請者の親会社(取得申請者の財務及び事業の方針の決定を支配している他の法人等をいい、当該他の法人等の親会社を含む。以下同じ。))及び取得申請者の親会社の子会社(取得申請者の親会社によって財務及び事業の方針の決定を支配されている他の法人等をいい、当該他の法人等の子会社を含む。以下同じ。))その他これらに類する者として当社が認める者をいう。以下同じ。)からの保証(以下「親会社等保証」という。)を受けようとする商品取引清算資格の取得申請者は、当社が定める様式による当該親会社等の保証に関する書面(当社が当該書面と内容が同一であると認める書面を含む。)を当社に提出するものとする。
- 3 当社は、第 1 項の規定により商品取引清算資格の取得申請者から商品取引清算資格の取得の申請があった場合において、審査により適当であると認めるときは、当該商品取引清算資格の取得の承認を行う。
- 4 前項の承認は、商品取引清算資格を取得すべき期日を指定して行う。

(商品取引清算資格の要件)

第 7 条 前条第 1 項の申請に係る同条第 3 項の審査は、商品取引清算資格の取得申請者に関する次の各号に定める要件を満たしていること、その他商品取引債務引受業の運営に関して必要と認める事項について行うものとする。

(1) 取引参加者資格等

自社清算資格の取得を申請する場合にあつては、当該清算資格を取得すべき期日までに、指定市場開設者の会員等(法第 2 条第 20 項の会員等をいう。以下同じ。)であること又は指定市場開設者の会員等になることが見込まれること。

(2) 経営の体制

当社の商品取引債務引受業の運営に鑑みて適当でないと認められる者の支配又は影響を受けていないことなど当社が行う商品取引債務引受業について社会的な信用が十分に確保されると見込まれる健全な経営の体制であること。

(3) 拠点

国内に営業所又は事務所を有すること。

(4) 業務執行体制

清算対象取引について第 52 条に定める債務の引受けに係る約定(以下「清算約定」という。)の決済、損失の危険の管理並びに法令(法及びその関係法令をいう。以下同じ。)、法令に基づく行政処分及びこの業務方法書その他の当社が定める規則の遵守に関し適切な業務執行の体制を備えていること。

(5) 財務基盤

次の a 又は b に掲げる区分に従い、当該 a 又は b に定める基準に適合すること。

a 次の b に掲げる者以外の者

以下に定める全ての要件を満たすこと。

- (a) 収支状況において安定的収益が見込まれること。
- (b) 資本金の額又は出資の総額(相互会社にあつては、基金(基金償却積立金を含む。))の総額)が 3 億円以上であること。
- (c) 純資産額が 20 億円以上(他社清算資格の場合には 200 億円以上)であり、かつ、資本金の額又は出資の総額(相互会社にあつては、基金(基金償却積立金を含む。))の総額)を上回っていること。
- (d) 商品先物取引業者(法第 2 条第 23 項の商品先物取引業者をいう。以下同じ。)のうち法第 211 条第 1 項の規定により純資産額規制比率を適用される商品先物取引業者にあつては、純資産額規制比率(法第 211 条に規定する純資産額規制比率をいう。以下同じ。)が 200 パーセントを上回っていること。
- (e) 商品先物取引業者(前(d)の規定の適用を受ける者に限る。)以外の者にあつては、保有する資産等に照らし、自己資本の充実の状況が適当であること。

b 親会社等保証を受ける者

以下に定める全ての要件を満たすこと。

- (a) 収支状況において安定的収益が見込まれること。
- (b) 資本金の額又は出資の総額(相互会社にあつては、基金(基金償却積立金を含む。))の総額)が 3 億円以上である親会社等による保証を受けること。
- (c) 純資産額が 200 億円以上であり、かつ、資本金の額又は出資の総額(相互会社にあつては、基金(基金償却積立金を含む。))の総額)を上回っている親会社等による保証を受けること。
- (d) 商品先物取引業者のうち法第 211 条第 1 項の規定により純資産額規制比率を適用される商品先物取引業者にあつては純資産額規制比率が

200 パーセントを上回っていること。

- (e) 商品先物取引業者(前(d)の規定の適用を受ける者に限る。)以外の者にあつては、保有する資産等に照らし、自己資本の充実の状況が適当であること。

(商品取引清算資格の取得手続の履行)

第 8 条 当社が第 6 条第 3 項の規定により商品取引清算資格取得の承認を行ったときは、当社は同条第 4 項の規定により当社が指定した期日の前日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。以下同じ。)までに、商品取引清算資格の取得申請者をして、清算基金の預託その他当社が定める商品取引清算資格の取得手続を履行させるものとする。

- 2 商品取引清算資格の取得申請者が第 6 条第 4 項の規定により、当社が指定した期日の前日までに、前項の手続を履行しないときは、その商品取引清算資格の取得申請を取り下げたものとみなす。

(商品取引清算資格取得の日)

第 9 条 当社は商品取引清算資格の取得申請者が前条第 1 項による手続を履行したときは、第 6 条第 4 項の規定により当社が指定した期日に、当該申請に係る商品取引清算資格を付与する。

- 2 当社は、前項の規定により商品取引清算資格の取得申請者に商品取引清算資格を付与したときは、その旨を当該清算資格を有する各清算参加者及び当該商品取引清算資格に係る指定市場開設者に対して通知する。

(非清算参加者が商品取引清算資格を取得した場合の未決済約定の取扱い)

第 10 条 指定市場開設者の会員等であつて当社の商品取引清算参加者でない者(以下「非清算参加者」という。)が、前条第 1 項の規定により商品取引清算資格を取得して清算参加者となったときは、当該非清算参加者は、当該非清算参加者が当該指定市場開設者の定めるところにより常に商品清算取引の委託先とする者として指定した清算参加者(以下「指定清算参加者」という。)から当該非清算参加者の商品清算取引に基づく清算約定で未決済のものを引き継ぐものとする。

(商品取引清算資格の区分の変更)

第 11 条 第 6 条、第 7 条、第 9 条、第 26 条及び第 27 条の規定は、清算参加者がその有する商品取引清算資格の区分を変更する場合について準用する。この場合において、第 6 条第 1 項中「商品取引清算資格を取得」とあるのは「商

品取引清算資格の区分を変更」と、第6条第1項から第3項中「商品取引清算資格の取得」とあるのは「商品取引清算資格の区分の変更」と、第6条第2項中「取得申請者」とあるのは「変更申請者」と、同条第2項及び第3項、第7条並びに第9条中「商品取引清算資格の取得申請者」とあるのは「商品取引清算資格の区分の変更申請者」と、第6条第4項及び第7条第1号中「清算資格を取得すべき期日」とあるのは「清算資格の区分を変更すべき期日」と、第7条第1号中「自社清算資格の取得」とあるのは「自社清算資格への区分の変更」と、第9条第1項中「商品取引清算資格を付与する」とあるのは「商品取引清算資格の区分を変更する」と、同条第2項中「に商品取引清算資格を付与したとき」とあるのは「の商品取引清算資格の区分を変更したとき」と、第26条中「喪失」とあるのは「自社清算資格への区分の変更」と、第26条中「清算約定」とあるのは「清算約定のうち、非清算参加者に係る清算約定」と、第27条中「喪失」とあるのは「区分変更」と、それぞれ読み替えるものとする。

(親会社等保証に係る取扱い)

第12条 清算参加者が第7条第5号bに定める基準に適合する場合には、当該清算参加者の親会社等に当社が定める様式による保証に関する書面(当社が当該書面と内容が同一であると認める書面を含む。)を当社に提出させることにより、当該親会社等から親会社等保証を受けることができる。この場合において、当該親会社等に対しては、この業務方法書(この業務方法書に基づく規則を含む。)の親会社等に係る規定が適用されるものとする。

第3節 清算参加者の義務

(清算参加者契約の締結)

第13条 清算参加者は、当社との間で、当社が定める清算参加者契約を締結しなければならない。

(清算参加者代表者)

第14条 清算参加者は、その代表取締役又は代表執行役(清算参加者が外国の法令に準拠して設立された法人の場合は、日本における代表者で、かつ、取締役又は執行役と同等以上の地位にある者)のうちから、当社において当該清算参加者を代表するのに適当な者1人を、当社が定めるところにより、あらかじめ清算参加者代表者として当社に届け出なければならない。

2 清算参加者と当社との関係においては、清算参加者代表者のみが当該清算参

加者を代表するものとする。ただし、日常業務に関しては、あらかじめその範囲を明確にして、当社に届け出た日常業務代行者をして行わせることができる。

(決済業務責任者)

第 15 条 清算参加者は、清算約定の決済に係る業務の統括に当たらせるため、その役員又は従業員のうちから決済業務責任者 1 人を選任し、当社が定めるところにより、当社に届け出なければならない。

(役員又は他の者との共同関係又は支配関係)

第 16 条 当社は、清算参加者の役員又は他の者との共同関係又は支配関係が当社の商品取引債務引受業の運営に鑑みて適当でないとき、当該清算参加者を審問のうえ、理由を示して、その変更を請求することができる。ただし、当該清算参加者が陳述書を提出したときは、その提出をもって、審問に代えることができる。

- 2 前項に規定する審問の手続は、当社が定めるところによるものとする。
- 3 当社は、清算参加者が正当な理由がないにもかかわらず第 1 項の審問に応じない場合には、審問を行わずに同項の請求を行うことができる。
- 4 清算参加者は、第 1 項の変更請求に異議があるときは、変更請求の通知を受けた日から 10 日以内に、当社に対し書面をもって、理由を示して、異議の申立てを行うことができる。
- 5 当社は、前項の異議の申立てを受理したときは、遅滞なく、取締役会を開催する。
- 6 前項の取締役会において、第 1 項の変更請求を変更し、又は取り消すことが適当であると認められるときは、直ちに同項の変更請求を変更し、又は取り消すものとする。

(清算参加者による手数料の納入)

第 17 条 清算参加者は、当社が規則で定める手数料を、その定めるところにより、当社に納入しなければならない。

(商品取引債務引受業に関する責任の所在)

第 18 条 当社は、清算参加者がその業務上、当社が行う商品取引債務引受業に関し損害を受けることがあっても、当社に故意又は重過失が認められる場合を除き、これを賠償する責めに任じない。

(届出事項)

第 19 条 清算参加者は、次に掲げる行為をしようとするときは、当社が定めるところにより、あらかじめその内容を当社に届け出なければならない。

- (1) 指定商品市場からの脱退又は取引資格の喪失
 - (2) 商品先物取引業者にあつては、商品先物取引業(法第 2 条第 22 項に規定する商品先物取引業をいう。以下同じ。)の廃止、商品先物取引業者以外の者にあつては、商品先物取引(現物先物取引及び現金決済先物取引をいう。以下同じ。)に関する業務の廃止
 - (3) 当該清算参加者が他の会社と合併して消滅することとなる場合の当該合併及び当該清算参加者が他の会社と合併して会社を設立する場合の当該合併
 - (4) 合併及び破産手続開始の決定以外の事由による解散
 - (5) 分割による事業(商品先物取引業者以外の者にあつては商品先物取引に関する事業をいう。以下この条において同じ。)の全部又は一部の他の会社への承継
 - (6) 事業の全部又は一部の譲渡
 - (7) 当該清算参加者が他の会社と合併して合併後存続することとなる場合の当該合併
 - (8) 分割による事業の全部又は一部の他の会社からの承継
 - (9) 事業の全部又は一部の譲受け
 - (10) 氏名又は商号若しくは名称の変更(英文の氏名又は商号若しくは名称の変更を含む。)
 - (11) 役員の変更
 - (12) 本店若しくは主たる事務所又は当社が行う商品取引債務引受業の相手方となるための業務に関する従たる営業所若しくは従たる事務所の変更
 - (13) 指定商品市場への加入又は取引資格の取得
- 2 他社清算参加者は、前項に規定するほか、商品清算取引に係る業務の廃止をしようとするときは、当社が定めるところにより、あらかじめその内容を当社に届け出なければならない。
- 3 清算参加者は、親会社等から親会社等保証を受けている場合には、第 1 項に規定するほか、当該親会社等が同項第 3 号から第 9 号までに掲げる行為及び清算参加者のために親会社等保証を行う事業の廃止をしようとするときは、当社が定めるところにより、あらかじめその内容を当社に届け出なければならない。この場合において、同項第 3 号及び第 7 号中「清算参加者」とあるのは「清算参加者の親会社等(当該清算参加者のために親会社等保証を行う親会社等に限る。)」と、同項第 5 号中「商品先物取引業者以外の者にあつては

商品先物取引に関する事業」とあるのは「清算参加者のために親会社等保証を行う事業」と、それぞれ読み替えるものとする。

(報告事項)

第 20 条 清算参加者は、当社が定める場合に該当することとなったときは、直ちにその内容を当社に報告しなければならない。

(清算参加者の監査)

第 21 条 当社は、次の各号に掲げる場合その他当社の商品取引債務引受業の運営上必要があると認める場合は、清算参加者に対し、当該清算参加者の事業若しくは財産に関して参考となるべき報告若しくは資料の提出を請求し、又は当社の職員をして当該清算参加者の事業若しくは財産の状況若しくは帳簿、書類その他の物件を監査させることができる。

(1) 清算参加者によるこの業務方法書その他の規則の遵守の状況の調査を行う場合

(2) 清算参加者の財務の状況の調査を行う場合

(3) 清算参加者の当社に対する債務の履行の確実性に関する調査を行う場合

(4) 指定市場開設者からその商品市場における取引等(法第 2 条第 21 項の商品市場における取引等をいう。以下同じ。)の公正の確保を図るための調査に関して情報提供の要請があった場合において、当社が当該要請に応じることが相当と認める場合

2 前項の規定は、当社が清算参加者のために親会社等保証を行う親会社等の財務の状況の監査を行う場合その他当社の商品取引債務引受業の運営上必要があると認める場合に準用する。この場合において「清算参加者」とあるのは、「清算参加者の親会社等(当該清算参加者のために親会社等保証を行う親会社等に限る。)」と読み替えるものとする。

(委託に基づく未決済約定に関し過大なポジションを保有している清算参加者に対する調査)

第 22 条 当社は、清算参加者が委託者、取次者、清算取次委託者及び清算取次者の委託に基づく商品先物取引並びに当社が証券取引等清算業務に関して定める業務方法書第 21 条の 2 第 1 項に規定する顧客の委託に基づく先物・オプション取引(非清算参加者の有価証券等清算取次ぎ(金融商品取引法(昭和 23 年法律第 25 号)第 2 条第 27 項に規定する有価証券等清算取次ぎをいう。以下同じ。))の委託に基づく取引を含む。以下この条において同じ。)(以下「先物・

オプション取引等」という。)において過大なポジションを保有しているとの疑いがあると認められる場合(当該清算参加者の当該先物・オプション取引等に係る未決済約定(決済が未了である約定をいう。以下同じ。)が負っているものと想定されるリスク相当額(当該清算参加者が当該先物・オプション取引等に係る未決済約定を有する取引に係る各銘柄の価格の変動により損失が発生し得る危険に相当する額をいう。第31条及び第32条において同じ。))が、当該清算参加者(清算参加者が親会社等保証を受けている場合には、親会社等保証を行っている親会社等)の純資産額又は現金等の財産の状況に比し過大であるとの疑いがある場合をいう。)には、当該清算参加者に対して、次の各号に掲げる事項の全部又は一部について報告を求めることができる。

- (1) 委託者、取次者、清算取次者及び清算取次委託者のうち当該商品先物取引の未決済約定に係る証拠金所要額が最大となっている者(以下「最大委託者等」という。)の当該商品先物取引に係る未決済約定の内容
 - (2) 最大委託者等の当該商品先物取引の未決済約定に係る証拠金所要額等
 - (3) 最大委託者等の当該商品先物取引の未決済約定に係る証拠金の当該清算参加者への預託又は差入れの状況
 - (4) 当該清算参加者による最大委託者等の当該商品先物取引に係る委託者管理体制等
- 2 清算参加者は、前項の規定により当社から報告を求められた場合、当該報告を求められた日から起算して3日目(休業日を除外する。以下日数計算において同じ。)の日までに、当社が定めるところにより当社に報告しなければならない。
- 3 当社は、前項の報告によってもなお必要があると認められる場合、当該清算参加者に対して、最大委託者等に対する取次委託者及び清算取次者に対する委託者(以下「間接委託者」という。)について、次の各号に掲げる事項の全部又は一部について報告を求めることができる。
- (1) 間接委託者のうち当該商品先物取引の未決済約定に係る証拠金所要額が最大となっている者(以下「最大間接委託者」という。)の未決済約定の内容
 - (2) 最大間接委託者の当該商品先物取引の未決済約定に係る証拠金所要額等
 - (3) 最大間接委託者の当該商品先物取引の未決済約定に係る取引証拠金の最大委託者等又は当該清算参加者への預託又は差入れの状況
 - (4) 最大委託者等による最大間接委託者の当該商品先物取引に係る委託者管理体制等
- 4 清算参加者は、前項の規定により報告を求められたときは、当該報告を求められた日から起算して6日目の日までに、当社が定めるところにより当社に報告しなければならない。

- 5 当社は、清算参加者が第2項又は第4項に規定する報告期限までに報告を行わなかった場合には、委託分及び商品清算取引分の商品先物取引に係る取引証拠金の額について、当該額の130パーセントを上限として、取引証拠金所要額の引上げを行うことができる。

第4節 商品取引清算資格の喪失

(商品取引清算資格の喪失申請)

- 第23条 清算参加者が商品取引清算資格を喪失しようとするときは、喪失しようとする商品取引清算資格の種類ごとに、当社が定めるところにより、商品取引清算資格の喪失の申請を行わなければならない。
- 2 清算参加者が前項の規定によりエネルギー先物等清算資格、堂島農産物先物等清算資格又は堂島砂糖先物等清算資格の喪失を申請した場合、当該商品取引清算資格を有する各清算参加者及び当該商品取引清算資格に係る指定市場開設者に、その旨を通知する。

(商品取引清算資格の喪失申請者の合併等の場合の適用除外)

- 第24条 清算参加者は、商品取引清算資格の喪失と同時に、当該商品取引清算資格と同種の商品取引清算資格を取得する者若しくは当該商品取引清算資格と同種の商品取引清算資格を有する者に合併され、分割により事業を承継させ又は事業を譲渡する等の場合で、当該清算参加者の当該商品取引清算資格に係る清算約定で未決済のものすべてを解消させる必要がないと当社が認めるときは、第26条第1項の規定にかかわらず、当社が認める範囲内において、当該清算約定で未決済のものを解消しないことができる。
- 2 他社清算参加者は、他社清算資格の喪失と同時に、当該他社清算資格と同種の他社清算資格を取得する者若しくは当該他社清算資格と同種の他社清算資格を有する者に合併され、分割により事業を承継させ又は事業を譲渡する等の場合で、当該他社清算参加者が締結している清算受託契約のすべてを解約させる必要がないと当社が認めるときは、第26条第1項の規定にかかわらず、当社が認める範囲内において、当該清算受託契約を解約しないことができる。

(商品取引清算資格の喪失申請者に係る債務の引受けの停止)

- 第25条 当社は、清算参加者から商品取引清算資格の喪失申請を受理した翌日(休業日に当たるときは、順次繰り下げる。以下同じ。)から、その清算参加者を当事者とする当該商品取引清算資格に係る清算対象取引に基づく債務の引受けの停止(第52条に定めるギブアップの成立による債務の負担の停止を

含む。以下同じ。)を行うものとする。ただし、清算参加者が、次条第1項に定める清算約定で未決済のものを解消する目的で行う清算対象取引に基づく債務についての新たな債務の引受けについては、この限りではない。

- 2 当社は、商品取引清算資格の喪失申請者が、その喪失と同時に、当該商品取引清算資格と同種の商品取引清算資格を取得する者若しくは当該商品取引清算資格と同種の商品取引清算資格を有する者に合併され、分割により事業を承継させ又は事業を譲渡する等の場合で、当該清算参加者の清算約定で未決済のものを解消させる必要がないと認めるときは、前項本文の規定にかかわらず、当該商品取引清算資格の喪失申請者を当事者とする清算対象取引に基づく債務の引受けの全部又は一部を停止しないことができる。

(商品取引清算資格の喪失)

第26条 清算参加者が第23条第1項の規定により商品取引清算資格の喪失を申請した場合、当該清算参加者は、次の各号に掲げる事項を履行した時点のいずれか遅い時点において、商品取引清算資格の喪失をする。

- (1) 喪失申請の日の翌日から起算して30日目の日の当社が定める時点(ただし、当該喪失申請が破綻処理単位期間(第77条第1項に定める破綻処理単位期間をいう。以下同じ。)中に行われた場合又は当該喪失申請の日から清算参加者について商品取引清算資格の喪失の効力が生じるまでの間に破綻処理単位期間が開始した場合には、当該破綻処理単位期間が終了する日の当社が定める時点)
- (2) 清算参加者が、喪失申請した商品取引清算資格に係る清算約定で未決済のものをすべて解消した時点
- (3) 清算参加者が他社清算参加者である場合には、喪失申請した他社清算資格に係る清算受託契約をすべて解約した時点

- 2 当社は、前項の規定に基づき清算参加者が商品取引清算資格の喪失をした場合には、その旨を当該商品取引清算資格を有する各清算参加者及び当該商品取引清算資格に係る指定市場開設者に対して通知する。

(商品取引清算資格の喪失の際の債務の弁済)

第27条 商品取引清算資格を喪失した者は、当社から返付を受ける金銭、有価証券、倉荷証券等(倉荷証券及び受渡決済のために授受する倉荷証券以外の書類をいう。以下同じ。)又は商品をもって、その者が清算参加者として当社に対して負担した一切の債務の弁済に充てなければならない。

(商品取引清算資格の喪失の際のこの業務方法書の適用)

第 28 条 清算参加者が商品取引清算資格を喪失した場合において、当該喪失前の原因に基づいて生じた権利義務があるときは、当該権利義務について、この業務方法書(この業務方法書に基づく規則を含む。)の定めが適用されるものとする。

第 5 節 清算参加者に対する措置等

(清算参加者に対する措置)

第 29 条 当社は、清算参加者が次の各号のいずれかに該当することとなったと認める場合には、当該清算参加者を審問のうえ、理由を示して、改善指示(当社の商品取引債務引受業務の運営上必要かつ相当と認められる限度において、当該清算参加者に対して行う業務執行体制等の改善に係る指示をいう。以下同じ。)、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づく債務の引受けの全部若しくは一部の停止又は当該清算参加者の商品取引清算資格の取消しの措置を行うことができる。この場合において、商品取引清算資格の取消しについては、取締役会の決議を要するものとする。

- (1) 第 19 条の規定による届出若しくは第 20 条の規定による報告をせず、又は虚偽の届出若しくは報告をしたとき
 - (2) 第 21 条の規定による監査を拒否し、妨げ若しくは忌避したとき、同条若しくは第 22 条の規定による報告若しくは資料を提出せず又は虚偽の報告若しくは資料を提出したとき
 - (3) 業務執行体制に不備があると認められるとき
 - (4) 前 3 号のほか、清算参加者がこの業務方法書その他の規則若しくはこれらに基づく措置に違反したとき、又は清算参加者が当社若しくは清算参加者の信用を失墜させた場合において当社の商品取引等債務引受業の運営に鑑みて必要であると認めるとき
- 2 当社は、清算参加者が次の各号のいずれかに該当することとなった場合には、当該清算参加者を審問のうえ、理由を示して、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づく債務の引受けの全部又は一部の停止その他当社が必要かつ相当と認める措置を行うことができる。
- (1) 第 16 条の規定による役員又は他の者との共同関係若しくは支配関係の変更請求に応じないとき。
 - (2) 総株主の議決権(株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法(平成 17 年法律第 86 号)第 879 条第 3 項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含む。)又は出資に係る議決権の過半

数が当社の商品取引債務引受業の運営に鑑みて適当でないと認められる者によって保有されるに至ったとき。

- (3) 相談役、顧問その他いかなる名称を有する者であるかを問わず、清算参加者に対し取締役又は執行役と同等以上の支配力を有する者が、当社の商品取引債務引受業の運営に鑑みて適当でないと認められるとき。
- 3 当社は、清算参加者が次の各号のいずれかに該当することとなった場合には、当該清算参加者を審問のうえ、その事由の消滅するまで、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づく債務の引受けの全部又は一部の停止の措置を行うことができる。
 - (1) 資本金の額若しくは出資の総額(相互会社にあつては、基金(基金償却積立金を含む。))の総額)が3億円を下回り、速やかな回復が見込めないとき。
 - (2) 純資産額が10億円(他社清算参加者の場合には200億円)を下回り、速やかな回復が見込めないとき。
 - (3) 商品先物取引業者のうち法第211条第1項の規定により純資産額規制比率を適用される商品先物取引業者については、純資産額規制比率が140パーセントを下回ることとなったとき(他社清算参加者である場合は、純資産額規制比率が200パーセントを下回ることとなったとき)
 - (4) 商品先物取引業者でない者については、保有する資産等に照らし、自己資本の充実の状況が適当でないと当社が認めたとき。
- 4 当社は、清算参加者が第19条第1項第1号に掲げる事項について当社へ届出を行った場合又は同項第2号から第6号までのいずれかに掲げる事項(同項第5号にあつては事業の全部の承継、第6号にあつては事業の全部の譲渡に限る。)に係る公告を行った場合において、商品取引清算資格の喪失申請を行わないときは、当該清算参加者を審問のうえ、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づく債務の全部又は一部の引受けの停止の措置を行うことができる。
- 5 当社は、他社清算参加者が第19条第2項に規定する届出を行った場合において、他社清算資格の喪失申請を行わないときは、当該清算参加者を審問のうえ、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づく債務(商品清算取引に係るものに限る。)の全部又は一部の引受けの停止の措置を行うことができる。
- 6 当社は、清算参加者のために親会社等保証を行う親会社等が第7条第5号bの(b)に定める要件に適合しないこととなったときは、当該清算参加者を審問のうえ、その事由の消滅するまで、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づく債務の引受けの全部又は一部の停止の措置を行うことができる。
- 7 当社は、清算参加者のために親会社等保証を行う親会社等が親会社等保証を

解消しようとする場合、清算参加者のために親会社等保証を行う事業の廃止について清算参加者が当社へ届出を行った場合又は当該親会社等が第 19 条第 1 項第 4 号から第 6 号までのいずれかに掲げる事項に係る公告を行った場合において、当該清算参加者が商品取引清算資格の喪失申請を行わないときは、当該清算参加者を審問のうえ、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づく債務の引受けの全部又は一部の停止の措置を行うことができる。

(過大なポジションを保有している清算参加者に対する措置)

第 30 条 当社は、清算参加者が過大なポジションを保有していると認められる場合(当該清算参加者の未決済約定が負っているものと想定されるリスク相当額が、当該清算参加者(清算参加者が親会社等保証を受けている場合には、親会社等保証を行っている親会社等)の純資産額又は現金等の財産の状況に比し過大であると認められる場合であって、当該リスク相当額が当該清算参加者の自己の計算による取引若しくは少数の委託者、取次者、清算取次者及び清算取次委託者(以下「委託者等」という。)の委託に基づく取引(非清算参加者の商品清算取引及び有価証券等清算取次ぎの委託に基づく取引を含む。)に起因しているときをいう。次条において同じ。)又はその具体的なおそれがあると認められる場合には、次の各号に掲げる措置その他当社が必要と認められる措置を行うことができる。

- (1) 取引証拠金等(清算基金又は取引証拠金(自己の計算による商品先物取引若しくは委託者等の委託若しくは非清算参加者の商品清算取引の委託に基づく商品先物取引に係る取引証拠金をいう。)をいう。以下この項において同じ。)の額の引上げ
 - (2) 取引証拠金等を有価証券又は倉荷証券をもって預託する場合における当社が指定する銘柄等の制限
 - (3) 取引証拠金等を有価証券又は倉荷証券をもって預託する場合の充用価格の計算における時価に乗すべき率の引下げ
- 2 委託者等の委託又は非清算参加者の商品清算取引の委託に基づく商品先物取引に係る取引証拠金に対し前項の措置が行われた場合には、当該措置の対象となった清算参加者は、当該委託者等又は当該非清算参加者に対して当該措置と同様の措置をとらなければならない。

(ポジション保有状況の改善指示)

第 31 条 当社は、第 22 条第 5 項に規定する取引証拠金所要額の引上げを行ったにもかかわらず、なお清算参加者が同条第 1 項又は第 3 項に規定する報告を行わなかった場合、前条に規定する措置を行ったにもかかわらず、当社が

指定した期日においてなお当該清算参加者が過大なポジションを保有していると認められる場合又は当該清算参加者のリスク相当額が増加するなどによって当該清算参加者の当社に対する債務履行の確実性に係る危険を速やかに解消する必要があると認められる場合には、その必要とする限度において、当該清算参加者を審問のうえ、取締役会の決議により、ポジション保有状況の改善指示の措置を行うことができる。

- 2 前項に規定するポジション保有状況の改善指示を受けた清算参加者は、当社がその都度指定する日までに、当該指示を受けた事由を解消することを目的として、資本充実(清算参加者が親会社等保証を受けている場合は、親会社等保証を行っている当該親会社等の資本充実)、当該清算参加者の清算約定で未決済のものの決済又は他の清算参加者への引継ぎその他具体的な措置を講じなければならない。
- 3 前項の規定により当該清算参加者が未決済約定を当該他の清算参加者に引き継ごうとする場合には、当該清算参加者は、あらかじめ、当社の承認及び当該他の清算参加者の承諾を受けなければならない。
- 4 前項の場合において、引継ぎを行おうとする未決済約定が委託者等の委託に基づくものであるときは、当該清算参加者は、当該未決済約定の引継ぎについて当該委託者等の同意を得るものとする。
- 5 第3項の場合において、引継ぎを行おうとする未決済約定が非清算参加者の商品清算取引の委託に基づくものであるときは、当該清算参加者は、当該未決済約定の引継ぎについて当該非清算参加者の同意を得るものとする。
- 6 この業務方法書に定めるもののほか、ポジション保有状況の改善指示に必要な事項は、当社がその都度定める。

(担保の預託状況が不相当と認められる場合等における清算参加者への措置)

第32条 一の清算参加者が清算預託金(第70条に規定する清算預託金及び証券取引等清算業務に関して定める業務方法書第74条に規定する清算預託金をいう。以下この条において同じ。)及び取引証拠金(自己の計算による先物・オプション取引等に係る取引証拠金並びに委託者等の委託に基づくもののうち当該清算参加者と同一の企業集団(金融商品取引法第5条第1項第2号に規定する企業集団をいう。以下同じ。)に属する者及び当該清算参加者と同一の企業集団に属する者と実質的に同視できる者(以下「アフィリエイト」という。)の計算による先物・オプション取引等に係る取引証拠金その他当社が定める取引証拠金に限る。以下この項において同じ。)の当社への預託を株券等(株券、投資信託受益証券、投資証券をいう。以下この条において同じ。)による代用により行っている場合において、銘柄ごとに合計した預託数量が当該銘

柄の上場株式数(投資信託受益証券にあつては上場受益権口数をいい、投資証券にあつては上場投資口数をいう。以下同じ。)の2パーセント相当数量を超えている場合には、当社は、当該清算参加者に対し、次の各号に掲げる措置を行うことができる。

- (1) 清算預託金を有価証券をもって預託する場合及び取引証拠金を有価証券又は倉荷証券をもって預託する場合における当社が指定する銘柄等の制限
 - (2) 清算預託金を有価証券をもって預託する場合及び取引証拠金を有価証券又は倉荷証券をもって預託する場合の充用価格の計算における時価に乗すべき率の引下げ
- 2 一の清算参加者が清算預託金及び取引証拠金(自己の計算による先物・オプション取引等に係る取引証拠金及びアフィリエイトの計算による先物・オプション取引等に係る取引証拠金その他当社が定める取引証拠金に限る。以下この項及び第4項において同じ。)の当社への預託を株券等による代用により行っている場合において、銘柄ごとに合計した預託数量が当該銘柄の上場株式数の5パーセント相当数量を超えている場合には、当社は、当該清算参加者に対し、次の各号に掲げる措置を行うことができる。
- (1) 清算預託金を有価証券をもって預託する場合及び取引証拠金を有価証券又は倉荷証券をもって預託する場合における当社が指定する銘柄等の制限
 - (2) 清算預託金を有価証券をもって預託する場合及び取引証拠金を有価証券又は倉荷証券をもって預託する場合の充用価格の計算における時価に乗すべき率の引下げ
- 3 一の清算参加者が清算預託金及び取引証拠金(自己の計算による先物・オプション取引等に係る取引証拠金及びアフィリエイトの計算による先物・オプション取引等に係る取引証拠金に限る。以下この項において同じ。)に係る担保所要額の合計額に対して地方債、特殊債、社債及び円貨建外債以外の充用有価証券及び倉荷証券の評価額及び金銭の額の合計額が80パーセントを下回る場合には、当社は、当該清算参加者に対し、次の各号に掲げる措置を行うことができる。
- (1) 清算預託金を有価証券をもって預託する場合及び取引証拠金を有価証券又は倉荷証券をもって預託する場合における当社が指定する銘柄等の制限
 - (2) 清算預託金を有価証券をもって預託する場合及び取引証拠金を有価証券又は倉荷証券をもって預託する場合の充用価格の計算における時価に乗すべき率の引下げ
- 4 清算参加者の発行する有価証券(当該清算参加者の親会社(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。以下「財務諸表等規則」という。)第8条第3項の規定により当該清算参加者の親会社と

される者をいう。以下この項において同じ。)、子会社(財務諸表等規則第 8 条第 3 項の規定により当該清算参加者の子会社とされる者をいう。以下この項において同じ。)又はその親会社の子会社の発行する有価証券を含む。)が、清算預託金及び取引証拠金の代用として当社に預託されている場合には、当社は、当該清算参加者に対し、当該清算参加者の発行する有価証券に関して第 2 項各号に掲げる措置を行うことができる。

- 5 前各項に掲げる場合のほか、清算参加者の当社に対する債務の履行確保の観点から当社が必要と認めた場合には、当社は、当該清算参加者に対し、前各項に掲げる措置を行うことができる。

(特定時間帯においてリスクが増大した清算参加者に対する債務の引受けの停止)

第 33 条 当社は、一の清算参加者について、通常の商品取引環境下において当該清算参加者が負っているものと想定されるリスク量として、当社が定める方法で算出されたリスク相当額が、当社が定める時間内において当社があらかじめ定める額を超えた場合には、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づく債務の引受けの全部又は一部の停止の措置を行うことができる。

(業務の廃止等において商品取引清算資格喪失申請を行わないことにより債務の引受けの停止を受けた清算参加者に対する措置)

第 34 条 当社は、第 29 条第 4 項、第 5 項又は第 7 項の規定により当該清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づく債務の引受けの停止を行った場合には、当該清算参加者の清算約定で未決済のもの他の清算参加者への引継ぎその他当社が必要と認める整理を行わせることができる。

- 2 当社は、前項の規定による整理を行うためその他当社が必要と認める限度において、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づく債務の引受けを行うことができる。
- 3 当社は、必要があると認めるときは、第 1 項に定める整理を、他の清算参加者をして行わせることができる。この場合においては、その清算参加者と同項の債務の引受けの停止の対象清算参加者との間に委任契約が成立していたものとする。

(債務の引受けの停止等の措置の解除)

第 35 条 当社が第 29 条の規定により期間を定めずに債務の引受けの停止(商品取引に係る債務に限って行うものを除く。)を行った場合には、対象清算参加者は、その事由を除去したときは、説明書を添付して停止の解除を申

請することができる。

- 2 当社は、前項の申請に基づく停止の解除が適当であると認めるときは、その申請を承認する。
- 3 第1項の対象清算参加者が、同項の停止を受けた日から1年以内に、前項の承認を得なかった場合は、当社は、取締役会の決議により、当該対象清算参加者の商品取引清算資格を取り消すことができる。
- 4 前3項の規定は、当社が第29条の規定により期間を定めずに債務の引受けの停止(商品清算取引に係る債務に限って行うものに限る。)を行った場合について準用する。この場合において、第3項中「商品取引清算資格を取り消す」とあるのは「他社清算資格を取り消し、自社清算資格を付与する」と読み替えるものとする。
- 5 第1項及び第2項の規定は、第30条から第32条までに規定する措置を行った場合について準用する。

(異議の申立て等)

第36条 第16条第1項ただし書、第2項及び第3項の規定は第29条及び第31条の審問について、第16条第4項から第6項までの規定は第29条から第32条までの措置について、それぞれ準用する。

(会員等に該当しないこととなった清算参加者に対する措置)

第37条 清算参加者は、次の各号のいずれかの事由が生じた場合には、商品取引清算資格を喪失する。

- (1) 自社清算参加者が指定市場開設者の会員等でなくなること
- (2) 解散

(措置評価委員会)

第38条 当社は、第29条、第30条又は第31条に規定する措置を清算参加者に対し行おうとするときは、あらかじめ、当該措置を行うことの適否につき、措置評価委員会に諮問し、その意見を尊重するものとする。

- 2 前項の規定にかかわらず、当社は、第30条の措置(自己の計算による取引に係るものに限る。)を行おうとするときその他緊急の必要があるときは、措置評価委員会に諮問しないことができる。
- 3 当社は、緊急停止(第33条に基づく債務の引受けの全部又は一部の停止をいう。以下同じ。)を行った場合は、直ちにその旨を措置評価委員会に報告する。
- 4 前3項に定めるもののほか、措置評価委員会に関する事項は規則で定める。

(措置の通知等)

- 第 39 条 当社は、この業務方法書に基づき債務の引受けの全部若しくは一部の停止(緊急停止を除く。)又は商品取引清算資格の取消しを行おうとするときは、あらかじめその旨を当該対象清算参加者が有する商品取引清算資格に係る指定市場開設者に対して通知する。
- 2 当社は、緊急停止を行ったときは、前項の指定市場開設者に対し、直ちにその旨を通知する。
 - 3 第 1 項の規定は、第 37 条の規定により清算参加者が商品取引清算資格を喪失したときについて準用する。この場合において、同項中「あらかじめ」とあるのは「直ちに」と読み替えるものとする。
 - 4 当社が、この業務方法書に基づき他社清算参加者の商品清算取引に係る債務の引受けの全部若しくは一部の停止を行ったとき若しくは他社清算参加者の商品取引清算資格を取り消したとき又は第 37 条の規定により他社清算参加者が商品取引清算資格を喪失したときは、当該他社清算参加者は、清算受託契約を締結している非清算参加者に対し、直ちにその旨を通知しなければならない。ただし、緊急停止を行った場合において当社が特に認めた場合は、この限りでない。
 - 5 当社は、第 30 条に規定する措置(取引証拠金に係るものに限る。)又は第 31 条に規定する措置を清算参加者に対して行ったときは、当該措置の事由と密接な関係を有している取引に係る指定市場開設者に対し、速やかにその旨を通知する。
 - 6 当社は、この業務方法書に基づき改善指示、債務の引受けの全部若しくは一部の停止、商品取引清算資格の取消し又はポジション保有状況の改善指示の措置を清算参加者に対して行ったときは、当該措置を行った日から 6 か月以内に、各清算参加者に対してその旨を通知し、又は公表するものとする。ただし、当社は、当該通知又は公表を行った場合における市場への影響度を勘案して必要かつ適当と認めるときは、当該措置を行った日から 6 か月を超える日に通知又は公表を行うことができる。
 - 7 当社は、前項に規定する通知又は公表を行うときは、当該通知若しくは公表の対象となる措置の重要性又は当該通知若しくは公表を行った場合における市場への影響度を勘案して、通知又は公表を行う範囲をその都度定めるものとする。
 - 8 当社は、第 37 条の規定により清算参加者が商品取引清算資格を喪失したときは、当該商品取引清算資格を有する各清算参加者に対し、その旨を通知する。

(債務の引受けの停止を受けた清算参加者等の取扱い)

第40条 当社がこの章の規定に基づき債務の引受けの全部又は一部の停止を行った場合には、対象清算参加者は、当社の承認を受けて、その期間中、当該対象清算参加者の清算約定で未決済のものを、他の清算参加者に引き継ぐことができる。

- 2 前項のほか、当社は、清算参加者に対し、第31条の規定に基づくポジション保有状況の改善指示に違反したことにより第29条第1項の規定に基づき債務の引受けの全部又は一部の停止を行った場合には、当該清算参加者の清算約定で未決済のもの他の清算参加者への引継ぎその他当社が必要と認める整理を行わせることができる。
- 3 当社は、必要があると認めるときは、前項に定める整理を、他の清算参加者をして行わせることができる。この場合においては、当該他の清算参加者と同項の債務の引受けの停止の対象清算参加者との間に委任契約が成立していたものとする。

(商品取引清算資格を取り消された者等の未決済約定の取扱い)

第41条 当社は、この業務方法書に基づき商品取引清算資格の取消しを清算参加者に対して行ったとき又は第37条の規定により清算参加者が商品取引清算資格を喪失したときは、その者の清算約定で未決済のもの他の清算参加者への引継ぎその他当社が必要と認める整理を行わせることができる。

- 2 当社は、必要があると認めるときは、前項に定める整理を、他の清算参加者をして行わせることができる。この場合においては、当該他の清算参加者と清算参加者であった者との間に委任契約が成立していたものとする。
- 3 第1項の清算参加者であった者は、その者の清算約定で未決済のもの決済又は整理を行うためその他当社が必要と認める範囲内において、なお清算参加者とみなす。

(清算参加者に対する勧告)

第42条 当社は、清算参加者の業務若しくは財産の状況又は清算参加者のために親会社等保証を行う親会社等の財務の状況が、当社の商品取引債務引受業の運営に鑑みて、適当でないと認めるときは、当該清算参加者に対し、適切な措置を講ずることを勧告することができる。

- 2 当社は、前項の勧告を行った場合において必要があると認めるときは、当該清算参加者に対し、その対応について報告を求めることができる。

第3章 商品清算取引

(非清算参加者との清算受託契約の締結)

第 43 条 他社清算参加者は、商品清算取引を行う場合において、非清算参加者が清算参加者を代理して清算対象取引を成立させようとするときは、当該非清算参加者が商品清算取引の申込みをし、かつ、当該清算参加者が当該商品清算取引の受託をしたこととする旨その他当社が定める事項を記載した清算受託契約を、商品清算取引の委託をする非清算参加者との間で、締結しなければならない。

(清算受託契約の締結の届出)

第 44 条 他社清算参加者は、清算受託契約を締結しようとするときは、あらかじめ、当社が定めるところにより、その内容を当社に届け出なければならない。

(清算受託契約の解約の届出)

第 45 条 他社清算参加者は、清算受託契約の解約については、次の各号に掲げる解約の区分に従い、当該各号に定めるところにより、その内容を当社に届け出なければならない。

(1) 合意による解約

当該解約を行おうとする日の 3 日前(休業日を除外する。以下日数計算において同じ。)の日までに届出を行う。

(2) 他社清算参加者が事前に非清算参加者に対し書面により契約の解約の意思を申し出たことによる解約(第 5 号に掲げる解約を除く。)

当該解約の意思を申し出た後遅滞なく届出を行う。

(3) 他社清算参加者が事前に非清算参加者から書面により契約の解約の意思の申し出を受けたことによる解約

当該解約の意思の申し出を受けた後遅滞なく届出を行う。

(4) 非清算参加者が商品清算取引の委託に基づく取引に係る債務についての期限の利益の喪失事由に該当したことによる解約

当該解約を行おうとする日の前日までに届出を行う。

(5) 非清算参加者との間で商品清算取引の委託に基づく取引に係る債務の履行の現実性の観点から清算受託契約を解約することができる条件をあらかじめ定めている場合において、当該条件に該当したことをもって他社清算参加者が事前に非清算参加者に対し書面により契約の解約の意思を申し出ることによる解約

当該解約の意思を申し出た後直ちに、かつ、当該解約を行おうとする日の

前日までに届出を行う。

- 2 当社は、前項の届出を受けた場合には、解約する契約の相手方である非清算参加者が会員等である指定市場開設者に対し、直ちにその旨を通知する。

(清算対象取引に係る区分管理)

第 46 条 他社清算参加者は、その清算対象取引について、商品清算取引によるものとそれ以外のものとを、区分して管理しなければならない。

(指定清算参加者の変更等の場合の未決済約定の引継ぎ)

第 47 条 非清算参加者が指定市場開設者の定めるところにより指定清算参加者を変更した場合には、変更前の指定清算参加者から変更した時点における当該非清算参加者の商品清算取引に基づく清算約定で未決済のものを変更後の指定清算参加者へ引き継ぐものとする。

- 2 清算参加者が商品取引清算資格を喪失し、指定市場開設者の定めるところにより他の清算参加者を指定清算参加者として指定する場合には、指定した時点における商品取引清算資格を喪失する当該清算参加者の清算約定で未決済のものを、商品取引清算資格を喪失する当該清算参加者から新たに指定清算参加者として指定された清算参加者へ引き継ぐものとする。

(非清算参加者が商品清算取引の委託を停止された場合の未決済約定の引継ぎ等)

第 48 条 当社は、非清算参加者がその会員等である指定市場開設者から商品市場における取引若しくは商品清算取引の委託を停止された場合、又は除名された場合は、当該指定市場開設者の行う処分の内容に応じて、当該非清算参加者の商品清算取引に基づく清算約定で未決済のものの他の清算参加者への引継ぎその他必要な整理を行わせるものとする。

- 2 前項の規定は、当社が当該非清算参加者の指定清算参加者に対し債務の引受けの全部若しくは一部の停止又は商品取引清算資格の取消しを行った場合には、適用しない。

(清算参加者が商品市場における取引を停止された場合等の未決済約定の引継ぎ等)

第 49 条 当社は、清算参加者がその会員等である指定市場開設者からその商品市場における取引等(商品清算取引を除く。)を停止若しくは制限された場合、又は除名された場合は、当該指定市場開設者の行う処分の内容に応じて、当該清算参加者の清算約定で未決済のものの他の清算参加者への引継ぎその他

必要な整理を行わせるものとする。

- 2 前項の規定は、当社が当該清算参加者に対し債務の引受けの全部若しくは一部の停止又は商品取引清算資格の取消しを行った場合には、適用しない。

(指定清算参加者が改善指示を受けた場合の未決済約定の引継ぎ等)

第 50 条 非清算参加者の指定清算参加者である清算参加者は、当該非清算参加者が正当な理由なく第 30 条第 2 項に定める措置に従わないことによって、第 31 条の規定によりポジション保有状況の改善指示を受けた場合には、当該非清算参加者に対して、当該非清算参加者の商品清算取引の委託に基づく未決済約定の決済又は他の清算参加者への引継ぎを要請することができる。

- 2 清算参加者は、前項のポジション保有状況の改善指示を受けた場合において、当該指示に適合するべく合理的な努力を行ってもなお当該指示に適合できない場合で、かつ、当該非清算参加者に対して、あらかじめ合理的な猶予期間を定めて前項の要請を行ったにもかかわらず、当該非清算参加者がこれらを正当な理由なく行わなかった場合には、合理的に必要と認められる範囲内において、当該非清算参加者の商品清算取引の委託に基づく未決済約定を決済するために、当該非清算参加者の計算において、転売(買建玉(商品先物取引に係る未決済約定に係る数量(以下「建玉」という。)のうち買付けの約定に係る数量をいう。以下同じ。))についての反対の取引をいう。以下同じ。)又は買戻し(売建玉(建玉のうち売付けの約定に係る数量をいう。以下同じ。))についての反対の取引をいう。以下同じ。)(これらの委託を含む。)を行うことができる。

第 4 章 債務の引受け

(債務の引受け)

第 51 条 清算対象取引が指定市場開設者の定めるところにより成立したときは、当該清算対象取引について、当社は売方清算参加者がその相手方である買方清算参加者に対し負担する債務を免責的に引き受け、当該売方清算参加者は当社により引き受けられた当該債務と同一内容の債務を新たに当社に対し負担し、かつ、当社は、買方清算参加者がその相手方である売方清算参加者に対し負担する債務を免責的に引き受け、当該買方清算参加者は当社により引き受けられた当該債務と同一内容の債務を新たに当社に対し負担するものとする。

- 2 当社は、前項の規定により引き受けた債務の内容及びその決済に必要な事項を、当該清算参加者に対し通知するものとする。

- 3 清算参加者は、前項の通知を受けたときは、速やかにその内容を確認するものとする。

(ギブアップに伴い消滅する債権債務及び発生する債権債務の取得及び負担)

第 52 条 ギブアップ(指定市場開設者が定めるギブアップをいう。以下同じ。)が行われたことにより、清算対象取引が消滅及び発生したときは、当社は当該消滅した清算対象取引をなした清算参加者がその相手方として清算対象取引をなした清算参加者に対して負担する債務を免責的に引き受け、当該発生した清算対象取引をなした清算参加者は当社により引き受けられた当該債務と同一内容の債務を新たに当社に対し負担するものとする。

- 2 前条第 2 項及び第 3 項の規定は、前項の場合について準用する。

第 5 章 商品先物取引の区分管理等

(清算参加者の取引の管理)

第 53 条 清算参加者は、清算対象取引となる商品先物取引(非清算参加者の商品清算取引の委託に基づく取引を除く。)について、次の各号に掲げる単位の区分に従い、当該各号に定めるいずれかの区分口座により管理しなければならない。

- (1) 自己の計算によるもの
自己口座
- (2) 顧客(委託者をいう。以下この条及び次条において同じ。)の委託に基づくもの(次号に掲げるものを除く。)
 - a オムニバス口座(複数の顧客又は顧客を任意に細分化した場合における当該細分化した単位の商品先物取引を管理するための口座をいう。以下同じ。)
 - b 個別顧客口座(一の顧客又は顧客を任意に細分化した場合における当該細分化した単位の商品先物取引を管理するための口座をいう。以下同じ。)
- (3) アフィリエイトの計算によるもの
 - a アフィリエイトのオムニバス口座
 - b アフィリエイトの個別顧客口座

(他社清算参加者の商品先物取引の管理)

第 54 条 他社清算参加者は、その清算対象取引となる商品先物取引(非清算参加者の商品清算取引の委託に基づく取引に限る。)について、次の各号に掲げる単位の区分に従い、当該各号に定めるいずれかの区分口座により管理しな

ければならない。

- (1) 当該非清算参加者の自己の計算によるもの
当該非清算参加者の自己口座
- (2) 当該非清算参加者の顧客の委託に基づくもの
 - a 当該非清算参加者のオムニバス口座
 - b 当該非清算参加者の個別顧客口座

第6章 清算約定の決済

(クローズアウト数量等申告)

第55条 清算参加者は、商品先物取引の各限月取引(指定市場開設者が定める限月取引をいう。以下この章において同じ。)について、クローズアウト数量(一の銘柄において売建玉と買建玉を同時に有し、かつ、その全部又は一部を決済(転売又は買戻しによる場合を除く。)する場合における当該決済数量をいう。以下同じ。)並びに転売又は買戻しをした場合(次項に定める場合を除く。)における転売及び買戻しの数量を第53条に規定する区分口座ごとに当社が定める時限までに当社に申告するものとする。

- 2 清算参加者は、商品先物取引の各限月取引について、クローズアウト数量(商品清算取引の委託に基づくものに限る。)並びに商品清算取引の委託に基づく買建玉(以下「清算取次買建玉」という。)に係る転売又は商品清算取引の委託に基づく売建玉(以下「清算取次売建玉」という。)に係る買戻しをした場合における当該清算取次買建玉又は当該清算取次売建玉に係る非清算参加者の転売及び買戻しの数量を、前条に規定する区分口座ごとに当社が定める時限までに当社に申告するものとする。この場合において、清算参加者は、自らの申告に代えて、当該清算取次買建玉又は当該清算取次売建玉に係る非清算参加者をして当該申告を行わせることができる。
- 3 当社は、第1項の規定に基づき申告を受けた場合には、当該申告に係るクローズアウト数量並びに転売及び買戻しの数量を、決済に係るものとして、当該清算参加者が管理する第53条に規定する区分口座ごとに買建玉及び売建玉から減じるものとする。
- 4 当社は、第2項の規定に基づき申告を受けた場合には、当該申告に係るクローズアウト数量並びに転売及び買戻しの数量を、決済に係るものとして、当該清算参加者が管理する前条に規定する区分口座ごとに清算取次買建玉及び清算取次売建玉から減じるものとする。
- 5 当社は、第1項又は第2項の申告を受けた場合には、当該申告に係るクローズアウト数量並びに転売及び買戻しの数量を、指定市場開設者に通知する。

(計算区域)

- 第 56 条 当社は、第 58 条に定める約定差金及び帳入差金の授受を行うための一の計算区域を、取引日とする。
- 2 前項の一の計算区域は、指定市場開設者ごとに次の各号に定めるものとする。
- (1) 第 3 条第 1 号及び第 2 号に定める市場開設者にあつては、当該市場開設者の一営業日の前日の日中立会終了後に開始される夜間立会に係る売買注文の受付開始時から当該一営業日に開始される夜間立会に係る売買注文の受付開始前まで
- (2) 第 3 条第 3 号及び第 4 号に定める市場開設者にあつては、当該市場開設者の一営業日の前場立会開始から後場立会終了まで
- 3 当社は、必要があると認めるときは、前項の規定にかかわらず、計算区域を臨時に変更することができるものとする。この場合において、当社は、あらかじめその旨を清算参加者及び指定市場開設者に通知する。

(帳入値段)

- 第 57 条 当社は、一の計算区域ごとに、別に定めるところにより、帳入値段を定めるものとする。

(約定差金及び帳入差金)

- 第 58 条 商品先物取引において、一の計算区域の帳入値段とその計算区域における約定値段との差額に相当する金銭を約定差金という。
- 2 商品先物取引において、一の計算区域の帳入値段とその直前の計算区域の帳入値段との差額に相当する金銭を帳入差金という。

(約定差金及び帳入差金の授受)

- 第 59 条 清算参加者は、約定差金又は帳入差金が発生したときは、当該約定差金又は帳入差金を、その発生の日の翌日において、当社との間で授受するものとする。この場合において、金銭を支払う清算参加者は、当該金銭の授受を行う日の午前 11 時まで、金銭を受領する清算参加者は、当該金銭の授受を行う日の午後 1 時に、金銭を支払い又は受領しなければならない。

第 7 章 最終決済

第 1 節 受渡しによる決済

(受渡し等による決済)

第 60 条 現物先物取引における受渡しに係る決済については、当社と清算参加者との間において行うものとする。

2 前項の規定にかかわらず、指定市場開設者が現物先物取引における受渡しに係る決済について ADP(指定市場開設者が定める ADP をいう。以下同じ。)により行うことについて承認した場合には、当該 ADP による受渡しに係る決済は、当該承認をもって結了したものとみなす。

3 現物先物取引における受渡しに係る決済を清算参加者が履行しない場合(ADP による決済を除く。)には、当社は、次の各号に掲げる場合の区分に従い、当該各号に定める金額を当該清算参加者から徴収し、これを当該受渡しにおいて受渡品を授受する他の清算参加者に交付することをもって、指定市場開設者が定める受渡値段により当該受渡しにかかる決済を結了させるものとする。ただし、清算参加者は、やむを得ない場合を除き、これにより決済の結了を行ってはならないものとする。

(1) 受渡品の引渡しが行われない場合

受渡品を受領する清算参加者が、当該受領のために要した費用、受渡品の調達に要する費用、逸失利益、遅延損害等に相当する額等を勘案して当社が定める額

(2) 受渡品の受領が行われない場合

受渡品を引き渡す清算参加者が、当該引渡しのために要した費用、受渡品の販売に要する費用、逸失利益、遅延損害等に相当する額等を勘案して当社が定める額

4 前 3 項のほか、現物先物取引における受渡しに係る決済について必要な事項は、当社が別に定める。

第 2 節 現金決済先物取引における最終決済

(最終決済方法)

第 61 条 現金決済先物取引における最終決済(指定市場開設者が定める最終決済をいう。)において、最終決済価格(指定市場開設者が定める最終決済価格をいう。)と取引最終日(指定市場開設者が現金決済先物取引に関し定める取引最終日をいう。)の帳入値段とを比較して差を生じたときは、清算参加者はその差に相当する金銭を最終決済日(指定市場開設者が定める現金決済先物取引における最終決済日をいう。)の翌日において、当社との間で授受するものとする。この場合において、金銭を支払う清算参加者は、当該金銭の授受を行う日の午前 11 時までに、金銭を受領する清算参加者は、当該金銭の授受

を行う日の午後1時に、金銭を支払い又は受領しなければならない。

- 2 前項の規定にかかわらず、指定市場開設者が適当と認める場合には、現金決済先物取引に係る決済を受渡品の授受により行うことができる。この場合において、必要な事項については、当社が別に定める。

第3節 雑則

(先物取引について授受する金銭の額及び授受の方法)

第62条 第59条及び前条の規定による金銭の授受は、次の各号に掲げる単位の区分に従い、当該各号に定める金額により行うものとする。

- (1) 第53条第1号及び第3号に規定する単位

同一清算参加者の第53条第1号並びに第3号a及びbに規定する区分口座の支払金額と受入金額の差引額を合計した金額

- (2) 第53条第2号並びに第54条第1号及び第2号に規定する単位

同一清算参加者の第53条第2号、第54条第1号並びに第2号a及びbに規定する区分口座の支払金額と受入金額の差引額を合計した金額

- 2 前項の金銭の授受は、当社との間において行う。この場合における金銭の支払いについては、当社が定めるところによるものとする。
- 3 清算参加者は、当社が定める場合において、当社が定めるところにより、前2項に定める金銭の授受に代えて、当該清算参加者が管理する第53条及び第54条に規定する区分口座ごとに、当該区分口座の支払金額と受入金額の差引額の金銭の授受を行うことができる。

(ギブアップに対する適用)

第63条 ギブアップの成立により新たに発生した商品先物取引については、清算執行取引参加者(指定市場開設者が定める清算執行取引参加者をいう。)である清算参加者(当該清算執行取引参加者が非清算参加者である場合には、その指定清算参加者)が当該商品先物取引を行ったものとみなして前章から次章までの規定を適用する。

(最終決済価格の算出が不能等の場合の責任の所在)

第64条 清算参加者は、帳入値段若しくは指定市場開設者が定める発表価格の算出若しくは配信の不能、遅延若しくは誤り又は最終決済価格の変更により損害を被った場合においても、当社、指定市場開設者及び当該発表価格の算出者に対してその損害の賠償請求をすることができない。

第8章 取引証拠金及び未決済約定の引継ぎ等

(取引証拠金及び未決済約定の引継ぎ等)

第65条 当社が行う商品取引債務引受業における取引証拠金並びに商品市場における取引に係る受渡しの決済のために預託される金銭及び有価証券その他の物並びに支払不能による債務引受停止の場合における未決済約定の取扱い等に関する事項は、商品取引債務引受業に係る取引証拠金等に関する規則をもって定める。

第9章 建玉の移管

(建玉の移管)

第66条 この業務方法書に別に定める場合のほか、清算参加者は、当社の承認を受けて、他の清算参加者に未決済約定を引き継ぐことができる。

2 清算参加者は、前項の規定に基づく未決済約定の引継ぎ(以下この章において「建玉の移管」という。)を行おうとするときは、他の清算参加者から当該建玉の移管について承諾を受けるとともに、当社が定める時限までに、当社が定めるところにより、当社に申請を行わなければならない。

3 前項の場合において、建玉の移管は、当社が承認したときに成立するものとする。

4 建玉の移管は、当該建玉の移管が行われる日の前日に終了する取引日における各限月取引の帳入値段を約定値段として行われるものとする。

5 指定市場開設者の定めるところにより、他社清算参加者が非清算参加者から建玉の移管に係る申告を受けた場合には、当該他社清算参加者は、当社が定める時限までに、当社が定めるところにより、当社にその内容を申請し、当社の承認を得るものとする。

(建玉の移管の停止)

第67条 当社は、建玉の移管を行うためのシステムの稼働に支障が生じた場合等において建玉の移管を継続して行わせることが困難であると認める場合には、建玉の移管を停止することができる。

第10章 清算預託金

(清算基金の預託)

第68条 清算参加者は、当社に対する債務の履行を確保する目的及び当社が他

の清算参加者の破綻等を認定した場合においてこの業務方法書の定めるところにより当社に生じた損失の補填に充てる目的の清算基金を、次の各号に掲げる区分ごとに、当社が定めるところにより、当社に預託しなければならない。

- (1) エネルギー先物等清算資格に係る清算基金
 - (2) 堂島農産物先物等清算資格に係る清算基金
 - (3) 堂島砂糖先物等清算資格に係る清算基金
- 2 清算参加者は、当社に預託している前項に規定する清算基金が当社が規則により定める清算基金所要額に満たない場合は、その不足額以上の額を、不足額が生じた日の翌日の午後 2 時までには当社に追加預託しなければならない。
 - 3 清算参加者は、第 1 項に規定する清算基金に関して当社が定める額(以下「清算基金現金所要額」という。)について、円貨によって預託しなければならない。
 - 4 清算参加者は、清算基金現金所要額を超える額について、当社が指定する通貨に限り預託することができる。この場合において、預託する通貨が円貨以外の場合には、清算基金の預託を行う日の前々日における東京外国為替市場の対顧客直物電信買相場の当該通貨 1 単位当たりの円貨額により円貨に換算した額に当社が定める率を乗じて評価する。
 - 5 前項の規定にかかわらず、清算参加者は、当社が定めるところにより、清算基金現金所要額を超える額について、有価証券(流動性等を勘案して当社が適当と認めるものに限る。)をもって預託することができる。
 - 6 前項に定める有価証券の充用価格は、当該有価証券の預託日の前々日における当社が定める時価に当社が定める率を乗じた額とする。ただし、当社は、相場に著しい変動を生じた場合等特に必要があると認めた場合には、充用価格を臨時に変更することができる。
 - 7 前 2 項の規定のほか、清算基金の充用有価証券に関する事項については、当社が定める。

(破綻処理単位期間における清算基金の特則)

- 第 69 条 破綻処理単位期間(最終日を除く。)における各清算参加者の商品取引清算資格の種類ごとの清算基金所要額は、前条第 1 項の規定にかかわらず、当該破綻処理単位期間の開始日の前日における当該各清算参加者の各商品取引清算資格に係る清算基金所要額とする。
- 2 破綻処理単位期間において第 82 条第 1 項第 2 号の規定により各清算基金の全部又は一部が取り崩された場合、前条第 2 項の規定にかかわらず、当該破綻処理単位期間が終了するまでの間、清算参加者は、当該取崩しに対応する

額の各清算基金の追加預託義務を負わない。

(清算預託金)

第70条 当社が、債務の履行を確保するためのものとして清算参加者から預託を受ける前2条に規定する清算基金は、法第180条に規定する清算預託金とする。

(清算預託金の管理)

第71条 当社は、前条の清算預託金については、自己の固有の財産と口座を区分する等の方法により分別して保管するものとし、清算参加者ごとに区分して帳簿により管理するものとする。

(商品取引清算資格の喪失の際の清算基金の返戻)

第72条 当社は、清算参加者が全部又は一部の商品取引清算資格を喪失(取消しによる喪失を含む。以下この条及び次条において同じ。)したときは、その喪失の日以降当該喪失した商品取引清算資格に係る清算基金の返戻を行うものとする。ただし、当該清算資格を喪失した者の清算約定で未決済のものがある場合その他当社が必要と認める場合は、その事由の消滅するまでの間、当該喪失した商品取引清算資格に係る清算基金の返戻を停止することができる。

2 前項の規定にかかわらず、清算参加者の商品取引清算資格の喪失の申請が第77条第1項に定める破綻処理単位期間中に行われた場合又は当該申請の日から当該清算参加者について商品取引清算資格の喪失の効力が生じるまでの間に破綻処理単位期間が開始した場合で、当該破綻処理単位期間において第82条第1項に定める不履行参加者以外の清算参加者の清算基金による損失の補填が行われた場合には、当該清算資格の喪失の日以降、商品取引清算資格の種類ごとの清算基金から当該損失の補填のための額を除いた額の返戻を行うものとする。

第11章 清算参加者の支払不能時の措置

第1節 通則

(決済不履行時の清算基金の決済使用)

第73条 当社は、清算参加者が清算約定の決済を履行しない場合であって、他の者からの借入れその他の手段によってもなお清算約定の決済を完了させる

ことが困難であると当社が認めるときは、当該不履行が発生した日(以下「決済使用開始日」という。)における当該清算参加者以外の清算参加者(以下「決済使用開始日清算参加者」という。)が当社に預託している清算基金(円貨をもって預託したものに限る。次条において同じ。)を、清算約定の決済の完了のために使用(以下「決済使用」という。)することができる。

- 2 決済使用は、決済使用開始日の前日における決済使用開始日清算参加者に係る清算基金現金所要額以下の額で、当社が必要と認める限度において行う。
- 3 当社は、決済使用を行ったときは、決済使用開始日清算参加者に対し、遅滞なくその旨を通知する。

(決済使用の際の清算基金の返戻)

第74条 当社は、決済使用を行うときは、次条の規定により決済使用を終了するまでの間、決済使用開始日清算参加者に対する清算基金の返戻を停止することができる。

(決済使用の終了)

第75条 決済使用は、決済使用に係る清算約定の決済が完了したと当社が認めるときに終了するものとする。

- 2 当社は、前項の規定により決済使用を終了した場合には、決済使用開始日清算参加者に対し、遅滞なくその旨を通知する。
- 3 当社は、第1項の規定により決済使用を終了した場合には、当社が定めるところにより、決済使用開始日清算参加者に対し、当社が定める金額の金銭を支払う。

(決済不履行の場合における措置)

第76条 当社は、清算参加者が清算約定の決済を履行しないとき又はそのおそれがあると認めるときは、当社が必要と認める範囲において当社が必要と認める期間、当該清算参加者(以下「不履行清算参加者」という。)を当事者とする清算対象取引に基づく債務の引受けの停止並びに当社から受けるべき有価証券、倉荷証券等、商品及び金銭の全部又は一部の引取りの停止の措置を行う。

- 2 当社は、不履行清算参加者が清算約定の決済を履行しない場合において、当社が指定する他の清算参加者をして、当該不履行の処理に必要な有価証券、倉荷証券等又は商品の売付け又は買付け等を行わせることができる。
- 3 当社は、第1項の規定により引取りを停止した有価証券、倉荷証券等、商品及び金銭については、不履行清算参加者の清算約定の決済の不履行の弁済に

充当することができる。

- 4 第1項の規定により債務の引受けの停止の措置を受けた不履行清算参加者は、当社の承認を受けて、その期間中、当該措置の対象とされた債務の起因となる清算対象取引に係る清算約定で未決済のものを、他の清算参加者に引き継ぐことができる。ただし、次項の規定により、不履行清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づくすべての債務の引受けの停止の措置が行われた場合は、この限りでない。
- 5 当社は、第1項の措置を行った場合において、不履行清算参加者が支払不能となり又はそのおそれがあると認めるときその他特に必要があると認めるとき(以下「支払不能等の認定」という。)は、同項の規定にかかわらず、その事由の消滅するまで、不履行清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づくすべての債務の引受けの停止並びに当社から受けるべき有価証券、倉荷証券等、商品及び金銭の引取りの停止の措置を行うことができる。
- 6 第3項の規定は、前項の規定により引取りを停止した有価証券、倉荷証券等、商品及び金銭について準用する。
- 7 当社は、第5項の規定により不履行清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づくすべての債務の引受けの停止を行った場合には、当該不履行清算参加者の未決済約定(以下「不履行約定」という。)の銘柄構成、規模及び市況等を勘案し、当該不履行清算参加者をして、不履行約定の他の清算参加者への引継ぎ、転売若しくは買戻し又は当該不履行清算参加者の計算による損失回避取引(この項に規定する整理までに当社に生じ得る損失の全部又は一部を回避するために行う清算対象取引をいう。)その他当社が必要と認める整理を行わせることができる。
- 8 前項に定める方法によってもなお不履行約定が残る場合又はそのおそれがある場合は、当社は、次条第1項に規定する損失の発生又は拡大を防止するために必要と認めるときに限り、破綻処理オークション(不履行約定の処理を目的とする取引を行わせるためのオークション手続をいう。以下同じ。)を行うことができる。
- 9 第7項の規定にかかわらず、第5項の規定により不履行清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づくすべての債務の引受けの停止を行った場合において、当該不履行清算参加者の違約受渡玉(この業務方法書に定めるところにより現物先物取引に係る受渡しにより決済することが決定している不履行約定をいう。以下同じ。)があるときは、当社は、当社が定めるところにより当該違約受渡玉に係る決済の結了のための処理及び破綻処理オークションを行うものとする。
- 10 当社は、第7項に定める整理を行うために必要とする限度において、第5

項の規定によりすべての債務の引受けの停止の措置を受けた不履行清算参加者から、当該不履行清算参加者の清算対象取引に基づく債務の引受けを行うことができる。

- 11 当社は、必要があると認めるときは、第 7 項に定める整理を、他の清算参加者をして行わせることができる。
- 12 第 2 項及び前項の場合においては、その清算参加者と債務の引受けの停止の対象となった清算参加者との間に委任契約が成立していたものとする。

(破綻処理単位期間の設定)

第 77 条 当社は、次項に規定する破綻処理単位期間を設定する。

- 2 破綻処理単位期間は、清算参加者について支払不能等の認定が行われた日(当該認定の時点で既に破綻処理単位期間が開始している場合を除く。)から起算して 30 日を経過するまでの期間とする。ただし、当該期間中に他の清算参加者について支払不能等の認定が行われた場合には、当該期間は、当該他の清算参加者の破綻処理が終了すると当社が認めるまでの期間に延長されるものとし、延長後の期間中に他の清算参加者について支払不能等の認定が行われた場合も同様とする。

(期限前終了回避に係る協議)

第 78 条 不履行清算参加者に係る不履行約定について破綻処理オークションが実施された場合において、当該破綻処理オークションを成立させたときに不履行清算参加者の支払不能等の認定により生じる損失を、第 83 条第 1 項及び第 3 項の規定に定めるところにより補填できないおそれがあるときは、当社、当該不履行清算参加者が会員等である指定市場開設者及び清算参加者は、当該損失の処理等について、当社が定めるところにより対応を協議する。

- 2 前項の規定による協議の結果、当社、当該不履行清算参加者が会員等である指定市場開設者及び清算参加者の間において次の各号に定める要件のすべてを満たした場合には、損失の処理等について合意が成立したものとし、当社は、当該合意の定めるところにより当該損失の処理等を行う。この場合において、当該損失の処理等の内容は、当該損失の全部が補填され、かつ、当社による各商品取引清算資格に係る清算業務の継続が可能なものであることを要する。

- (1) 協議に付された損失の処理等に賛成する、破綻処理単位期間における不履行清算参加者以外の清算参加者(以下「破綻処理単位期間清算参加者」という。)の破綻処理単位期間における清算基金所要額を合計した額を、破綻処理単位期間における破綻処理単位期間清算参加者の清算基金所要額の総

額で除して得た比率が、3分の2以上であること

- (2) 協議に付された損失の処理等を実施した場合に追加的に負担を行うこととなる清算参加者、当社及び当該不履行清算参加者が会員等である指定市場開設者が同意していること
- 3 前2項に定めるもののほか、この条に定める協議に必要な事項は、当社がその都度定める。

(期限前終了)

第79条 前条第1項の規定により協議が行われた場合において、損失の処理等について同条第2項の合意が成立しないときは、当社が定めるところにより、不履行約定に係る建玉及び破綻処理単位期間清算参加者の清算約定に係る建玉のうち当社が指定して割り当てる建玉は、当社又は清算参加者から特段の意思表示を要することなく、当社がその都度定める時点において当然に期限前終了する。

- 2 前項の期限前終了とは、この業務方法書に定めるところにより行われる清算参加者の申告以外の事由により清算約定がその納会日(指定市場開設者が定める納会日をいう。)又は取引最終日前に終了することをいう。
- 3 清算約定が期限前終了したときは、期限前終了した建玉について、当該不履行清算参加者又は破綻処理単位期間清算参加者から、転売又は買戻しの数量申告がされたものとみなす。
- 4 前項の場合において、清算参加者は、当社が定めるところにより期限前終了差金を当社との間で授受するものとする。
- 5 前項の期限前終了差金は、当該期限前終了により、第1項の規定により破綻処理単位期間清算参加者に割り当てられた建玉について、期限前終了日の帳入値段によって転売又は買戻し等の未決済約定に対する反対の取引が行われたものとみなして当社が算出する額とする。
- 6 前各項に定めるもののほか、期限前終了に必要な事項は、当社がその都度定める。

(債務の引受けの停止の措置の通知)

第80条 当社は、前条第1項又は第5項の規定に基づき、清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づく債務の引受けの停止の措置を行った場合は、当該清算参加者が有する商品取引清算資格を有する各清算参加者に対しその旨を通知する。

(決済不履行による損失の補填)

第 81 条 当社は、不履行清算参加者が清算約定の決済を履行しないことにより当社が損失(当該不履行の処理(そのおそれがあると認めるときの処理を含む。))に際し当社が受けた損失を含む。)を受けた場合には、当該損失について、それぞれ次に掲げるもの(充用有価証券又は倉荷証券(以下「充用有価証券等」という。))である場合には、当社が定めるところにより当該充用有価証券等を処分して得るもの)によりその預託目的に従って補填する。

- (1) 不履行清算参加者が当社に預託している自己分の取引証拠金
 - (2) 不履行清算参加者が返還請求権を有する取引証拠金(前号に掲げるものを除く。)
 - (3) 不履行清算参加者が当社に預託している清算基金
 - (4) 当該清算参加者が当社に預託しているその他の預託金等
- 2 当社は、前項のほか、当該損失について、それぞれ次に掲げるものにより補填する。
- (1) 前項各号に掲げるものについて、その預託目的に応じて使用した後、余剰部分がある場合は、当該余剰額
 - (2) 不履行清算参加者が当社に預託しているその他の預託金(その預託目的に応じて当社が使用したときは、その残額)
 - (3) 不履行清算参加者が当社に預託した他の清算業務(当社が行う金融商品債務引受業等及びこれに附帯する業務をいう。以下同じ。)に係る余剰担保(不履行清算参加者が他の清算業務について当社に預託した証拠金、清算基金その他の担保(不履行清算参加者が返還請求権を有するものに限る。))のうち、他の清算業務に係る業務方法書の定めるところにより不履行清算参加者の債務の弁済に充当した残額に係るものをいう。)
- 3 前 2 項の規定により補填し得ない損失がある場合において、当該損失は、当該清算参加者が会員等である指定市場開設者に預託している信認金(委託者が優先弁済権を行使したときは、その残額)により、次の各号に定める順により補填する。
- (1) 指定商品市場ごとに当該指定商品市場に係る信認金により補填する。
 - (2) すべての損失を補填した指定商品市場があるときは、当該指定商品市場の信認金は当該指定商品市場に係る指定市場開設者が開設する他の指定商品市場の損失に対して補填するものとする。
 - (3) 前 2 号の規定により補填し得ない損失がある場合において、当該損失は、前 2 号の規定により損失を補填した信認金の残額により補填するものとする。ただし、補填し得ない指定商品市場が 2 以上となる場合にあっては、当該指定商品市場それぞれにおける当該補填し得なかった額は、当該信認金を当該補填し得なかった額で按分したものにより補填する。

- 4 当社は、商品取引清算資格の種類ごとに、前3項の規定により補填し得ない損失がある場合で、第三者による損失補償により受領する金銭その他特に当該損失の補填を目的とする金銭その他の財産(第7項及び次条に規定するものを除く。)がある場合は、当該金銭その他の財産により補填する。
- 5 当社は、商品取引清算資格の種類ごとに、第1項から前項までの規定により補填し得ない損失がある場合は、当社の商品先物等決済保証準備金の積立額を取り崩すことにより補填する。
- 6 前項の当社の商品先物等決済保証準備金の積立額は、当社が定めるところにより積立て等を行った額とする。
- 7 前各項に規定する損失の補填について必要な事項は、当社がその都度定める。

(不履行清算参加者以外の清算参加者の清算基金による損失の補填)

第82条 当社は、不履行清算参加者が当社との間における清算約定の決済を履行しないことにより当社が受けたエネルギー先物等清算資格、堂島農産物先物等清算資格又は堂島砂糖先物等清算資格に係る損失(第75条の規定に基づく処理に際し当社が受けた損失を含む。以下この条及び次条において同じ。)について、前条に定めるところによってもなお補填し得ない損失がある場合には、当社が定めるところにより、当該損失に係る破綻処理単位期間清算参加者が当該破綻処理単位期間の開始日の前日において当社に預託している第69条に規定する各商品取引清算資格の種類ごとの清算基金のうち清算基金所要額に相当する額をもって、それぞれの商品取引清算資格に係る補填し得ない損失額を補填する。

- 2 前項の場合において、当社が破綻処理オークションを実施したときは、当社が定めるところにより、当該破綻処理オークションにおける落札参加者(破綻処理オークションにおいて入札した清算参加者のうち落札者となった者をいう。以下同じ。)以外の破綻処理単位期間清算参加者が当社に預託している清算基金、落札参加者が当社に預託している清算基金の順序で、前項の補填し得ない損失の補填に充てる。
- 3 当社は、第1項の補填し得ない損失額を算出することが相当期間困難であると認める場合には、当該補填し得ない損失額と見込まれる金額として当社が暫定的に算定した額を当該補填し得ない損失額とみなして、同項の補填を行うことができる。この場合において、当社は、同項の当該補填し得ない損失額が確定した場合には、当該確定した補填し得ない損失額と当社が暫定的に算定した額との差に相当する額を、破綻処理単位期間清算参加者との間で授受するものとする。
- 4 当社は、不履行清算参加者から、第1項の規定により補填した損失に係る債

権を回収できたときは、破綻処理単位期間清算参加者に対して、その回収額を按分して返付するものとする。

(特別清算料等)

第 83 条 当社は、不履行清算参加者が当社との間における清算約定の決済を履行しないことにより当社が受けた損失について、前条に定めるところによってもなお補填し得ない損失がある場合には、破綻処理単位期間清算参加者は、当社が定めるところにより、第一特別清算料を納入するものとする。この場合においては、当社は、当該第一特別清算料をもって、当該補填し得ない損失額を補填する。

2 前項の第一特別清算料の額は、商品取引清算資格の種類ごとに、破綻処理単位期間清算参加者に対して、同項の当該補填し得ない損失額を当社が定めるところにより按分した額とする。ただし、第一特別清算料は破綻処理単位期間の開始日の前日における破綻処理単位期間清算参加者の清算基金所要額の 3 倍の額を上限とする。

3 前項の第一特別清算料によっても補填し得ない損失がある場合には、破綻処理単位期間清算参加者は、当社が定めるところにより、第二特別清算料を納入するものとする。この場合においては、当社は、当該第二特別清算料をもって、当該補填し得ない損失額を補填する。

4 前項の第二特別清算料の額は、商品取引清算資格の種類ごとに、破綻処理単位期間清算参加者に対して、第一特別清算料によっても補填し得ない損失額を不履行清算参加者の支払不能等の認定を行った日から当該支払不能等の認定に係る処理が完了した日までの期間(以下「処分期間」という。)において、破綻処理単位期間清算参加者について処分期間に決済されるべき差金代金に相当する額として当社が定める額(第 76 条第 8 項に規定する破綻処理オークションに伴い発生する差金代金に相当する額及び第 79 条第 4 項の規定に定める期限前終了差金を含む。以下「差金代金相当額」という。)の受け取るべき額の総額から支払うべき額の総額を控除した額(当該額が正の場合に限る。)に応じて当社が定めるところにより按分した額とする。

5 破綻処理単位期間清算参加者が第 1 項の第一特別清算料、第 3 項の第二特別清算料又は第 79 条第 4 項に規定する期限前終了差金の納入を行わないときは、当該未納入額について、当該破綻処理単位期間清算参加者が不履行が発生した日(不履行のおそれがあると認めた日を含む。)に清算約定の決済の履行を行わなかったものとみなし、第 76 条からこの条までの規定を適用する。

6 前条第 3 項及び第 4 項の規定は、第 1 項の当該補填し得ない損失額を算出することが相当期間困難であると認める場合について準用する。この場合にお

いて、同条第 3 項前段中「同項の補填を行うことができる」とあるのは「当社が定める日に第一特別清算料及び第二特別清算料の納入を求めることができる」と読み替えるものとする。

第 12 章 雑則

(決済時限の臨時変更)

第 84 条 当社は、必要があると認めるときは、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済時限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清算参加者に通知する。

(システム障害時等における決済日の繰延べ)

第 85 条 当社は、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、当該システムを利用して清算約定の決済を行うことが不可能又は困難であると認める場合は、当該決済の全部又は一部につき決済日をその翌日以降に繰り延べることができる。この場合においては、あらかじめその旨を清算参加者に通知する。

2 前項に規定する決済日の繰延べに関し必要な事項は、当社がその都度定める。

(天災地変等の場合における非常措置)

第 86 条 当社は、清算約定の決済が、天災地変、経済事情の激変、品不足その他やむを得ない理由に基づいて、不可能又は著しく困難であると認められるに至ったときは、取締役会の決議により、その取引について、決済の条件を改めて定めることができる。

2 前項の規定により当社が決済の条件を定めたときは、清算参加者は、これに従わなければならない。

3 第 1 項の場合において、緊急の必要があるときは、当社は、取締役会の決議を経ずに、決済の条件を改めて定めることができる。

(他の清算業務における商品取引債務引受業及びこれに附帯する業務に係る余剰担保の利用)

第 87 条 当社は、不履行清算参加者から預託を受けた商品取引債務引受業及びこれに附帯する業務に係る余剰担保(不履行清算参加者が商品取引債務引受業及びこれに附帯する業務に関して当社に対して返還請求権を有する取引証拠金、受渡代金、清算預託金その他の担保のうち、この業務方法書(この業務

方法書に基づく規則を含む。)の定めるところにより不履行清算参加者の債務の弁済に充当した残額に係るものをいう。)を、他の清算業務に係る業務方法書の定めるところにより不履行清算参加者の当社に対する他の債務の弁済に充当することができる。

(指定市場開設者による手数料の納入)

第 88 条 指定市場開設者は、当社が規則で定める手数料を、その定めるところにより、当社に納入しなければならない。

(債権譲渡の禁止等)

第 89 条 清算参加者は、この業務方法書(この業務方法書に基づく規則を含む。以下この条において同じ。)に別に定める場合を除き、当該業務方法書に規定する一切の債権を、他の者に譲渡し、譲渡の予約をし、又は担保の目的に供することはできない。ただし、清算参加者が日本商品委託者保護基金に対し、清算預託金の返還請求権を担保の目的に供する場合はこの限りでない。

(業務及び事務の委任)

第 90 条 当社は、商品取引債務引受業に関し、当社が定める業務及び事務を、当社が指定する者に委任することができる。

- 2 清算参加者は、この業務方法書に定めるほか、前項の事務に関して同項により指定する者が当社の承認を受けて定めるところによらなければならない。
- 3 第 18 条の規定は、第 1 項の場合について準用する。

(商品取引債務引受業に関する必要事項の決定)

第 91 条 当社は、この業務方法書に定める事項のほか、商品取引債務引受業に関して必要がある場合には、所要の取扱いについて規則により定めることができる。

(附帯業務)

第 92 条 当社は、商品取引債務引受業に附帯する業務を行う。

(金融商品債務引受業等)

第 93 条 当社は、金融商品取引法第 156 条の 3 第 1 項第 6 号に規定する金融商品債務引受業等を行う。

(改正権限)

第 94 条 この業務方法書の変更は、取締役会の決議をもって行う。ただし、変更の内容が軽微である場合は、この限りでない。

付 則

- 1 この業務方法書は、令和 2 年 7 月 27 日から施行する。
- 2 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、この業務方法書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、債務の引受けの取扱いその他必要な事項について、当社がその都度定める。
- 3 当社は、次の各号に掲げる事項及び当該事項に関し必要な手続その他の行為については、この規則の施行の日(以下「施行日」という。)前においても、この業務方法書の例により行うことができる。
 - (1) 第 6 条第 3 項の規定による取得申請者に対するエネルギー先物等清算資格、堂島農産物先物等清算資格又は堂島砂糖先物等清算資格の取得の承認
 - (2) 第 7 条の規定による承認審査の実施
- 4 次の各号に掲げる者が、施行日前において、当社が定めるところにより当該各号に定める商品取引清算資格の取得の申請を行うとき(自社清算資格の場合に限る。)は、当社は第 7 条第 5 号 a の規定に定める事項についての審査は行わないものとする。
 - (1) 株式会社東京商品取引所エネルギー市場又は中京石油市場に係る株式会社日本商品清算機構(以下「日本商品清算機構」という。)の清算資格を有する者
エネルギー先物等清算資格
 - (2) 大阪堂島商品取引所の農産物市場に係る日本商品清算機構の清算資格を有する者
堂島農産物先物等清算資格
 - (3) 大阪堂島商品取引所の砂糖市場に係る日本商品清算機構の清算資格を有する者
堂島砂糖先物等清算資格
- 5 前項の規定により商品取引清算資格の取得の申請を行った者のうち、第 29 条第 3 項各号のいずれかに該当する者にあつては、施行日から 1 年以内に、その事由を消滅させることを要するものとし、当該者がこれを充足できない場合には、当社は、当該者の商品取引清算資格の取消しの措置を行うことができるものとする。

- 6 堂島農産物先物等清算参加者及び堂島砂糖先物等清算参加者にあつては、第53条から第55条までの規定において定める事項については、当分の間、施行日以前の日本商品清算機構の清算参加者として行っていたところにより行うものとする。
- 7 第2項から前項までの規定のほか、この業務方法書の施行時における債務の引受けの取扱いその他必要な事項については、当社がその都度定める。