商品取引債務引受業に関する清算基金所要額に関する規則

（目的）

第１条　この規則は、商品取引債務引受業に関する業務方法書第68条の規定に基づき、清算基金所要額を定める。

（清算基金所要額）

第２条　商品取引債務引受業に関する業務方法書第68条の規定に基づく各清算参加者が有する商品取引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、新たに商品取引清算資格を取得した者が預託すべき当該商品取引清算資格に係る清算基金所要額は、当該商品取引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、商品取引清算資格の取得の申請を行った日において当該商品取引清算資格を有する各清算参加者の当該商品取引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、エネルギー先物等清算資格、堂島農産物先物等清算資格、堂島砂糖先物等清算資格及び堂島貴金属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、毎営業日を清算基金所要額算出基準日として算出し、当該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。

4　前項の規定により算出し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、堂島砂糖先物等清算資格及び堂島貴金属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、清算基金所要額算出基準日の翌日から適用する。

5　商品取引債務引受業に関する業務方法書第68条第3項に規定する当社が定める額は、商品取引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商品取引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、令和２年７月27日から施行する。

2　この規則施行の日（以下「施行日」という。）に適用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3項に定める清算基金所要額算出基準日として、別表に定める方法により算出された額とする。

3　別表の規定にかかわらず、エネルギー先物等清算基金所要額、堂島農産物先物等清算基金所要額及堂島砂糖先物等清算基金所要額の算出のために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 にあっては、それぞれ当該算出対象期間の東京商品取引所のエネルギー市場及び中京石油市場並びに大阪堂島商品取引所の農産物市場及び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、別表に定める方法により当社が算出した額とする。

4　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、この規則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、清算基金所要額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。

5　別表の規定にかかわらず、エネルギー先物等清算基金所要額、堂島農産物先物等清算基金所要額又は堂島砂糖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、商品取引清算資格の種類ごとに商品取引債務引受業に関する業務方法書第81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商品取引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（以下この項において「商品先物等決済保証準備金等」という。）を控除した額を、期間平均基準PML額と、算出基準日における日次最大基準PML額から、商品先物等決済保証準備金等を控除した額を、算出基準日における日次最大基準PML額と、それぞれみなして算出を行うものとする。

6　第2条第2項の規定にかかわらず、施行日において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(各商品取引清算資格に係る自社清算資格に限る。)を取得する者のエネルギー先物等清算基金所要額、堂島農産物先物等清算基金所要額又は堂島砂糖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。

付　則(令和4年9月21日)

この改正規定は、令和4年9月21日から施行する。

付　則(令和5年3月27日)

1　この改正規定は、令和5年3月27日から施行する。

2　別表の規定にかかわらず、堂島貴金属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、商品取引清算資格の種類ごとに商品取引債務引受業に関する業務方法書第81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

める額及び商品取引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（以下この項において「商品先物等決済保証準備金等」という。）を控除した額を、期間平均基準PML額と、算出基準日における日次最大基準PML額から、商品先物等決済保証準備金等を控除した額を、算出基準日における日次最大基準PML額と、それぞれみなして算出を行うものとする。

3　第２条第２項の規定にかかわらず、施行日において堂島貴金属先物等清算資格（各商品取引清算資格に係る自社清算資格に限る。）を取得する者の堂島貴金属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。

付　則(令和５年11月６日)

1　この改正規定は、令和５年11月６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５年11月６日以後の当社が定める日から施行する。

別表

清算基金所要額の算出に関する表

1. エネルギー先物等清算資格に係る清算基金所要額(以下「エネルギー先物等清算基金所要額」という。)

エネルギー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ｅまでに定めるとおりとする。

エネルギー先物等清算基金所要額

＝(期間平均基準PML額$_{ENG}$又は算出基準日における日次最大基準PML額$_{ENG}$のいずれか大きい方の値)×(個社按分基礎IM額$_{ENG}$/按分基礎IM総額$_{ENG}$×0.5+個社按分基礎PML額$_{ENG}$/按分基礎PML総額$_{ENG}$×0.5)

ａ　期間平均基準PML額$_{ENG}$とは、日次最大基準PML額$_{ENG}$の算出対象期間(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。次項から第4項までにおいて同じ。)における平均値をいう。

(注1)日次最大基準PML額$_{ENG}$とは、ストレスシナリオ別最大基準PML額$_{ENG}$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$_{ENG}$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$_{ENG}$(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$_{ENG}$を合計した額)が最大となる清算参加者の基準PML額$_{ENG}$及び純資産額が下位の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$_{ENG}$の合計額をいう。

(注1-1-1)基準PML額$_{ENG}$とは、エネルギー先物等清算資格に係る各区分口座(商品取引債務引受業に関する業務方法書第53条及び同第54条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エネルギー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同第53条第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。ｄにおいて同じ。

ｂ　個社按分基礎IM額$_{ENG}$とは、各清算参加者の、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エネルギー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商品取引債務引受業に関する業務方法書第

53 条及び同第 54 条に規定する区分口座のエネルギー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$_{ENG}$とは、前 b の個社按分基礎 IM 額$_{ENG}$を、すべてのエネルギー先物等清算参加者について合算した額をいう。

d 個社按分基礎 PML 額$_{ENG}$とは、各清算参加者の、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各ストレスシナリオにおける基準 PML 額$_{ENG}$の最大値の平均額をいう。

e 按分基礎 PML 総額$_{ENG}$とは、前 d の個社按分基礎 PML 額$_{ENG}$を、すべてのエネルギー先物等清算参加者について合算した額をいう。

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

堂島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 e までに定めるとおりとする。

堂島農産物先物等清算基金所要額

＝(期間平均基準 PML 額$_{DAGR}$又は算出基準日における日次最大基準 PML 額$_{DAGR}$のいずれか大きい方の値)×(個社按分基礎 IM 額$_{DAGR}$/按分基礎 IM 総額$_{DAGR}$×0.5+個社按分基礎 PML 額$_{DAGR}$/按分基礎 PML 総額$_{DAGR}$×0.5)

a　期間平均基準 PML 額$_{DAGR}$とは、日次最大基準 PML 額$_{DAGR}$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$_{DAGR}$とは、ストレスシナリオ別最大基準 PML 額$_{DAGR}$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$_{DAGR}$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$_{DAGR}$(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$_{DAGR}$を合計した額)が最大となる清算参加者の基準 PML 額$_{DAGR}$及び純資産額が下位の 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$_{DAGR}$の合計額をいう。

(注 1-1-1)基準 PML 額$_{DAGR}$とは、堂島農産物先物等清算資格に係る各区分口座(商品取引債務引受業に関する業務方法書第 53 条及び同第 54 条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堂島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同第 53 条第 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。d において同じ。

b　個社按分基礎 IM 額 $_{DAGR}$ とは、各清算参加者の、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堂島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商品取引債務引受業に関する業務方法書第第 53 条及び同第 54 条に規定する区分口座の堂島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 $_{DAGR}$ とは、前 b の個社按分基礎 IM 額 $_{DAGR}$ を、すべての堂島農産物先物等清算参加者について合算した額をいう。

d 個社按分基礎 PML 額 $_{DAGR}$ とは、各清算参加者の、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各ストレスシナリオにおける基準 PML 額 $_{DAGR}$ の最大値の平均額をいう。

e 按分基礎 PML 総額 $_{DAGR}$ とは、前 d の個社按分基礎 PML 額 $_{DAGR}$ を、すべての堂島農産物先物等清算参加者について合算した額をいう。

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

堂島砂糖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 e までに定めるとおりとする。

堂島砂糖先物等清算基金所要額

＝(期間平均基準 PML 額 $_{DSGR}$ 又は算出基準日における日次最大基準 PML 額 $_{DSGR}$ のいずれか大きい方の値)×(個社按分基礎 IM 額 $_{DSGR}$/按分基礎 IM 総額 $_{DSGR}$×0.5+個社按分基礎 PML 額 $_{DSGR}$/按分基礎 PML 総額 $_{DSGR}$×0.5)

a　期間平均基準 PML 額 $_{DSGR}$ とは、日次最大基準 PML 額 $_{DSGR}$ 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 $_{DSGR}$ とは、ストレスシナリオ別最大基準 PML 額 $_{DSGR}$ 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 $_{DSGR}$ 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 $_{DSGR}$(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 $_{DSGR}$ を合計した額)が最大となる清算参加者の基準 PML 額 $_{DSGR}$ 及び純資産額が下位の 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 $_{DSGR}$ の合計額をいう。

(注 1-1-1)基準 PML 額 $_{DSGR}$ とは、堂島砂糖先物等清算資格に係る各区分口座(商品取引債務引受業に関する業務方法書第 53 条及び同第 54 条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堂

島砂糖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同第53条第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。dにおいて同じ。

b　個社按分基礎IM額$_{DSGR}$とは、各清算参加者の、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堂島砂糖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商品取引債務引受業に関する業務方法書第53条及び同第54条に規定する区分口座の堂島砂糖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$_{DSGR}$とは、前bの個社按分基礎IM額$_{DSGR}$を、すべての堂島砂糖先物等清算参加者について合算した額をいう。

d 個社按分基礎PML額$_{DSGR}$とは、各清算参加者の、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各ストレスシナリオにおける基準PML額$_{DSGR}$の最大値の平均額をいう。

e 按分基礎PML総額$_{DSGR}$とは、前dの個社按分基礎PML額$_{DSGR}$を、すべての堂島砂糖先物等清算参加者について合算した額をいう。

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

堂島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。なお、計算式における用語の意義は、次のaからeまでに定めるとおりとする。

堂島貴金属先物等清算基金所要額
＝(期間平均基準PML額$_{DPME}$又は算出基準日における日次最大基準PML額$_{DPME}$のいずれか大きい方の値)×(個社按分基礎IM額$_{DPME}$/按分基礎IM総額$_{DPME}$×0.5+個社按分基礎PML額$_{DPME}$/按分基礎PML総額$_{DPME}$×0.5)

a 期間平均基準PML額$_{DPME}$とは、日次最大基準PML額$_{DPME}$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$_{DPME}$とは、ストレスシナリオ別最大基準PML額$_{DPME}$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$_{DPME}$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$_{DPME}$(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$_{DPME}$を合計した額)が最大となる清算参加者の基準PML額$_{DPME}$及び純資産額が下位の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$_{DPME}$の合計額をいう。

(注 1-1-1)基準 PML 額 $_{DPME}$ とは、堂島貴金属先物等清算資格に係る各 区分口座(商品取引債務引受業に関する業務方法書第 53 条及び同第 54 条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堂島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同第 53 条第 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。d において同じ。

b 個社按分基礎 IM 額 $_{DPME}$ とは、各清算参加者の、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堂島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商品取引債務引受業に関する業務方法書第第 53 条及び同第 54 条に規定する区分口座の堂島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 $_{DPME}$ とは、前 b の個社按分基礎 IM 総額 $_{DPME}$ を、すべての堂島貴金属先物等清算参加者について合算した額をいう。

d 個社按分基礎 PML 額 $_{DPME}$ とは、各清算参加者の、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各ストレスシナリオにおける基準 PML 額 $_{DPME}$ の最大値の平均額をいう。

e 按分基礎 PML 総額 $_{DPME}$ とは、前 d の個社按分基礎 PML 額 $_{DPME}$ を、すべての堂島貴金属先物等清算参加者について合算した額をいう。