上場商品デリバティブ清算業務における清算基金の計算方法の一部見直し等に伴う「清算基金所要額に関する規則」等の一部改正について

I.　改正趣旨

上場商品デリバティブ清算業務における清算基金の計算方法の一部見直しに伴い、証券取引等清算業務に関する「清算基金所要額に関する規則」及び「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」等について、別紙のとおり所要の改正を行う。

II.　改正概要

	（備　考）
１．上場商品デリバティブ清算業務における清算基金の按分方式の見直し	
・　清算資格ごとの清算基金所要額（個社分）の算出にあたり、清算基金所要額（全社分）を各清算参加者へ按分する際の比率ついて、現在の方式である各清算参加者の取引証拠金所要相当額に基づく比率に加え、各清算参加者の担保超過リスク相当額に基づく比率を加味する。	・　証券取引等清算業務に関する清算基金所要額に関する規則別表及び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別表
２．東証マザーズ指数先物取引の名称変更	
・　「東証マザーズ指数先物取引」の名称を「東証グロース市場２５０指数先物取引」に変更する。	・　手数料に関する規則別表
３．その他	
・　その他所要の改正を行う。	

III.　施行日

１．２０２３年１１月６日から施行する。

２．前１．にかかわらず、Ⅱ．１．については、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、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、２０２３年１１月６日以後の当社が定める日から施行する。

以　上

別 紙

上場商品デリバティブ清算業務における清算基金の計算方法の一部見直し等に伴う
「清算基金所要額に関する規則」等の一部改正について

目次

(ページ)

1　清算基金所要額に関する規則の一部改正新旧対照表 …… 1

2　手数料に関する規則の一部改正新旧対照表 …… 8

3　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の一部改正新旧対照表 …… 9

清算基金所要額に関する規則の一部改正新旧対照表

新	旧
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８項において同じ。）における平均額をいう。 （注１）・（注１－１）　（略） ｂ・ｃ　（略） 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	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）・（注１－１）　（略） ｂ・ｃ　（略） 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。次項から第７項までにおいて同じ。）における平均値をいう。

（注１）～（注１－１－２）　（略）

ｂ・ｃ　（略）

３．　（略）

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ｅ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

＝（期間平均基準ＰＭＬ額$_{PME}$又は算出基準日における日次最大基準ＰＭＬ額$_{PME}$のいずれか大きい方の値）×（個社按分基礎ＩＭ額$_{PME}$／按分基礎ＩＭ総額$_{PME}$×０．５＋個社按分基礎ＰＭＬ額$_{PME}$／按分基礎ＰＭＬ総額$_{PME}$×０．５）

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）・（注１－１）　（略）

（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（先物・オプション取引に係る取引証拠金等に関する規則第９条の２第１項に規定する取引証拠金の事前割増額を除く。）を控

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）～（注１－１－２）　（略）

ｂ・ｃ　（略）

３．　（略）

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

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

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）・（注１－１）　（略）

（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（先物・オプション取引に係る取引証拠金等に関する規則第９条の２第１項に規定する取引証拠金の事前割増額を除く。）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。ｄにおいて同じ。	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・ｃ　（略）	ｂ・ｃ　（略）
ｄ　個社按分基礎ＰＭＬ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各ストレスシナリオにおける基準ＰＭＬ額$_{PME}$の最大値の平均額をいう。	（新設）
ｅ　按分基礎ＰＭＬ総額$_{PME}$とは、前ｄの個社按分基礎ＰＭＬ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。	（新設）
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ｅまでに定めるとおりとする。	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$_{RUB}$×０．５＋個社按分基礎ＰＭＬ額$_{RUB}$／按分基礎ＰＭＬ総額$_{RUB}$×０．５）	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）・（注１－１）　（略） （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（先物・	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）・（注１－１）　（略） （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（先物・

オプション取引に係る取引証拠金等に関する規則第９条の２第１項に規定する取引証拠金の事前割増額を除く。）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。ｄにおいて同じ。	オプション取引に係る取引証拠金等に関する規則第９条の２第１項に規定する取引証拠金の事前割増額を除く。）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・ｃ　（略）	ｂ・ｃ　（略）
ｄ　個社按分基礎ＰＭＬ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各ストレスシナリオにおける基準ＰＭＬ額$_{RUB}$の最大値の平均額をいう。	（新設）
ｅ　按分基礎ＰＭＬ総額$_{RUB}$とは、前ｄの個社按分基礎ＰＭＬ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。	（新設）
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ｅまでに定めるとおりとする。	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$_{AGR}$×０．５＋個社按分基礎ＰＭＬ額$_{AGR}$／按分基礎ＰＭＬ総額$_{AGR}$×０．５）	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）・（注１－１）　（略） （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	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）・（注１－１）　（略） （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（先物・オプション取引に係る取引証拠金等に関する規則第９条の２第１項に規定する取引証拠金の事前割増額を除く。）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。ｄにおいて同じ。	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（先物・オプション取引に係る取引証拠金等に関する規則第９条の２第１項に規定する取引証拠金の事前割増額を除く。）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・ｃ　（略）	ｂ・ｃ　（略）
ｄ　個社按分基礎ＰＭＬ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各ストレスシナリオにおける基準ＰＭＬ額$_{AGR}$の最大値の平均額をいう。	（新設）
ｅ　按分基礎ＰＭＬ総額$_{AGR}$とは、前ｄの個社按分基礎ＰＭＬ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。	（新設）
７．原油先物等清算資格に係る清算基金所要額（以下「原油先物等清算基金所要額」という。） 原油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。	７．原油先物等清算資格に係る清算基金所要額（以下「原油先物等清算基金所要額」という。） 原油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。
原油先物等清算基金所要額 ＝（期間平均基準ＰＭＬ額$_{PTL}$又は算出基準日における日次最大基準ＰＭＬ額$_{PTL}$のいずれか大きい方の値）×（個社按分基礎ＩＭ額$_{PTL}$／按分基礎ＩＭ総額$_{PTL}$×０．５＋個社按分基礎ＰＭＬ額$_{PTL}$／按分基礎ＰＭＬ総額$_{PTL}$×０．５）	原油先物等清算基金所要額 ＝（期間平均基準ＰＭＬ額$_{PTL}$又は算出基準日における日次最大基準ＰＭＬ額$_{PTL}$のいずれか大きい方の値）×個社按分基礎ＩＭ額$_{PTL}$／按分基礎ＩＭ総額$_{PTL}$
ａ　期間平均基準ＰＭＬ額$_{PTL}$とは、日次最大基準ＰＭＬ額$_{PTL}$の算出対象期間における平均値をいう。 （注１）・（注１－１）　（略） （注１－１－１）　基準ＰＭＬ額$_{PTL}$とは、	ａ　期間平均基準ＰＭＬ額$_{PTL}$とは、日次最大基準ＰＭＬ額$_{PTL}$の算出対象期間における平均値をいう。 （注１）・（注１－１）　（略） （注１－１－１）　基準ＰＭＬ額$_{PTL}$とは、

原油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原油先物等清算資格に係る取引証拠金所要相当額（先物・オプション取引に係る取引証拠金等に関する規則第９条の２第１項に規定する取引証拠金の事前割増額を除く。）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。ｄにおいて同じ。	原油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原油先物等清算資格に係る取引証拠金所要相当額（先物・オプション取引に係る取引証拠金等に関する規則第９条の２第１項に規定する取引証拠金の事前割増額を除く。）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・ｃ　（略）	ｂ・ｃ　（略）
ｄ　個社按分基礎ＰＭＬ額$_{PTL}$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各ストレスシナリオにおける基準ＰＭＬ額$_{PTL}$の最大値の平均額をいう。	（新設）
ｅ　按分基礎ＰＭＬ総額$_{PTL}$とは、前ｄの個社按分基礎ＰＭＬ額$_{PTL}$を、すべての原油先物等清算参加者について合算した額をいう。	（新設）
８．　（略）	８．　（略）
令和２年７月２７日改正付則	
１～４　（略）	１～４　（略）
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（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	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。

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・７　（略） 付　　則 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。	６・７　（略）

手数料に関する規則の一部改正新旧対照表

<table>
<tr><th>新</th><th>旧</th></tr>
<tr><td>
別表
清算手数料の算出の基準及び清算手数料率
１　（略）
２　業務方法書第３条第２項第２号から第６号の３までに掲げる取引に係る清算手数料の算出の基準及び清算手数料率は、次のとおりとする。
<table>
<tr><th colspan="2">清算対象取引の区分</th><th>算出の基準</th><th>清算手数料率</th></tr>
<tr><td colspan="4">（略）</td></tr>
<tr><td rowspan="3">業務方法書第３条第２項第５号に掲げる指数先物取引</td><td colspan="3">（略）</td></tr>
<tr><td>東証株価指数先物取引（Ｍｉｎｉ取引）、東証グロース市場２５０指数先物取引、ＴＯＰＩＸ　Ｃｏｒｅ３０先物取引及び東証ＲＥＩＴ指数先物取引
（注１）</td><td colspan="2">（略）</td></tr>
<tr><td colspan="3">（略）</td></tr>
<tr><td colspan="4">（略）</td></tr>
</table>
（注１）～（注６）　（略）

付　則
この改正規定は、令和５年１１月６日から施行する。
</td><td>
別表
清算手数料の算出の基準及び清算手数料率
１　（略）
２　業務方法書第３条第２項第２号から第６号の３までに掲げる取引に係る清算手数料の算出の基準及び清算手数料率は、次のとおりとする。
<table>
<tr><th colspan="2">清算対象取引の区分</th><th>算出の基準</th><th>清算手数料率</th></tr>
<tr><td colspan="4">（略）</td></tr>
<tr><td rowspan="3">業務方法書第３条第２項第５号に掲げる指数先物取引</td><td colspan="3">（略）</td></tr>
<tr><td>東証株価指数先物取引（Ｍｉｎｉ取引）、東証マザーズ指数先物取引、ＴＯＰＩＸ　Ｃｏｒｅ３０先物取引及び東証ＲＥＩＴ指数先物取引
（注１）</td><td colspan="2">（略）</td></tr>
<tr><td colspan="3">（略）</td></tr>
<tr><td colspan="4">（略）</td></tr>
</table>
（注１）～（注６）　（略）
</td></tr>
</table>

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の一部改正新旧対照表

新	旧
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）・（注１－１）　（略） （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（商品取引債務引受業に係る取引証拠金等に関する規則第１２条の２第１項に規定する取引証拠金の事前割増額を除く。）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	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ｃ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$_{ENG}$ ａ　期間平均基準ＰＭＬ額$_{ENG}$とは、日次最大基準ＰＭＬ額$_{ENG}$の算出対象期間における平均値をいう。 （注１）・（注１－１）　（略） （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（商品取引債務引受業に係る取引証拠金等に関する規則第１２条の２第１項に規定する取引証拠金の事前割増額を除く。）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。	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・ｃ　（略）	ｂ・ｃ　（略）
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。	（新設）
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。	（新設）
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。	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ｃ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）	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$_{DAGR}$
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）・（注１－１）　（略） （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	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）・（注１－１）　（略） （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。	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。
ｂ・ｃ　（略）	ｂ・ｃ　（略）
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。	（新設）
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。	（新設）
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。	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ｃ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）	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$_{DSGR}$
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）・（注１－１）　（略） （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	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）・（注１－１）　（略） （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。	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。
ｂ・ｃ　（略）	ｂ・ｃ　（略）
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。	（新設）
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。	（新設）
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。	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ｃ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）	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$_{DPME}$
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）・（注１－１）　（略） （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	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）・（注１－１）　（略） （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。	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。
ｂ・ｃ　（略）	ｂ・ｃ　（略）
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。	（新設）
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。	（新設）
令和２年７月２７日制定付則	
１～４　（略）	１～４　（略）
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。	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第８１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　（略）	６　（略）
令和５年３月２７日改正付則	
１　（略）	１　（略）

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。	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。
３　（略）	３　（略）
付　　則 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。	