

株式会社東京商品取引所における E F F 取引の廃止等に伴う  
「商品取引債務引受業に係る取引証拠金等に関する規則」の一部改正について

I. 改正趣旨

株式会社東京商品取引所における E F F 取引の廃止等に伴い、「商品取引債務引受業に係る取引証拠金等に関する規則」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. E F F 取引の廃止

- ・ 日中取引証拠金所要額及び緊急取引証拠金所要額の算出の対象となる先物取引から E F F 取引を除く。

- ・ 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 2 4 条及び第 2 7 条

2. その他

- ・ その他所要の改正を行う。

III. 施行日

2 0 2 2 年 1 月 3 1 日から施行する。

以 上

## 商品取引債務引受業に係る取引証拠金等に関する規則の一部改正新旧対照表

| 新                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 旧                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>(区分口座の取引証拠金所要額)</p> <p>第6条 当社は、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取引証拠金所要額について、次の各号に掲げる区分口座ごとに、当該各号に定める方法によって算出する。</p> <p>(1)～(3) (略)</p> <p>2 (略)</p> <p>(日中取引証拠金所要額)</p> <p>第24条 日中取引証拠金所要額は、日中リスク再計算額に日中先物取引差金相当額を、当該額が支払いとなる場合は加え、受領となる場合は減じて得た額に、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(同第53条第1項第1号に規定する区分口座を除く。以下この条、第27条、第29条、第30条及び第32条において同じ。)ごとの担保超過リスク額を合計した額を加えた額とする。この場合において、これらの用語の意義は、次の各号に定めるところによる。</p> <p>(1) (略)</p> <p>(2) 日中先物取引差金相当額</p> <p>先物取引について、次のa及びbに定める額を合計した額とする。</p> <p>a 先物取引について、その取引日の夜間立会及び日中立会のうち午前11時までに行われた自己の計算による先物取引(当該取引日の午前11時までに行われた立会外取引、EFP取引、EFS取引及びストップロス取引を含む。)について、その約定値段と日中帳入値段との</p> | <p>(区分口座の取引証拠金所要額)</p> <p>第6条 当社は、商品取引債務引受業に関する業務方法書第53及び同第54条に規定する区分口座の取引証拠金所要額について、次の各号に掲げる区分口座ごとに、当該各号に定める方法によって算出する。</p> <p>(1)～(3) (略)</p> <p>2 (略)</p> <p>(日中取引証拠金所要額)</p> <p>第24条 日中取引証拠金所要額は、日中リスク再計算額に日中先物取引差金相当額を、当該額が支払いとなる場合は加え、受領となる場合は減じて得た額に、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(同第53条第1項第1号に規定する区分口座を除く。以下この条、第27条、第29条、第30条及び第32条において同じ。)ごとの担保超過リスク額を合計した額を加えた額とする。この場合において、これらの用語の意義は、次の各号に定めるところによる。</p> <p>(1) (略)</p> <p>(2) 日中先物取引差金相当額</p> <p>先物取引について、次のa及びbに定める額を合計した額とする。</p> <p>a 先物取引について、その取引日の夜間立会及び日中立会のうち午前11時までに行われた自己の計算による先物取引(当該取引日の午前11時までに行われた立会外取引、<u>EFF取引</u>、EFP取引、EFS取引及びストップロス取引を含む。)について、その約定値段と日中</p> |

差に相当する額

b (略)

(3) (略)

(緊急取引証拠金所要額)

第27条 緊急取引証拠金所要額は、リスク再計算額に先物取引差金相当額を、当該額が支払いとなる場合は加え、受領となる場合は減じて得た額に、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ごとの担保超過リスク額を合計した額を加えた額とする。この場合において、これらの用語の意義は、次の各号に定めるところによる。

(1) (略)

(2) 先物取引差金相当額

先物取引について、次のa及びbに定める額を合計した額とする。

a 先物取引について、その取引日の夜間立会及び日中立会のうち午後1時までに行われた自己の計算による先物取引（当該取引日の午後1時までに行われた立会外取引、EFP取引、EFS取引、ストップロス取引を含む。）について、その約定値段と緊急帳入値段との差に相当する額

b (略)

(3) (略)

第5章 取引証拠金の預託の委託に係る契約

第6章 雑則

付 則

この改正規定は、令和4年1月31日から施

帳入値段との差に相当する額

b (略)

(3) (略)

(緊急取引証拠金所要額)

第27条 緊急取引証拠金所要額は、リスク再計算額に先物取引差金相当額を、当該額が支払いとなる場合は加え、受領となる場合は減じて得た額に、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ごとの担保超過リスク額を合計した額を加えた額とする。この場合において、これらの用語の意義は、次の各号に定めるところによる。

(1) (略)

(2) 先物取引差金相当額

先物取引について、次のa及びbに定める額を合計した額とする。

a 先物取引について、その取引日の夜間立会及び日中立会のうち午後1時までに行われた自己の計算による先物取引（当該取引日の午後1時までに行われた立会外取引、EFF取引、EFP取引、EFS取引、ストップロス取引を含む。）について、その約定値段と緊急帳入値段との差に相当する額

b (略)

(3) (略)

第4章 取引証拠金の預託の委託に係る契約

第5章 雑則

行する。

別表 2

取引受渡証拠金所要額の算出に関する表

1. (略)

2. 堂島農産物及び堂島砂糖に係る取引受渡証拠金所要額

(1) 清算参加者がとうもろこし及び粗糖の受渡しを行う場合の堂島農産物及び堂島砂糖に係る取引受渡証拠金所要額は、次に定める計算式により算出される額とする。

$$\begin{aligned} & \text{堂島農産物及び堂島砂糖に係る取引受渡証拠金所要額} \\ & = \text{受渡値段} \times \text{受渡単位の倍率} \\ & \times \frac{5}{100} \end{aligned}$$

(2) (略)

別表 2

取引受渡証拠金所要額の算出に関する表

1. (略)

2. 大阪堂島農産物及び大阪堂島砂糖に係る取引受渡証拠金所要額

(1) 清算参加者がとうもろこし及び粗糖の受渡しを行う場合の大阪堂島農産物及び大阪堂島砂糖に係る取引受渡証拠金所要額は、次に定める計算式により算出される額とする。

$$\begin{aligned} & \text{大阪堂島農産物及び大阪堂島砂糖に係る取引受渡証拠金所要額} \\ & = \text{受渡値段} \times \text{受渡単位の倍率} \\ & \times \frac{5}{100} \end{aligned}$$

(2) (略)