デリバティブの祝日取引制度導入に伴う証券取引等清算業務に関する「業務方法書」等及び「商品取引債務引受業に関する業務方法書」等の一部改正について

I.　改正趣旨

株式会社大阪取引所及び株式会社東京商品取引所においてデリバティブの祝日取引制度が導入されることに伴い、祝日取引において成立した取引の債務引受を行うとともに、祝日取引において発生し得る清算参加者のエクスポージャーの拡大に対応するためのリスク管理制度を導入するなど、証券取引等清算業務に関する「業務方法書」等及び「商品取引債務引受業に関する業務方法書」等について所要の改正を行う。

II.　改正概要

	（備　考）
（１）祝日取引実施日における債務の引受け ・指定市場開設者が休業日において立会を行う日として定める日（以下「祝日取引実施日」という。）においては、同日における取引を行う旨の届出を行った清算参加者（以下「祝日清算参加者」という。）を対象に債務の引受けを行う。	・証券取引等清算業務に関する業務方法書第４条 ・商品取引債務引受業に関する業務方法書第４条
（２）祝日清算参加者の届出 ・清算参加者の届出事項に、祝日取引実施日における取引を開始する場合等を追加する。	・証券取引等清算業務に関する業務方法書第１９条 ・商品取引債務引受業に関する業務方法書第１９条
（３）連続する祝日取引実施日においてリスクが増大した清算参加者の債務の引受けの停止 ・連続する祝日取引実施日においては、祝日清算参加者のリスク量及び担保に関する指標の算出を行い、その状況に応じて担保の追加預託又リスクを削減する取引を求める。 ・時限までにリスクの状況が改善されなかった場合には、祝日清算参加者の祝日取引実施日に係る債務引受停止を行うことができる。	・証券取引等清算業務に関する業務方法書第２９条の６、第３５条、業務方法書の取扱い第９条の６ ・商品取引債務引受業に関する業務方法書第３３条の２、第４０条、商品取引債務引受業に関する業務方法書の取扱い第１１条の２
（４）取引証拠金の事前割増制度	

・祝日取引実施日に先立ち、祝日清算参加者に対して、祝日取引実施日に取引が行われる先物・オプション取引に係る建玉について、ＳＰＡＮにより計算した証拠金額に一定の割合を乗じて得た額の合計額を、事前割増額として清算参加者自己による預託を求める。 ・祝日清算参加者が所定の申請を行い、当社がこれを認めた場合には、事前割増額について以下のとおり取扱うことができる。 ① 顧客が祝日取引を行わない場合に、当該顧客を管理する区分口座を事前割増額の算出から除外する。 ② 顧客と事前に合意している場合に、当該顧客を管理する区分口座の当該顧客に起因する事前割増額について、当該顧客による預託を求める。	・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５条、第９条、第９条の２等 ・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５条、第１２条、第１２条の２等
・取引証拠金の事前割増額は、各清算資格の清算基金所要額の基準ＰＭＬ額の計算における取引証拠金所要相当額及び按分基礎ＩＭ額に含めないものとする。	・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 ・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
（４）その他 ・その他所要の改正を行う。	・証券取引等清算業務に関する業務方法書第７３条の３１の５８

III.　施行日

１．２０２２年9月２１日から施行する。

２．前１．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、２０２２年９月２１日以後の当社が定める日から施行する。

以　上

デリバティブの祝日取引制度導入に伴う証券取引等清算業務に関する「業務方法書」等及び「商品取引債務引受業に関する業務方法書」等の一部改正について

目次

(ページ)

１　業務方法書の一部改正新旧対照表 ･･･ １

２　先物・オプション取引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 ･････････ ５

３　商品取引債務引受業に関する業務方法書の一部改正新旧対照表･････････････････････････ ８

４　業務方法書の取扱いの一部改正新旧対照表･･･ １１

５　清算基金所要額に関する規則の一部改正新旧対照表 ･････････････････････････････････ １３

６　先物・オプション取引に係る取引証拠金等に関する規則の取扱いの一部改正新旧対照表･ ２２

７　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 ･････････ ２３

８　商品取引債務引受業に関する業務方法書の取扱いの一部改正新旧対照表 ･････････････ ２６

９　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 ･････ ２７

１０　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取扱いの一部改正新旧対照表･ ２９

業務方法書の一部改正新旧対照表

新	旧
（休業日） 第４条　当社は、前条第２項第１号から第１０号まで、第１２号及び第１３号に掲げる清算対象取引については、次の各号に掲げる日を休業日（以下単に「休業日」という。）とする。 （１）～（５）　（略） （６）　１月１日 （７）　１月２日 （８）　１月３日 （９）　（略） ２　（略） ３　前２項の規定にかかわらず、次の各号に定める時間においては、当該各号に定めるところによる。 （１）　指定市場開設者の定める立会終了時が、休業日に属する場合の当該休業日における取引時間 証券取引等清算業務を行うものとする。 （２）　第１項各号（第１号、第５号及び第６号を除く。）から指定市場開設者が休業日において立会を行う日として定める日（以下「祝日取引実施日」という。）に行う各立会の取引時間及び当該立会終了時が属する日における当該取引時間 第１９条第５項に規定する届出を行った清算参加者に対して、証券取引等清算業務のうち第４６条に定める清算対象取引に係る債務の引受けを行うものとする。 ４～６　（略） （届出事項） 第１９条　（略） ２～４　（略） ５　第１項から第３項までに規定するほか、次の各号に定める場合には、当該各号に定める者は、当社が定めるところにより、あらかじめ当社に届け出なければならない。 （１）　清算参加者が指定市場開設者の取引参加者として祝日取引実施日における取引を開始する場合　当該清算参加者	（休業日） 第４条　当社は、前条第２項第１号から第１０号まで、第１２号及び第１３号に掲げる清算対象取引については、次の各号に掲げる日を休業日（以下単に「休業日」という。）とする。 （１）～（５）　（略） （６）　年始３日間 （新設） （新設） （７）　（略） ２　（略） ３　前２項の規定にかかわらず、指定市場開設者の定める取引時間又は立会時が、前２項各号に掲げる日に含まれる場合には、当社は、当該取引時間又は立会時の間は、証券取引等清算業務を行うものとする。 （新設） （新設） ４～６　（略） （届出事項） 第１９条　（略） ２～４　（略） （新設）

（２）　他社清算参加者と清算受託契約を締結している非清算参加者が指定市場開設者の取引参加者として祝日取引実施日における取引を開始することに伴い、当該日における有価証券等清算取次ぎを開始する場合　当該他社清算参加者 （指定市場開設者が休業日において立会を行う日が連続する場合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２９条の６　当社は、祝日取引実施日が連続する休業日に設定された場合（当該連続する休業日の間に祝日取引実施日ではない休業日がある場合を含む。）の当該連続する休業日（以下「連続する祝日取引実施日」という。）の次の各号に定める時刻において、第１９条第５項の届出を行った清算参加者が負っているものと想定されるリスク量及び当該清算参加者が預託する取引証拠金等により当社が定める指標の算出を行う。 （１）　当社が定める判定時刻（連続する祝日取引実施日の最終日を除く。） （２）　前号の時刻が属する日の次の祝日取引実施日の当社が期限として定める時刻 ２　当社は、前項第１号に定める時刻においては、同項に定める指標の算出のほか、当該指標が当社が別に定める値を超えた場合の当該超過額を併せて算出することとする。 ３　当社は、第１項第１号に定める時刻において、一の清算参加者に係る同項に定める指標が当社が定める値を超えた場合で、超過額が当社が定める金額を超えたときは、当該清算参加者に対して当該当社が定める金額を超過する額を通知するとともに、次の各号に定める対応のいずれかを行うよう求めることができる。 （１）　第１項第２号に定める時刻までに当該超過額に相当する額を自己分の取引証拠金として当社に預託すること （２）　第１項第２号に定める時刻において同項に定める指標が前項に定める値を下回ること ４　当社は、前項に定める対応を清算参加者へ求めた場合において、当該清算参加者が同項各号のいずれかの対応を行わなかったときその他当社が必要と認めるときは、当該連続する祝日取引実施日における当該清	（新設）

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を行うことができる。	
（債務の引受けの停止を受けた清算参加者の取扱い） 第３５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（第２９条の６第４項の規定に基づく債務の引受けの全部又は一部の停止を除く。）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。	（債務の引受けの停止を受けた清算参加者の取扱い） 第３５条　当社がこの章の規定に基づき債務の引受けの全部若しく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・３　（略）	２・３　（略）
（限月現金決済先物取引の最終決済に伴う金銭の授受） 第７３条の３１の５８　限月現金決済先物取引（指定市場開設者が定める限月現金決済先物取引をいう。以下同じ。）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、最終清算数値（指定市場開設者が定める最終清算数値をいう。以下同じ。）と取引最終日（指定市場開設者が限月現金決済先物取引に関し定める取引最終日をいう。）の清算値段とを比較して差を生じたときは、商品先物等清算参加者はその差に相当する金銭を最終決済期日（指定市場開設者が定める限月現金決済先物取引における最終決済期日をいう。）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、金銭を支払う商品先物等清算参加者は、当該金銭の授受を行う日の午前１１時までに、金銭を受領する商品先物等清算参加者は、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。	（限月現金決済先物取引の最終決済に伴う金銭の授受） 第７３条の３１の５８　限月現金決済先物取引（指定市場開設者が定める限月現金決済先物取引をいう。以下同じ。）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、最終清算数値（指定市場開設者が定める最終清算数値をいう。以下同じ。）と取引最終日（指定市場開設者が限月現金決済先物取引に関し定める取引最終日をいう。）の清算値段とを比較して差を生じたときは、商品先物等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限月現金決済先物取引における最終決済日をいう。）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、金銭を支払う商品先物等清算参加者は、当該金銭の授受を行う日の午前１１時までに、金銭を受領する商品先物等清算参加者は、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。
付　　則 １　この改正規定は、令和４年９月２１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４年９月２１日以後の当社が定める日から施行する。	

3　この改正規定の施行に関し必要な事項については、当社が別に定めるところによる。	

先物・オプション取引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
（顧客の証拠金所要額） 第５条　前条の規定は、次項に定める場合を除き、顧客（顧客が取次者である場合は、申込者をいう。以下同じ。）の証拠金所要額（第９条の２第４項の規定により顧客が事前割増額の預託を行う場合においては、当該事前割増額のうち当該顧客に係る額を加算する。以下同じ。）について準用する。この場合において、「自己分の取引証拠金所要額」とあるのは「顧客の証拠金所要額」と、「自己分のＳＰＡＮ証拠金額」とあるのは「顧客のＳＰＡＮ証拠金額」と、「自己分のネット・オプション価値の総額」とあるのは「顧客のネット・オプション価値の総額」と、「第６条の２第１項及び第６条の３第１項」とあるのは「第６条の２第２項」と、「取引参加者の自己の計算による」とあるのは「当該顧客の委託に基づく」と、「自己分の買オプション価値の総額」とあるのは「顧客の買オプション価値の総額」と、「自己分の売オプション価値の総額」とあるのは「顧客の売オプション価値の総額」と、「自己分の取引受渡証拠金」とあるのは「顧客の取引受渡証拠金」と読み替えるものとする。	（顧客の証拠金所要額） 第５条　前条の規定は、次項に定める場合を除き、顧客（顧客が取次者である場合は、申込者をいう。以下同じ。）の証拠金所要額について準用する。この場合において、「自己分の取引証拠金所要額」とあるのは「顧客の証拠金所要額」と、「自己分のＳＰＡＮ証拠金額」とあるのは「顧客のＳＰＡＮ証拠金額」と、「自己分のネット・オプション価値の総額」とあるのは「顧客のネット・オプション価値の総額」と、「第６条の２第１項及び第６条の３第１項」とあるのは「第６条の２第２項」と、「取引参加者の自己の計算による」とあるのは「当該顧客の委託に基づく」と、「自己分の買オプション価値の総額」とあるのは「顧客の買オプション価値の総額」と、「自己分の売オプション価値の総額」とあるのは「顧客の売オプション価値の総額」と、「自己分の取引受渡証拠金」とあるのは「顧客の取引受渡証拠金」と読み替えるものとする。
２　（略）	２　（略）
（自己分の取引証拠金の預託） 第９条　清算参加者は、自己の計算による先物取引の売付け若しくは買付けが成立した場合、オプション取引の売付けが成立した場合又は商品先物取引について受渡しにより決済を行う場合は、第４条に規定する取引参加者の自己分の取引証拠金所要額（業務方法書第１９条第５項に規定する届出を行った清算参加者にあっては当該取引証拠金所要額に次条に規定する取引証拠金の事前割増額を加えた額）以上の額の取引証拠金を、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。この場合において、当該取引証拠金は、有価証券等をもって代用預託することができる。	（自己分の取引証拠金の預託） 第９条　清算参加者は、自己の計算による先物取引の売付け若しくは買付けが成立した場合、オプション取引の売付けが成立した場合又は商品先物取引について受渡しにより決済を行う場合は、第４条に規定する自己分の取引証拠金所要額以上の額の取引証拠金を、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。この場合において、当該取引証拠金は、有価証券等をもって代用預託することができる。
（取引証拠金の事前割増額） 第９条の２　取引証拠金の事前割増額は、指定市場開設者が休業日において立会を行う日として定める日（以下「祝日取引実施	（新設）

日」という。）から起算して３日前（祝日取引実施日でない休業日を除く。ただし、祝日取引実施日が連続する休業日に設定される場合（当該連続する休業日の間に取引を行わない休業日がある場合を含む。以下「連続する祝日取引実施日」という。）には、当該連続する祝日取引実施日の初日から起算するものとする。）における清算参加者の区分口座で管理される建玉のうち、指定市場開設者が休業日において立会を行う先物・オプション取引に係る建玉について、ＳＰＡＮにより計算した証拠金額に当社が定める割合を乗じて得た額を、当該清算参加者のすべての区分口座について合計した額をいう。

２　前項の規定にかかわらず、業務方法書第１９条第５項に定める届出を行った清算参加者が同第４６条の３第２号、第３号又は第４６条の４第２号に規定する一の区分口座で管理する建玉に係る顧客について、当社が定めるところにより当該顧客が祝日取引実施日における取引を行わないことを理由に当該顧客を管理する区分口座を取引証拠金の事前割額の計算の適用外とすることを希望する旨の申請を行った場合において、当社が当該申請を承認したときは、当社は当該区分口座を前項の事前割増額の算出から除外することができる。

３　第１項の規定にかかわらず、清算参加者は、事前割増額の起因となった一の顧客との間で、事前割増額のうち当該顧客に起因する額として当社が定める額に限り、当該顧客の金銭をもって預託することを合意することができる。

４　清算参加者は、前項の規定により、顧客との間で合意した場合において、当社が定めるところによりその旨の申請を行い、当社が当該申請を承認した場合には、当該顧客に係る区分口座に係る事前割増額について、当該顧客の取引証拠金として、当社が定めるところにより、当社に預託することができる。この場合において、当該取引証拠金は、有価証券等をもって代用預託することができる。

（日中取引証拠金所要額）

第２０条の３　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及び日中オプション取引代金相当額を、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、業務方法書第

（日中取引証拠金所要額）

第２０条の３　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及び日中オプション取引代金相当額を、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、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（第４６条の３第１号に規定する区分口座を除く。以下この条、第２２条、第２３条の２、第２３条の３及び第２４条の２において同じ。）ごとの担保超過リスク額を合計した額及び第９条の２第１項に定める事前割増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）～（４）　（略） （緊急取引証拠金所要額） 第２２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及びオプション取引代金相当額を、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、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ごとの担保超過リスク額を合計した額及び第９条の２第１項に定める事前割増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）～（４）　（略） 付　則 １　この改正規定は、令和４年９月２１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４年９月２１日以後の当社が定める日から施行する。 ３　この改正規定の施行に関し必要な事項については、当社が別に定めるところによる。	４６条の３及び第４６条の４に規定する区分口座（第４６条の３第１項第１号に規定する区分口座を除く。以下この条、第２２条、第２３条の２、第２３条の３及び第２４条の２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。 （１）～（４）　（略） （緊急取引証拠金所要額） 第２２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及びオプション取引代金相当額を、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、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）～（４）　（略）

商品取引債務引受業に関する業務方法書の一部改正新旧対照表

新	旧
（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）～（３）　（略） （４）　１月１日 （５）　１月２日 （６）　１月３日 （７）　（略） ２　前項の規定にかかわらず、次の各号に定める時間においては、当該各号に定めるところによる。 （１）　指定市場開設者の定める立会終了時が、休業日に属する場合の当該休業日における取引時間 商品取引債務引受業を行うものとする。 （２）　第１項各号（第１号、第３号及び第４号を除く。）から指定市場開設者が休業日において立会を行う日として定める日（以下「祝日取引実施日」という。）に行う各立会の取引時間及び当該立会終了時が属する日における当該取引時間 第１９条第４項に規定する届出を行った清算参加者に対して、商品取引債務引受業のうち第５１条に定める清算対象取引に係る債務の引受けを行うものとする。 ３　（略） ４　（略） ５　（略）	（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）～（３）　（略） （４）　年始３日間 （新設） （新設） （５）　（略） （新設） ２　（略） ３　（略） ４　（略）
（届出事項） 第１９条　（略） ２・３　（略） ４　前３項に規定するほか、次の各号に定める場合には、当該各号に定める者は、当社が定めるところにより、あらかじめ当社に届け出なければならない。 （１）　清算参加者が指定市場開設者の取引参加者として祝日取引実施日における取引を開始する場合　当該清算参加者 （２）　他社清算参加者と清算受託契約を締結している非清算参加者が指定市場開設者の取引参加者として祝日取引実施日における取引を開始することに伴い、当	（届出事項） 第１９条　（略） ２・３　（略） （新設）

該日における商品清算取引を開始する場合　当該他社清算参加者 （指定市場開設者が休業日において立会を行う日が連続する場合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条の２　当社は、祝日取引実施日が連続する休業日に設定された場合（当該連続する休業日の間に祝日取引実施日ではない休業日がある場合を含む。）の当該連続する休業日（以下「連続する祝日取引実施日」という。）の次の各号に定める時刻において、第１９条第４項の届出を行った清算参加者が負っているものと想定されるリスク量及び当該清算参加者が預託する取引証拠金等により当社が定める指標の算出を行う。 （１）　当社が定める判定時刻（連続する祝日取引実施日の最終日を除く。） （２）　前号の時刻が属する日の次の祝日取引実施日の当社が期限として定める時刻 ２　当社は、前項第１号に定める時刻においては、同項に定める指標の算出のほか、当該指標が当社が別に定める値を超えた場合の当該超過額を併せて算出することとする。 ３　当社は、第１項第１号に定める時刻において、一の清算参加者に係る同項に定める指標が当社が定める値を超えた場合で、超過額が当社が定める金額を超えたときは、当該清算参加者に対して当該当社が定める金額を超過する額を通知するとともに、次の各号に定める対応のいずれかを行うよう求めることができる。 （１）　第１項第２号に定める時刻までに当該超過額に相当する額を自己分の取引証拠金として当社に預託すること （２）　第１項第２号に定める時刻において同項に定める指標が前項に定める値を下回ること ４　当社は、前項に定める対応を清算参加者へ求めた場合において、当該清算参加者が同項各号のいずれかの対応を行わなかったときその他当社が必要と認めるときは、当該連続する祝日取引実施日における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を行うことができる。	（新設）

（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（第３３条の２に基づく債務の引受けの全部又は一部の停止を除く。）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・３　（略） 付　則 １　この改正規定は、令和４年９月２１日又は農林水産大臣及び経済産業大臣の認可を受けた日のいずれか遅い日から施行する。 ２　前項の規定にかかわらず、この改正規定は、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、前項に定める日から施行することが適当でない場合には、当該日から３か月以内の日で、当社が別に定める日から施行する。	（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・３　（略）

業務方法書の取扱いの一部改正新旧対照表

新	旧
（措置の対象とする取引証拠金） 第９条の４　業務方法書第２９条の４第１項に規定する当社が定める取引証拠金は、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（同条第３項によるもののうち業務方法書第４６条の３第２号及び第４６条の４第２号に規定する区分口座に係るものを除く。）及び先物・オプション取引に係る取引証拠金等に関する規則第２０条第１項第２号に掲げる取引証拠金並びに取引所ＦＸ取引に係る取引証拠金等に関する規則第１９条第１項第４号及び第８号に掲げる取引証拠金とする。	（措置の対象とする取引証拠金） 第９条の４　業務方法書第２９条の４第１項に規定する当社が定める取引証拠金は、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２０条第１項第２号に掲げる取引証拠金並びに取引所ＦＸ取引に係る取引証拠金等に関する規則第１９条第１項第４号及び第８号に掲げる取引証拠金とする。
２　業務方法書第２９条の４第２項に規定する当社が定める取引証拠金は、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（同条第３項によるもののうち業務方法書第４６条の３第２号及び第４６条の４第２号に規定する区分口座に係るものを除く。）、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２０条第１項第２号、第５号、第７号及び第１０号に掲げる取引証拠金並びに取引所ＦＸ取引に係る取引証拠金等に関する規則第１９条第１項第４号及び第８号に掲げる取引証拠金とする。	２　業務方法書第２９条の４第２項に規定する当社が定める取引証拠金は、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２０条第１項第２号、第５号、第７号及び第１０号に掲げる取引証拠金並びに取引所ＦＸ取引に係る取引証拠金等に関する規則第１９条第１項第４号及び第８号に掲げる取引証拠金とする。
（連続する祝日取引実施日における指標の算出方法等） 第９条の６　業務方法書第２９条の６第１項に定める当社が定める指標は、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２３条の３第２項に規定する通常市場環境下リスク相当額通算額を、清算参加者の自己分の取引証拠金預託額及び清算基金預託額の合計額で除して算出する。 ２　業務方法書第２９条の６第１項第１号に定める当社が定める判定時刻は１６時、同項第２号に定める当社が期限として定める時刻は１１時とする。 ３　業務方法書第２９条の６第２項に定める当社が別に定める値は１とする。 ４　業務方法書第２９条の６第３項に定める当社が定める金額は、業務方法書第７８条第４項に規定する第三者による損失補償により受領する金銭のうち祝日取引実施日に	（新設）

おける決済不履行の損失の補填を目的としたものとする。 付　　則 1　この改正規定は、令和４年９月２１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４年９月２１日以後の当社が定める日から施行する。 別紙様式８ 原油先物等清算受託契約書 略 住　　所 甲（原油先物等清算参加者）　商号又は名称 代　表　者　　印 住　　所 乙（原油先物等非清算参加者）　商号又は名称 代　表　者　　印	別紙様式８ 原油先物等清算受託契約書 略 住　　所 甲（指数先物等清算参加者）　商号又は名称 代　表　者　　印 住　　所 乙（指数先物等非清算参加者）　商号又は名称 代　表　者　　印

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．　（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	別表 清算基金所要額の算出に関する表 １．　（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（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（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。）を合算した額をいう。）の平均額をいう。

c　（略）

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

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　（略）

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（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　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（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

＝（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$_{IDX}$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。

る取引証拠金の事前割増額を除く。）を合算した額をいう。）の平均額をいう。

c　（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）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っては、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（先物・オプション取引に係る取引証拠

c　（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）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っては、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

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　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（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。）を合算した額をいう。）の平均額をいう。

c　（略）

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

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$_{PME}$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　（略）

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（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　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（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。）を合算した額をいう。）の平均額をいう。

ｃ　（略）

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$_{AGR}$

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　（略）

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（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。	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$_{AGR}$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（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。）を合算した額をいう。）の平均額をいう。	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　（略）	c　（略）

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

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）日次最大基準ＰＭＬ額ＰＴＬとは、ストレスシナリオ別最大基準ＰＭＬ額ＰＴＬ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ＰＴＬ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ＰＴＬ（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ＰＴＬを合計した額）が最大となる清算参加者の基準ＰＭＬ額ＰＴＬ及び２番目に最大となる清算参加者の基準ＰＭＬ額ＰＴＬの合計額をいう。

（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。

ｂ　個社按分基礎ＩＭ額ＰＴＬとは、各清算参加者の、先物・オプション清算

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

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）日次最大基準ＰＭＬ額ＰＴＬとは、ストレスシナリオ別最大基準ＰＭＬ額ＰＴＬ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ＰＴＬ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ＰＴＬ（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ＰＴＬを合計した額）が最大となる清算参加者の基準ＰＭＬ額ＰＴＬ及び２番目に最大となる清算参加者の基準ＰＭＬ額ＰＴＬの合計額をいう。

（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原油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。）を合算した額をいう。）の平均額をいう。 c　（略）	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原油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原油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　（略）
８．　（略）	８．　（略）
付　則 １　この改正規定は、令和４年９月２１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４年９月２１日以後の当社が定める日から施行する。	

先物・オプション取引に係る取引証拠金等に関する規則の取扱いの一部改正新旧対照表

新	旧
（取引証拠金の事前割増額の取扱い） 第２条の３　取引証拠金規則第９条の２第１項に規定する取引証拠金の事前割増額の算出に用いる当社が定める割合は、指定市場開設者が休業日において立会を行う日として定める日（以下「祝日取引実施日」という。）の連続する日数及び指定市場開設者が祝日取引実施日において取引を行う先物・オプション取引に係る清算資格に応じて当社が定める割合とする。	（新設）
（金銭の取扱い） 第２条の４　（略）	（金銭の取扱い） 第２条の３　（略）
（日中清算値段、日中清算数値及び日中清算価格に関する準用等） 第２条の５　（略）	（日中清算値段、日中清算数値及び日中清算価格に関する準用等） 第２条の４　（略）
付　　則 １　この改正規定は、令和４年９月２１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４年９月２１日以後の当社が定める日から施行する。	

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
（委託者等の証拠金所要額） 第５条　前条の規定は、次項に定める場合を除き、委託者、取次委託者、清算取次委託者及び清算取次者に対する委託者（以下「委託者等」という。）の証拠金所要額（第１２条の２第４項の規定により委託者等が事前割増額の預託を行う場合においては、当該事前割増額のうち当該委託者等に係る額を加算する。以下同じ。）について準用する。この場合において、「自己分の取引証拠金所要額」とあるのは「委託者等の証拠金所要額」と、「自己分のＳＰＡＮ証拠金額」とあるのは「委託者等のＳＰＡＮ証拠金額」と、「自己分の取引受渡証拠金」とあるのは「委託者等の取引受渡証拠金」と、「第８条第１項及び第９条第１項」とあるのは「第８条第２項」と、「取引参加者の自己の計算による」とあるのは「当該委託者等の委託に基づく」と読み替えるものとする。	（委託者等の証拠金所要額） 第５条　前条の規定は、次項に定める場合を除き、委託者、取次委託者、清算取次委託者及び清算取次者に対する委託者（以下「委託者等」という。）の証拠金所要額について準用する。この場合において、「自己分の取引証拠金所要額」とあるのは「委託者等の証拠金所要額」と、「自己分のＳＰＡＮ証拠金額」とあるのは「委託者等のＳＰＡＮ証拠金額」と、「自己分の取引受渡証拠金」とあるのは「委託者等の取引受渡証拠金」と、「第８条第１項及び第９条第１項」とあるのは「第８条第２項」と、「取引参加者の自己の計算による」とあるのは「当該委託者等の委託に基づく」と読み替えるものとする。
２　（略）	２　（略）
（自己分の取引証拠金の預託） 第１２条　清算参加者は、自己の計算による先物取引の売付け若しくは買付けが成立した場合又は受渡しにより決済を行う場合は、第４条に規定する取引参加者の自己分の取引証拠金所要額（商品取引債務引受業に関する業務方法書第１９条第４項に規定する届出を行った清算参加者にあっては当該取引証拠金所要額に次条に規定する取引証拠金の事前割増額を加えた額）以上の額の取引証拠金を、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。この場合において、当該取引証拠金は、充用有価証券等をもって預託することができる。	（自己分の取引証拠金の預託） 第１２条　清算参加者は、自己の計算による先物取引の売付け若しくは買付けが成立した場合又は受渡しにより決済を行う場合は、第４条に規定する自己分の取引証拠金所要額以上の額の取引証拠金を、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。この場合において、当該取引証拠金は、充用有価証券等をもって預託することができる。
（取引証拠金の事前割増額） 第１２条の２　取引証拠金の事前割増額は、指定市場開設者が休業日において立会を行う日として定める日（以下「祝日取引実施日」という。）から起算して３日前（祝日取引実施日でない休業日を除く。ただし、祝日取引実施日が連続する休業日に設定される場合（当該連続する休業日の間に祝日取引実施日でない休業日がある場合を含む。以下「連続する祝日取引実施日」とい	（新設）

う。）には、当該連続する祝日取引実施日の初日から起算するものとする。）における清算参加者の区分口座で管理される建玉のうち、指定市場開設者が休業日において立会を行う先物・オプション取引に係る建玉について、ＳＰＡＮにより計算した証拠金額に当社が定める割合を乗じて得た額を、当該清算参加者のすべての区分口座について合計した額をいう。

２　前項の規定にかかわらず、商品取引債務引受業に関する業務方法書第１９条第４項に定める届出を行った清算参加者が同第５３条第２号、第３号又は第５４条第２号に規定する一の区分口座で管理する建玉に係る委託者等について、当社が定めるところにより当該委託者等が祝日取引実施日における取引を行わないことを理由に当該委託者等を管理する区分口座を取引証拠金の事前割額の計算の適用外とすることを希望する旨の申請を行った場合において、当社が当該申請を承認したときは、当社は当該区分口座を前項の事前割増額の算出から除外することができる。

３　第１項の規定にかかわらず、清算参加者は、事前割増額の起因となった一の委託者等との間で、事前割増額のうち当該委託者等に起因する額として当社が定める額に限り、当該委託者等の金銭をもって預託することを合意することができる。

４　清算参加者は、前項の規定により、委託者等との間で合意した場合において、当社が定めるところによりその旨の申請を行い、当社が当該申請を承認した場合には、当該委託者等に係る区分口座に係る事前割増額について、当該委託者等の取引証拠金として、当社が定めるところにより、当社に預託することができる。この場合において、当該取引証拠金は、充用有価証券等をもって預託することができる。

（日中取引証拠金所要額）

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及び第１２条の

（日中取引証拠金所要額）

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

２第１項に定める事前割増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）～（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及び第１２条の２第１項に定める事前割増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）～（３）　（略） 付　則 この改正規定は、令和４年９月２１日から施行する。	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）～（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）～（３）　（略）

商品取引債務引受業に関する業務方法書の取扱いの一部改正新旧対照表

新	旧
（措置の対象とする取引証拠金） 第１０条　業務方法書第３２条第１項に規定する当社が定める取引証拠金は、商品取引債務引受業に係る取引証拠金等に関する規則第１２条の２第１項（同条第３項によるもののうち業務方法書第５３条第２号及び第５４条第２号に規定する区分口座に係るものを除く。）及び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２２条第２号に掲げる取引証拠金とする。	（措置の対象とする取引証拠金） 第１０条　業務方法書第３２条第１項に規定する当社が定める取引証拠金は、商品取引債務引受業に係る取引証拠金等に関する規則第２２条第２号に掲げる取引証拠金とする。
２　業務方法書第３２条第２項に規定する当社が定める取引証拠金は、商品取引債務引受業に係る取引証拠金等に関する規則第１２条の２第１項（同条第３項によるもののうち業務方法書第５３条第２号及び第５４条第２号に規定する区分口座に係るものを除く。）並びに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２２条第２号、第５号及び第９号に掲げる取引証拠金とする。	２　業務方法書第３２条第２項に規定する当社が定める取引証拠金は、商品取引債務引受業に係る取引証拠金等に関する規則第２２条第２号、第５号及び第９号に掲げる取引証拠金とする。
（連続する祝日取引実施日における指標の算出方法等） 第１１条の２　業務方法書第３３条の２第１項に定める当社が定める指標は、商品取引債務引受業に係る取引証拠金等に関する規則第３０条第２項に規定する通常市場環境下リスク相当額通算額を、清算参加者の自己分の取引証拠金預託額及び清算基金預託額の合計額で除して算出する。 ２　業務方法書第３３条の２第１項第１号に定める当社が定める判定時刻は１６時、同項第２号に定める当社が期限として定める時刻は１１時とする。 ３　業務方法書第３３条の２第２項に定める当社が別に定める値は１とする。 ４　業務方法書第３３条の２第３項に定める当社が定める金額は、業務方法書第８１条第４項に規定する第三者による損失補償により受領する金銭のうち祝日取引実施日における決済不履行の損失の補填を目的としたものとする。	（新設）
付　　則 この改正規定は、令和４年９月２１日から施行する。	

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）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	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）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（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。	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。
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（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。）を合算した額をいう。）の平均額をいう。	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　（略）	c　（略）
２．・３．　（略）	２．・３．　（略）
付　則 この改正規定は、令和４年９月２１日から施行する。	

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取扱いの一部改正新旧対照表

新	旧
（取引証拠金の事前割増額の取扱い） 第４条の２　取引証拠金規則第１２条の２第１項に規定する取引証拠金の事前割増額の算出に用いる当社が定める割合は、指定市場開設者が休業日において立会を行う日として定める日（以下「祝日取引実施日」という。）の連続する日数及び指定市場開設者が祝日取引実施日において取引を行う先物・オプション取引に係る清算資格に応じて当社が定める割合とする。 付　　則 この改正規定は、令和４年９月２１日から施行する。	（新設）