

特定会員による商品市場における取引及び商品関連市場デリバティブ取引に係る証拠金等の一体管理に関する細則

(特定会員による証拠金等の一体管理)

第1条 特定会員（金融商品取引法の一部を改正する法律（平成24年法律第86号。以下「金融商品取引法改正法」という。）附則第4条に定める特定会員をいう。以下同じ。）である受託取引参加者（株式会社日本証券クリアリング機構（以下「クリアリング機構」という。）の清算参加者である受託取引参加者に限る。）は、本所の開設する商品市場における取引に係る口座及び株式会社大阪取引所の開設する取引所金融商品市場における商品関連市場デリバティブ取引（金融商品取引法第2条第8項第1号に定める取引をいう。以下同じ。）に係る口座（以下「先物・オプション取引口座」という。）を設定した委託者を対象に、証拠金等の一体管理（商品市場における取引に係る口座及び先物・オプション取引口座（商品関連市場デリバティブ取引以外の取引が行われないよう適切な措置が講じられている口座に限る。）を設定した委託者が、特定会員である受託取引参加者に預託する証拠金等に関し、以下の各号に掲げる取扱いを行うことをいう。以下同じ。）を行うことができる。

- (1) 当該委託者から当該特定会員である受託取引参加者が証拠金（金銭並びに商品市場における取引に係る取引証拠金の充用有価証券及び商品関連市場デリバティブ取引に係る取引証拠金の代用有価証券の双方に利用可能な有価証券に限る。）の預託を受ける際には、全て商品関連市場デリバティブ取引分の委託証拠金として預託を受けること。
- (2) 当該特定会員である受託取引参加者は、当該委託者から預託を受けた前号の委託証拠金の額以上の取引証拠金を、クリアリング機構における商品市場における取引に係る区分口座（以下「商品先物取引法下の取引証拠金口座」という。）及び商品関連市場デリバティブ取引に係る区分口座（以下「金融商品取引法下の取引証拠金口座」という。）に預託すること。この場合において、各口座の預託額はクリアリング機構の定める取引証拠金所要額以上の額とし、その預託先に係る配分は当該特定会員である受託取引参加者が相当と認める割合において行うこと。
- (3) 当該特定会員である受託取引参加者は、クリアリング機構の商品先物取引法下の取引証拠金口座又は金融商品取引法下の取引証拠金口座の預託額がクリアリング機構の定める取引証拠金所要額を上回る場合、当該上回る額を限度に他方の口座に振り替えることができるものとする。
- (4) 当該特定会員である受託取引参加者は、証拠金等の一体管理の対象とする口座における商品市場における取引及び商品関連市場デリバティブ取引の値洗損益及び売買損益を通算して管理し、当該通算した損益額については、クリアリング機構の商品先物取引法下の取引証拠金口座及び金融商品取引法下の取引証拠金口座にて

取引証拠金として管理すること。

- (5) 当該特定会員である受託取引参加者は、当該委託者の商品市場における取引又は商品関連市場デリバティブ取引に係る証拠金額のいずれかに不足（現金不足額を含む。）が生じた場合において、他方の口座において証拠金額に余剰がある場合、当該余剰分の証拠金（現金不足額の場合には現金に限る。）の額を限度に当該不足額に充当すること。
- (6) 当該特定会員である受託取引参加者は、証拠金等の一体管理の対象とする口座における証拠金の過不足計算（現金不足額に係る計算を含む。次号において同じ。）を行う場合は、商品市場における取引及び商品関連市場デリバティブ取引に係る値洗損益及び売買損益を通算して行うこと。
- (7) 当該特定会員である受託取引参加者は、前号の過不足計算の結果、証拠金の不足額（現金不足額を含む。）が発生した場合で、当該委託者が当該不足額を所定の日時までに預託しないときは、商品市場における取引及び商品関連市場デリバティブ取引に係る建玉を当該委託者の計算で処分することができるものとする。
- (8) 当該特定会員である受託取引参加者は、当該委託者に係る証拠金の余剰分の返還を行う場合は、クリアリング機構の商品先物取引法下の取引証拠金口座又は金融商品取引法下の取引証拠金口座から取引証拠金の返戻を受けるとし、その返戻元に係る配分は当該特定会員である受託取引参加者が相当と認める割合において行うこと。

（特約の締結）

第2条 証拠金等の一体管理を特定会員である受託取引参加者が行う場合、当該受託取引参加者は証拠金等の一体管理の対象とする委託者との間で当該証拠金等の一体管理に係る特約を書面又は電磁的方法（電子情報処理組織を使用する方法その他の情報通信の技術を利用する方法であって商品先物取引法施行規則第41条第3項に定める方法と同様の方法をいう。）にて締結しなければならない。

（管理態勢の整備）

第3条 証拠金等の一体管理を行う受託取引参加者は、証拠金等の一体管理を行うための適切な管理態勢を整備しなければならない。

（取次者への適用）

第4条 受託取引参加者の委託者が取次者（特定会員に限る。）として取次委託者の預託する証拠金に関し第1条に定める証拠金等の一体管理を行おうとする場合には、当該受託取引参加者は当該取次者との間で当該取次者がこの細則の規定に準じて取次委託者の証拠金等を管理する旨を確約させるとともに、当該取次者が適切に証拠金等

の一体管理を行うために必要な管理態勢を整備しなければならない。

- 2 前項に規定する当該取次者は、第1条各号及び第2条並びに前条の「受託取引参加者」とあるのを「取次者」と、「委託者」とあるのを「取次委託者」と読み替え、委託証拠金の額以上の取引証拠金をクリアリング機構に預託し管理することについては、当該取次者の委託を受ける受託取引参加者との関係において、委託の取次ぎを処理するものとする。

(改廃)

第5条 この細則の改廃は、代表取締役社長の決裁をもって行う。

附則

本細則は、2020年7月27日に施行する。