

店頭商品デリバティブ取引等清算業務に 関する清算値段取扱要綱

(目的)

第1条 この店頭商品デリバティブ取引等清算業務に関する清算値段取扱要綱（以下「本要綱」という。）は、店頭商品デリバティブ取引等清算業務に関する業務方法書第2条第30号及び第31号の規定に基づき、清算値段及び最終清算値段の決定に関し必要な事項を定めることを目的とする。

(清算値段の決定)

第2条 RIMスワップ取引に係る清算値段については、次の各号に掲げる区分に応じ、当該各号に定めるとおりとする。

(1) RIMスワップ取引（東京湾）の各商品の当月限

リム情報開発株式会社が発行する「RIM JAPAN PRODUCTS INTELLIGENCE DAILY」（以下「リムレポート」という。）における「国内石油製品海上バージスポット市場（製油所・油槽所バージ取り・円/k1）東京湾（京浜/千葉）」の「固定値」の高値と安値の平均値（以下「中値」という。）の月間平均値（10円未満四捨五入）とする。ただし、当該月間平均値を算出する場合の翌日以降の中値は、当日の中値相当額を採用して算出するものとする。

(2) RIMスワップ取引（東京湾）の各商品の当月限以外の限月

リムレポートにおける「国内石油製品ペーパースワップアセスメント（東京湾製油所バージ取り・円/k1）東京湾（京浜/千葉）」の各限月のアセスメントの当日の中値とする。

(3) RIMスワップ取引（西日本）の各商品の当月限

リムレポートにおける「国内石油製品海上バージスポット市場（製油所・油槽所バージ取り・円/k1）西日本（阪神/大西）」の「固定値」の中値の月間平均値（10円未満四捨五入）とする。ただし、当該月間平均値を算出する場合の翌日以降の中値は、当日の中値相当額を採用して算出するものとする。

(4) RIMスワップ取引（西日本）の各商品の当月限以外の限月

リムレポートにおける「国内石油製品ペーパースワップアセスメント（東京湾製油所バージ取り・円/k1）東京湾（京浜/千葉）」の各限月のアセスメントの当日の中値とする。

2 TOCOMスワップ取引に係る清算値段については、次の各号に掲げる区

分に応じ、当該各号に定めるとおりとする。

(1) TOCOMスワップ取引の原油を除く各商品の当月限

株式会社東京商品取引所の各商品の当月限の帳入値段の月間平均値（月初から株式会社東京商品取引所が業務規程において定める当該商品の納会日までの平均値段とする。10円未満四捨五入。）とする。ただし、当該月間平均値を算出する場合は翌日以降の帳入値段は、当日の帳入値段相当額を採用して算出するものとする。

(2) TOCOMスワップ取引の原油を除く各商品の当月限以外の限月

株式会社東京商品取引所の各商品、各限月の当日の帳入値段と同額とする。

(3) TOCOMスワップ取引の原油の各限月

株式会社東京商品取引所の原油の各限月の当日の帳入値段と同額とする。

(最終清算値段の決定)

第3条 RIMスワップ取引及びTOCOMスワップ取引に係る最終清算値段は、取引最終日（業務方法書第4条第4項に規定する債務引受けの最終申込日をいう。以下本要綱において同じ。）において、前項の規定に基づき算出される清算値段相当額とする。

(清算値段等の訂正等)

第4条 当社は、前2条の清算値段及び最終清算値段（以下「清算値段等」という。）について、リム情報開発株式会社又は株式会社東京商品取引所より第2項の「固定値」等の訂正があった場合は、原則として、次の各号に定めるところにより訂正することができるものとする。

(1) 取引最終日が到来していない清算約定について、当社が毎営業日において行う変動証拠金のOTC清算参加者への通知を行った後に「固定値」等の訂正が行われた場合は、当該訂正が行われた営業日から直近の変動証拠金の算出時に清算値段を訂正するものとする。

(2) 取引最終日が到来した清算約定について、「固定値」等の訂正が行われた場合は、清算値段等を適宜訂正するものとする。

2 当社は、前2条及び前項の規定にかかわらず、これらの規定に基づき算出される清算値段等が適切でないとき、当社が当該清算値段等を定めることができるものとする。

(清算値段等の通知)

第5条 当社は、前3条の規定に基づき清算値段等の決定又は訂正を行ったときは、速やかにOTC清算参加者にその旨を通知するものとする。

(本要綱の改廃)

第6条 本要綱の改廃は、代表取締役社長の決裁をもって行うものとする。

附 則

本要綱は、平成26年5月16日から実施する。