

証拠金所要額の計算等に係る異常時対応について

平成 28 年 9 月 20 日

株式会社日本商品清算機構

項目	異常時対応（トランスファ処理を行う場合を除く。）
<p>1. SPAN リスク・パラメータ・ファイルについて</p> <p>(1) SPAN リスク・パラメータ・ファイル（アーリーファイル）を定刻までに作成できない場合又は作成できない見込みとなった場合</p> <p>(2) SPAN リスク・パラメータ・ファイル（アーリーファイル）に誤りがあった場合</p> <p>(3) SPAN リスク・パラメータ・ファイル（ファイナルファイル）を定刻までに作成できない場合又は作成できない見込みとなった場合</p> <p>(4) SPAN リスク・パラメータ・ファイル（ファイナルファイル）に誤りがあった場合</p>	<p>・当社は、一計算区域が終了する日（以下「当日」という。）の SPAN リスク・パラメータ・ファイル（アーリーファイル）について、取引所からの価格情報の受信遅延等により、当日の 17 時 00 分頃までに作成できない場合又は作成できない見込みとなった場合は、当該取引所の前営業日の価格情報をもって当日分の当該ファイルを作成するものとし、その旨を清算参加者に通知するものとする。</p> <p>・当日の 17 時 30 分頃までに、SPAN リスク・パラメータ・ファイル（アーリーファイル）に誤りがあることが判明した場合、当社は、原則として、18 時 00 分までに SPAN リスク・パラメータ・ファイル（アーリーファイル）の再作成を実施するものとし、その旨を清算参加者に通知するものとする。</p> <p>①当社は、取引所からの価格情報又は建玉情報の受信遅延等により、当日の SPAN リスク・パラメータ・ファイル（ファイナルファイル）について、当日の 17 時 00 分頃までに作成できない場合又は作成できない見込みとなった場合は、その旨を清算参加者に通知するものとする。</p> <p>②この場合、当社は、当日の SPAN リスク・パラメータ・ファイル（アーリーファイル）又は前営業日の SPAN リスク・パラメータ・ファイル（ファイナルファイル）のいずれかをもって、当日の SPAN リスク・パラメータ・ファイル（ファイナルファイル）として作成するものとし、当社ホームページに掲載するものとする。</p> <p>③当社は、当日の清算参加者の自己分の証拠金所要額の計算にあたっては、上記②において当日分として作成した SPAN リスク・パラメータ・ファイル（ファイナルファイル）を使用するものとする。</p> <p>・当日の 17 時 30 分頃までに、SPAN リスク・パラメータ・ファイル（ファイナルファイル）に誤りがあることが判明した場合、当社は、原則として、18 時 00 分までに SPAN リスク・パラメータ・ファイル（ファイナルファイル）の再作成を実施するものとし、その旨を清算参加者に通知するものとする。</p>

項目	異常時対応（トランスファ処理を行う場合を除く。）
<p>(5) SPAN リスク・パラメータ・ファイル（ファイナルファイル）の取扱い</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・清算参加者は、当社が作成した当日の SPAN リスク・パラメータ・ファイル（ファイナルファイル）について異議を申し立てることはできない。
<p>2. 自己分の証拠金所要額について</p>	
<p>(1) JCCH システムで通知できない場合</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・当社は、JCCH システムにより自己分の証拠金所要額を通知できない場合又は通知できない見込みとなった場合は、その旨を清算参加者に通知するものとする。
<p>(2) 当社が清算参加者の自己分の証拠金所要額を計算できない場合又は計算できない見込みとなった場合</p>	<p>①当社は、取引所からの価格情報又は建玉情報の受信遅延等により、当日の 18 時 00 分頃までに、清算参加者の自己分の証拠金所要額を計算できない場合又は計算できない見込みとなった場合は、原則として、前営業日の自己分の証拠金所要額を当日の自己分の証拠金所要額として適用するものとし、その旨を清算参加者に通知するものとする。</p> <p>②ただし、清算参加者が自己分の証拠金所要額を正しく計算できる場合で、当社が適当と認める場合にあつては、清算参加者が計算した額を当日の自己分の証拠金所要額として適用することができるものとする。</p>
<p>3. 委託分の証拠金所要額について</p>	
<p>(1) 清算参加者が委託分の証拠金所要額を計算できない場合又は計算できない見込みとなった場合</p>	<p>①清算参加者は、当日の 19 時 00 分までに委託分の証拠金所要額を計算できない場合又は計算できない見込みとなった場合にあつては、速やかに、当社に連絡するものとする。</p> <p>②この場合において、清算参加者は、前営業日の委託分の証拠金所要額を当日の委託分の証拠金所要額として適用することができるものとする。</p>
<p>4. その他</p>	
<p>(1) SPAN 計算に関する JCCH システム等に障害が発生した場合</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・当社は、SPAN 計算に関する JCCH システム等に障害が発生した場合にあつては、適宜、清算参加者に通知するものとする。