

証拠金所要額の計算等に係る異常時対応要領

平成 23 年 1 月 14 日

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 リスクパラメーターファイルについて</p> <p>(1) SPAN リスクパラメーターファイル（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 リスクパラメーターファイル（アーリーファイル）に誤りがあった場合</p> <p>(3) SPAN リスクパラメーターファイル（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>① 当社は、一計算区域が終了する日（以下「当日」という。）の SPAN リスクパラメーターファイル（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 16 時 30 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（FAX）するものとする。</p> <p>① 当社は、当社が作成した SPAN リスクパラメーターファイル（アーリーファイル）に誤りがあった場合は、その内容を清算参加者に通知（FAX）するものとする。</p> <p>② SPAN リスクパラメーターファイル（アーリーファイル）の再作成は行わないものとする。</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 リスクパラメーターファイル（ファイナルファイル）について、当日の 17 時 30 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（FAX）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>(4) SPAN リスクパラメーターファイル（ファイナルファイル）の取扱い</p> <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> <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>② この場合、当社は、当日の SPAN リスクパラメーターファイル（アーリーファイル）又は前日の SPAN リスクパラメーターファイル（ファイナルファイル）のいずれかをもって、当日の SPAN リスクパラメーターファイル（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 また、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 リスクパラメーターファイル（ファイナルファイル）を使用するものとする。</p> <p>① 清算参加者は、当社が作成した当日の SPAN リスクパラメーターファイル（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> <p>① 当社は、JCCH システムにて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（FAX）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 18 時頃までに、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（FAX）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において、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>

項目	異常時対応（トランスファ処理を行う場合を除く。）
<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>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>	<p>① 清算参加者は、当日の 19 時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>① 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 (FAX) するものとする。</p>