



プレスリリース

平成21年12月1日

各 位

株式会社 日本商品清算機構

弊社取締役会における決議事項について

本日開催した弊社取締役会において、下記の議案について原案のとおり承認されました。ここにその概要をお知らせいたします。

記

1. 業務方法書の改正について

先般、上場廃止となった中部大阪商品取引所・鉄スクラップ市場の当社債務引受対象（指定商品市場）からの削除、東京穀物商品取引所の組織変更（株式会社化）に伴う名称変更等からなる業務方法書の改正を決議しました。

2. 「信用リスク管理基本方針」の策定について

当社は、「信用リスク管理基本方針」を策定しました。（別紙参照）

3. 総務委員会の後任委員の選任の件

委員の辞任に伴いまして、総務委員会の後任委員として河合成治氏を新たに選任いたしました。

なお、任期は、前任者の残任期間となります。

（参考 委員会委員）

総務委員会

先崎和彦	委員長
畑野敬司	副委員長
秋田 治	委員
岡田 通	委員
河合成治	委員（新任）
庄司國男	委員

以 上

本件に関するお問合せ先
株式会社 日本商品清算機構
(問合せ先 03 - 5847 - 7521)

株式会社日本商品清算機構

「信用リスク管理基本方針」の策定について

1. 「信用リスク管理基本方針」の骨子

①目的

清算参加者間のカウンターパーティリスクの遮断

②原則

- ・個別清算参加者の債務不履行の発生を回避するための「デフォルトリスク管理」と、J C C Hが曝されている全体の信用リスクを計測・管理するための「J C C H信用リスク管理」とを当社の信用リスク管理の両輪とする。
- ・「J C C H信用リスク管理」の中心的な管理指標として“信用V a R”を採用。

信用V a R (Credit Value at Risk) とは、J C C Hが被りうる想定最大損失額のことであり、個別の清算参加者がデフォルトに陥った場合の想定損失額を元に、ある一定の確率においてJ C C Hが被りうる最大損失額を統計学的シミュレーションを用いて算出する。

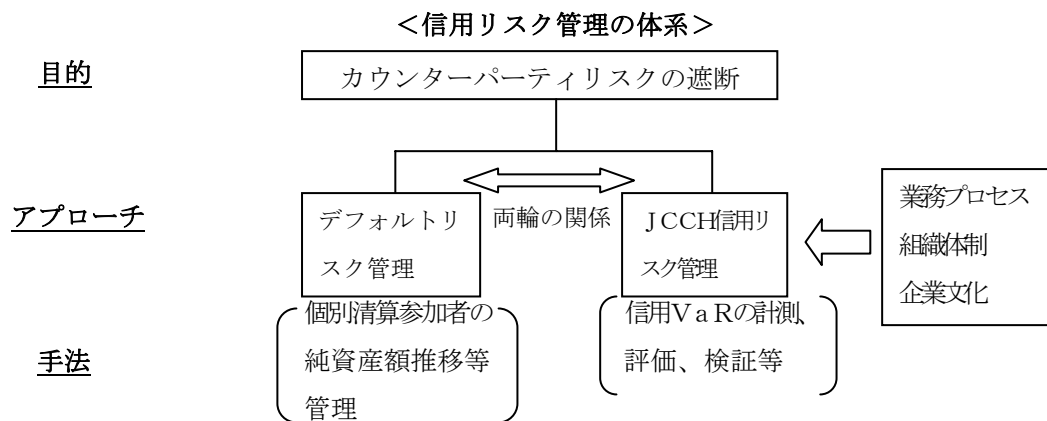
損失の金額とその発生確率とを関連づけ、「99%の確率では、損失はX円以下に収まる。」といった捉え方をする。

③組織と権限

- ・リスク管理のための専任的組織と社内牽制体制の構築。
- ・信用リスク管理に関する重要事項は取締役会に適宜報告。

④管理業務

- ・個別の清算参加者からの財務状況等の報告、監査。
- ・信用V a Rの日次算出を行い、リスクエクスポージャーの管理を実施。



2. 今後の取組みについて

当面、保守的な立場にたったリスク計測をベースとしてリスク管理業務を継続しつつ、より精度の高いリスク計測手法の確立に向けた改善を並行して実施してまいります。