

2015年11月16日

株式会社日本証券クリアリング機構

株式会社大阪取引所による新商品の追加に伴う  
SPAN リスク・パラメーター・ファイルの設定変更について

平素は、当社の清算・決済業務の運営に格別の御高配を賜り、厚く御礼申し上げます。

さて、2016年7月央を目途に株式会社大阪取引所にて予定されている、デリバティブ取引に係る新商品の追加<sup>1</sup>に伴う所要の準備作業を進めておりますが、本件に関し、皆様の今後の準備等に係る検討の御参考資料として、現在検討中の内容を前提とした SPAN リスク・パラメーター・ファイル（以下「RPF」といいます。）に係る設定変更の概要を別紙のとおり御通知申し上げます。

なお、本通知における記載内容については、現時点で検討中のものであり、今後、変更の可能性がございますことを念のために申し添えます。

《本通知の別紙資料》

- 【別紙】 新商品追加に伴う SPANRPF における設定変更の概要
- 【参考資料1】 新商品追加版 SPANRPF サンプルファイル
- 【参考資料2】 サンプルファイルの SPAN パラメーター一覧
- 【参考資料3】 サンプルファイルの SPAN パラメーターを用いた計算例

以上

【本通知に係るお問い合わせ先・連絡先】

<業務運用面・制度面でのお問い合わせ>

(株) 日本証券クリアリング機構 取引所取引清算グループ

TEL : 03-3665-1381 FAX : 03-3666-0971 MAIL : dailybiz@jscc.co.jp

<RPF の仕様等のシステム面でのお問い合わせ>

(株) 東京証券取引所 IT 開発部清算システム担当

TEL : 050-3377-7735、050-3377-7736 MAIL : clear-sys@jpx.co.jp

<sup>1</sup>商品の詳細については、JPX ホームページを参照

(参照先 URL : <http://www.jpx.co.jp/rules-participants/public-comment/index.html>)