

平成26年10月10日

株式会社日本証券クリアリング機構

SPANリスク・パラメーター・ファイルを取得の皆様へ
～11月25日の清算システム機能統合に伴うSPANパラメーターの取扱いについて～

平素は当社清算・決済業務の運営に格別の御高配を賜り、厚くお礼申し上げます。

さて、当社は、本年11月25日(火)に株式会社大阪取引所の清算システム機能を当社清算システムへ統合することに伴い、取引証拠金算出にあたって設定が必要となるSPANパラメーターの取扱いを一部改定いたします(※)ので、別紙のとおり御周知申し上げます。

(※) 今回の改定内容は本年11月25日に上場予定のJPX日経インデックス400先物取引のためのパラメーターの設定方法を新たに追加するものです。

なお、改定後の「SPANパラメーターの取扱い」については、11月17日に当社が算出・公表するSPANパラメーターから適用する(11月25日配信分のSPANリスク・パラメーター・ファイルから当該パラメーターを反映する)ことといたします。

以上

【本通知に係るお問い合わせ先・連絡先】

(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