

証拠金所要額計算に係るコンティンジェンシー・プランについて

平成 16 年 2 月 2 日改正
株式会社日本証券クリアリング機構

項 目	具体的対応	備 考
1 . 通常取引証拠金	<div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-bottom: 10px;"> (1) クリアリング 機構が当日の S P A N リスク・パラメーター・ファイルを 16 時 30 分までに作成できない場合 </div> <ul style="list-style-type: none"> ・ 前日の S P A N リスク・パラメーター・ファイルを使用して証拠金計算を行う。 ・ この場合、クリアリング 機構から下記の内容を F A X により清算参加者に連絡する。 <ul style="list-style-type: none"> □ 16 時時点で当日の S P A N リスク・パラメーター・ファイルの作成が完了していない場合、その旨を 16 時過ぎに連絡。 □ その後、16 時 30 分までに当日の S P A N リスク・パラメーター・ファイルが作成できた場合は、直ちに当該ファイルを東証 W A N 等にアップロードするとともに、当日の証拠金所要額の計算において当該ファイルを使用する旨を連絡。 □ 一方、16 時 30 分までに当日の S P A N リスク・パラメーター・ファイルが作成できなかった場合は、当日の証拠金所要額の計算において前日の S P A N リスク・パラメーター・ファイルを使用する旨を 16 時 30 分過ぎに連絡。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 他社清算参加者は自らを指定清算参加者とする非清算参加者に連絡する。

項 目	具体的対応	備 考
<div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> (2) S P A N リ ス ク ・ パ ラ メ ー タ ー ・ フ ァ イ ル は あ る が 証 拠 金 所 要 額 の 計 算 が で き な い 場 合 </div>		
<p>a クリアリング機構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</p> <p>b 非清算参加者が自己分の証拠金所要額を計算できない場合</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・ 原則として、前日の証拠金所要額を適用する。ただし、清算参加者が証拠金所要額を正しく計算できるときなどクリアリング機構が適当と認める場合には、あらかじめクリアリング機構に連絡した上で、清算参加者が計算した額を当日の証拠金所要額として適用することができる。 ・ クリアリング機構からは下記の内容を F A X により清算参加者に連絡。 <ul style="list-style-type: none"> □ 18 時時点でクリアリング機構が当日の自己分の証拠金所要額計算が完了していないときには、その旨を 18 時過ぎに連絡。 □ その後、18 時 30 分までに自己分の証拠金所要額計算ができた場合には、直ちに当該証拠金所要額ファイルを東証 W A N にアップロードするとともに、アップロードした旨を連絡。 □ 一方、18 時 30 分までに自己分の証拠金所要額計算ができなかった場合には、前日の証拠金所要額を適用する旨を 18 時 30 分過ぎに連絡。 ・ 前日の証拠金所要額を適用するため、清算参加者に対しては前日の所要額を申告する。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 清算参加者が計算した額を当該清算参加者自己分の証拠金所要額とする場合は、18 時 45 分までにその額をクリアリング機構に F A X により申告する。

項 目	具体的対応	備 考
c 清算参加者又は非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	<ul style="list-style-type: none"> 原則として、前日の証拠金所要額を適用する。ただし、顧客が証拠金所要額を正しく計算できるときなど清算参加者又は非清算参加者が適当と認める場合には、顧客が申告した額を当日の証拠金所要額として適用することができる。 	
(3) 清算参加者が証拠金所要額を時限までにクリアング 機構に申告できない場合		
	<ul style="list-style-type: none"> 状況を勘案しながら個別に対応する。この場合、清算参加者はあらかじめ時限までに申告できない旨をクリアング 機構 (03-3665-1381) に連絡する。 	
(4) 証拠金所要額の計算結果に誤りがある場合又は誤りがあるおそれが強い場合		
a 清算参加者の自己分の証拠金所要額	<ul style="list-style-type: none"> 証拠金所要額の計算結果に誤りがある場合又は誤りがあるおそれが強い場合には、クリアング 機構から清算参加者に対して 18 時 30 分までに F A X によりその旨を連絡する。 その後、クリアング 機構が清算参加者に通知した自己分の証拠金所要額について、当日の 19 時まで正しい額を再通知できる場合、当該再通知した証拠金所要額を適用する。なお、再通知したときには、クリアング 機構から速やかに再通知した旨を F A X により清算参加者に連絡する。 一方、当日の 19 時まで正しい額を再通知できない場合には、原則として、当初クリアング 機構が清算参加者に通知した額を証拠金所要額として適用する。ただし、あらかじめクリアング 機構に連 	

項 目	具体的対応	備 考
<p>b 委託分の証拠金所要額</p>	<p>絡した上で、以下に掲げるいずれかの方法により清算参加者が計算した額を当日の証拠金所要額として適用することができる。</p> <p>前日のSPANリスク・パラメーター・ファイルを使って計算した額 前日の証拠金所要額</p> <p>クリアリング機構が自己分の建玉を正しく把握していないことが明らかな場合で、清算参加者が建玉を正しく把握し、証拠金所要額を正しく計算できるときには、清算参加者が計算した当該額</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 清算参加者が上記に基づいて計算した額を証拠金所要額とする場合には、19時15分までにクリアリング機構にFAX（03-3666-0971）により当該証拠金所要額を申告する。 ・ 委託分については、原則として、清算参加者又は非清算参加者が顧客に通知した額を証拠金所要額として適用する。ただし、清算参加者又は非清算参加者が適当と認める場合には、以下に掲げるいずれかの額を当日の証拠金所要額として適用することができる。 <p>前日のSPANリスク・パラメーター・ファイルを使って計算した額 前日の証拠金所要額</p>	

項 目	具体的対応	備 考
(5) 東証W A Nの全部又は一部に障害が発生している場合		
a S P A Nリスク・パラメーター・ファイルが取得できない場合 b 清算参加者からクリアリング機構への証拠金所要額の申告が行えない場合 c 自己分の証拠金所要額の確認ができない場合	<ul style="list-style-type: none"> ・ 当日のS P A Nリスク・パラメーター・ファイルを東証W A N、クリアリング機構ホームページその他の手段により取得することができない場合は、前日のS P A Nリスク・パラメーター・ファイルを使用することができる。ただし、前日のファイルを使用して計算できる証拠金所要額は清算参加者の委託分及び非清算参加者分についてのみとし、清算参加者の自己分については、クリアリング機構が計算した額を適用する。 ・ 東証W A Nを利用できる清算参加者は、東証W A Nを利用して行う。東証W A Nを利用できない清算参加者については、F A X (03-3666-0971) により報告する。 ・ 清算参加者の自己分の証拠金所要額は「取引証拠金 差入・返戻可能表」で確認する。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 東証W A N障害の場合は、クリアリング機構からF A Xにより、左記の対応方をその都度連絡する。(他社清算参加者は非清算参加者に連絡する。)

項目	対応	備考
2 . 緊急取引証拠金		
	<p data-bbox="248 363 1637 435">(1) クリアリング 機構が緊急取引証拠金所要額を計算できない場合</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 前日の清算参加者自己分の証拠金所要額以上の額を預託する。 ・ この場合、クリアリング 機構から下記の内容を FAX により清算参加者に連絡する。 <ul style="list-style-type: none"> □ 12 時 30 分時点で緊急取引証拠金所要額計算が完了していないときには、その旨を 12 時 30 分過ぎに連絡。 □ その後、13 時までには緊急取引証拠金所要額が計算できた場合には、直ちに当該ファイルを東証 W A N にアップロードするとともに、アップロードした旨を連絡。 □ 一方、13 時までには緊急取引証拠金所要額が計算できなかった場合には、前日の清算参加者自己分の証拠金所要額以上の額を預託していただく旨を 13 時過ぎに連絡。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 事実上、追加預託は発生しないこととなる。
	<p data-bbox="248 1013 1637 1134">(2) クリアリング 機構が通知した緊急取引証拠金所要額に誤りがある又は誤りがあるおそれが強い場合</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 当日の 13 時までには正しい緊急取引証拠金所要額を再通知できる場合には、当該再通知した証拠金所要額を適用する。なお、再通知したときには、クリアリング 機構から清算参加者に対して再通知後速やかに F A X により連絡する。 	

項目	対応	備考
	<ul style="list-style-type: none"> 一方、当日の13時までに正しい緊急取引証拠金所要額を再通知できない場合には、前日の自己分の証拠金所要額を緊急取引証拠金所要額として適用する。なお、このときには、クリアリング機構から清算参加者に対して13時過ぎにFAXにより連絡する。 	<ul style="list-style-type: none"> 事実上、追加預託は発生しないことになる。
(3) 東証WAN障害の場合		
	<ul style="list-style-type: none"> 取引証拠金の預託が不足している清算参加者に対してのみ、FAXにより当該不足額を連絡する。この場合、クリアリング機構から清算参加者に対してあらかじめFAXにより連絡する。 <p style="text-align: right;">以上</p>	

*このプランは、従来、株式会社東京証券取引所において定められていた「証拠金所要額計算に係るコンティンジェンシー・プラン」について、東証先物・オプション取引に係る清算機関の変更（平成16年2月2日）に伴う所要の改正を行い、クリアリング機構が制定したものです。