システム障害発生時等における対応に係る基本方針について

（株）日本証券クリアリング機構

当方針は、当社主要システム（取引所取引清算システム、ＯＴＣ清算システム及び国債店頭取引清算システム）、関係諸機関の決済関連システム若しくは電力/通信網等の社会インフラに緊急事態が発生した場合、又は地震等の天災地変若しくはテロ等が発生した場合などにおける当社の業務執行に関する基本的な方針を示したものです。当方針は、清算参加者のデフォルト及びシステミックリスクの発生を防止する観点から、システム障害発生時等においても可能な限り清算決済業務を継続するとともに、臨時対応を行う場合には、当該対応の影響を最小限にとどめ、決済システム全体における混乱の発生を防止するとの考え方に基づいております。

システム障害発生時等における当社と清算参加者、指定市場開設者、ＤＴＣＣ/ＴＩＷ、MarkitWire、Markit、Reuters、電子取引基盤等、日本銀行、資金決済銀行、外貨資金決済銀行、保振[*1]及びその他関係機関（証券金融会社、金融庁等）との間の連絡体制につきましては、当社主要システム端末、一斉ＦＡＸ、電子メール、インターネット（当社ＨＰ）、ＴＡＲＧＥＴのＪＳＣＣサイト等のうち、利用可能な状態のものを用いることと致します。

なお、当基本方針以外に、具体的なケースを想定したより詳細な緊急時対応につきましては、別途、必要に応じて定めることといたします（＊）。

（＊）先物・オプション取引の取引最終日、特別清算数値及び最終決済価格算出日における対応等については、「先物・オプション取引に係る取引最終日に関するコンティンジェンシー・プラン」及び「先物・オプション取引に係る特別清算数値及び最終決済価格等に関するコンティンジェンシー・プラン」を、取引証拠金所要額計算に係る対応等については「先物・オプション取引に係る証拠金計算に係るコンティンジェンシー・プランについて」を、ＣＤＳ取引に係る当初証拠金所要額計算に係る対応等については、「ＣＤＳ当初証拠金所要額計算等に係るコンティンジェンシー・プランについて」を、金利スワップ取引に係る当初証拠金所要額計算に係る対応等については、「金利スワップ当初証拠金所要額計算等に係るコンティンジェンシー・プランについて」を、システム障害時の取引代行の取扱いに係る対応等については「売買システム障害に伴う先物・オプション取引の取引代行に関する取扱い」をそれぞれ策定しています。

[*1] 「保振」とは、（株）証券保管振替機構をいいます。

【文書番号３】システム障害発生時等における対応に係る基本方針について

１．当社及び関係諸機関システムの障害時における対応

想定ケース	対応	備考	根拠規定
ｉ．当社取引所取引清算システム又はETF設定・交換プラットフォームに障害が発生した場合	（１） 取引所取引清算システムに障害が発生した場合 ・ 当社取引所取引清算システムによって、保振／日本銀行／資金決済銀行への振替（決済）指図が行えない場合や清算参加者に対して必要な決済情報を提供できない場合でも、代替手段により、可能な限り、通常どおり決済を継続する。 ・ 当社が代替手段により振替（決済）指図を行う場合等において、システム障害等の状況を勘案し、やむを得ないと当社が判断した場合は、決済時限を変更する。 ・ 代替手段や決済時限の変更等によっても振替(決済)指図を行えない又は清算参加者に対して必要な決済情報を提供できないと当社が判断した場合は、決済を繰り延べる。 ・ 債務引受けについては継続し、基本的には、債務引受けの停止は行わない。ただし、システムの復旧に日数を要することとなった場合は、未決済約定の累積によるリスクの状況を勘案し、債務引受けの停止を行うことがある。 ・ システム障害等の状況を勘案し、その他所要の対応を行う。	・ 清算預託金等の預託又は返戻の受付が行えない場合や預託窓口の臨時変更などを行う場合がある。	業務方法書4、80、81、82条 商品取引債務引受業に関する業務方法書4、84、85、86条
	（２） ETF設定・交換プラットフォームに障害が発生した場合 ・ 当社ETF設定・交換プラットフォーム（以下「プラットフォーム」という。）の障害により、プラットフォームを通して清算参加者が債務引受の申込みをできない場合又は当社が債務引受の内容を確認できない場合、代替手段により債務引受の申込の受付及び内容の確認を行う。		業務方法書45条の3、46条

【文書番号３】システム障害発生時等における対応に係る基本方針について

想定ケース	対応	備考	根拠規定
ⅱ.当社OTC清算システム又はネットワークに障害が発生した場合	・ 当社 OTC 清算システム又はネットワークの障害により、DTCC/TIW、MarkitWire 又は電子取引基盤等からの債務負担対象原取引データの受領や、資金決済データの作成が行えない場合、あるいは清算参加者に対して必要な決済情報を提供できない場合にも、代替手段の利用、障害箇所の早期回復等により、可能な限り通常どおりの清算処理を継続する。 ・ 代替手段等による通常どおりの清算処理を継続できない場合等において、システム障害等の状況を勘案し、やむを得ないと判断した場合は、当社は決済時限を変更する。 ・ 代替手段や決済時限の変更等によっても清算処理を継続できないと判断した場合、当社は清算処理の繰り延べを行う。 ・ システム障害等の状況を勘案し、その他所要の対応を行う。	・ 清算処理の繰り延べに当たっては、可能な限り清算サイクルの範囲内での繰り延べ処理とする。（以下、清算処理の繰り延べの場合、同じ。） ・ 清算サイクルの範囲内での清算処理の繰り延べにより対応できない場合には、当該サイクルの清算処理を行わない。（同上。）	CDS 業務方法書5、113、114、115 条 IRS 業務方法書 5、113、114、115 条

【文書番号３】システム障害発生時等における対応に係る基本方針について

想定ケース	対応	備考	根拠規定
ⅲ．国債店頭取引清算システムに障害が発生した場合	・ 国債店頭取引清算システムによって、日本銀行への決済指図が行えない場合や清算参加者に対して必要な決済情報を提供できない場合でも、代替手段により、可能な限り、通常どおり決済を継続する。 ・ 当社が代替手段により決済指図を行う場合等において、システム障害等の状況を勘案し、やむを得ないと当社が判断したときは、決済時限を変更する。 ・ 代替手段や決済時限の変更等によっても決済指図を行えない又は清算参加者に対して必要な決済情報を提供できないと当社が判断した場合は、決済を繰り延べる。 ・ 当社が、国債店頭取引清算システムによって債務引受けの申込みを受け付けることができない場合において、やむを得ないと当社が判断したときは、債務引受申込時限を変更する。また、システムの復旧に日数を要することとなった場合は、未決済約定の累積によるリスクの状況を勘案し、債務引受けの停止を行うことがある。 ・ システム障害等の状況を勘案し、その他所要の対応を行う。	・ 日本銀行金融ネットワークシステムの端末を利用して決済指図を行うことを想定。 ・ 清算預託金等の預託又は返戻が行えない場合がある。	JGB 業務方法書 5、91、92、93 条
ⅳ．保振システムに障害が発生した場合	・ 可能な限り、通常どおり決済を継続する。 ・ システム障害等の状況を勘案し、やむを得ないと当社が判断した場合は、決済時限及び国債店頭取引清算業務に係る債務引受時限を変更する。 ・ 決済時限の変更等によっても決済を行うことができないと当社が判断した場合は、決済を繰り延べる。 ・ 債務引受けについては継続し、基本的には、債務引受けの停止は行わない。ただし、システムの復旧に日数を要することとなった場合は、未決済約定の累積によるリスクの状況を勘		業務方法書4、80、81、82 条、商品取引債務引受業に関する業務方法書4、84、85、86 条 JGB 業務方法

想定ケース	対応	備考	根拠規定
	案し、債務引受けの停止を行うことがある。 ・ システム障害等の状況を勘案し、その他所要の対応を行う。	・ ＤＶＰ決済の非ＤＶＰ決済への変更などを行う場合がある。 ・ システム障害等の状況によっては、保振取扱有価証券による清算預託金等の預託又は返戻の受付が行えない場合がある。	書5、91、92、93条
ｖ.日本銀行金融ネットワークシステムに障害が発生した場合	【資金決済関係】 ・ 日本銀行の指定する代替手段により、可能な限り、通常どおり資金決済を継続する。 ・ 代替手段により資金決済を継続する場合等において、システム障害等の状況を勘案し、やむを得ないと当社が判断した場合は決済時限を変更する。 ・ 代替手段や決済時限の変更等によっても決済を行うことができないと当社が判断した場合は、決済を繰り延べる。 ・ 債務引受けについては継続し、基本的には、債務引受けの停止は行わない。ただし、システムの復旧に日数を要することとなった場合は、未決済約定の累積によるリスクの状況を勘案し、債務引受けの停止を行うことがある。 ・ システム障害等の状況を勘案し、その他所要の対応を行う。		業務方法書4、80、81、82条 商品取引債務引受業に関する業務方法書4、84、85、86条 CDS 業務方法書5、113、114、115条 IRS 業務方法書5、113、114、115条、 JGB 業務方法

【文書番号３】システム障害発生時等における対応に係る基本方針について

想定ケース	対応	備考	根拠規定
	【国債決済関係】 ・ 可能な限り、通常どおり決済を継続する。 ・ システム障害等の状況を勘案し、やむを得ないと当社が判断した場合は決済時限を変更する。 ・ 決済時限の変更等によっても決済を行うことができないと当社が判断した場合は、決済を繰り延べる。 ・ 債務引受けについては継続し、基本的には、債務引受けの停止は行わない。ただし、システムの復旧に日数を要することとなった場合は、未決済約定の累積によるリスクの状況を勘案し、債務引受けの停止を行うことがある。 ・ システム障害等の状況を勘案し、その他所要の対応を行う。	・ 国債の振替の場合ＤＶＰ決済について書面依頼等の代替手段を用いることができない。 ・ 国債による清算預託金等の預託又は返戻の受付が行えない場合がある。	書 5、91、92、93 条
ⅵ．資金決済銀行及び外貨資金決済銀行のシステムに障害が発生した場合	・ 当社が指定する代替手段により、可能な限り、通常どおり決済を継続する。 ・ 代替手段により資金決済を継続する場合等において、システム障害等の状況を勘案し、やむを得ないと当社が判断した場合は決済時限を変更する。 ・ 代替手段や決済時限の変更等によっても決済を行うことができないと当社が判断した場合は、決済を繰り延べる。 ・ 債務引受けについては継続し、基本的には、債務引受けの停止は行わない。ただし、システムの復旧に日数を要することとなった場合は、未決済約定の累積によるリスクの状況を勘案し、債務引受けの停止を行うことがある。 ・ システム障害の状況等を勘案し、その他所要の対応を行う。	・ 現金による清算預託金等の預託又は返戻の受付が行えない場合がある。	業務方法書4、80、81、82 条、商品取引債務引受業に関する業務方法書4、84、85、86 条 JGB 業務方法書 5、91、92、93 条、IRS 業務方法書 5、113、114、115 条

【文書番号３】システム障害発生時等における対応に係る基本方針について

想定ケース	対応	備考	根拠規定
ⅶ. 指定市場開設者システムに障害が発生した場合	・ 売買が成立した後、指定市場開設者と当社との間で約定データをシステム的に授受できない場合は、代替手段を用いて、可能な限り、通常どおり決済を継続する。 ・ 代替手段によっても情報の授受を行うことができず、決済ができないと当社が判断した場合は、決済を繰り延べる。	・ 障害が発生していない指定市場開設者の開設する市場における売買については、通常どおり、決済を行う。なお、指定市場開設者の売買システム障害により売買が成立しない場合は、債務引受けは発生しない。	業務方法書81条 商品取引債務引受業に関する業務方法書85条
ⅷ. 証券金融会社システムに障害が発生した場合	・ 証券金融会社と当社との間で貸借・品貸取引に係るデータをシステム的に授受できない場合は、代替手段を用いて、可能な限り、通常どおり決済を継続する。 ・ 証券金融会社と当社との間で貸借・品貸取引に係るデータを、代替手段を用いても授受できない場合（当社による債務引受けが行われない場合）は、貸借・品貸取引を加味せず決済を実行する。		―

２．大規模停電、テロ又は地震等の非常事態時における対応

想定ケース	対応	備考	根拠規定
ⅰ．電力、通信網等社会インフラに緊急事態が発生した場合	・ 可能な限り、通常どおり決済を継続する。 ・ 当社主要システム、保振、日本銀行、資金決済銀行、外貨資金決済銀行及び指定市場開設者等のシステムに障害が発生した場合は、その障害の状況に応じて、上記１．ⅰ～ⅷの対応をとることとする。		業務方法書 4、45 条の 3、46、80、81、82 条 商品取引債務引受業に関する業務方法書 4、84、85、86 条 CDS 業務方法書 5、113、114、115 条 IRS 業務方法書 5、113、114、115 条、 JGB 業務方法書 5、91、92、93 条
ⅱ．テロ等の緊急事態が発生した場合	・ ２．ⅰと同様の対応を行うこととする。		業務方法書 4、80、81、82 条 商品取引債務引受業に関する業務方法書 4、84、85、86 条 CDS 業務方法書 5、113、114、115 条 IRS 業務方法書 5、113、114、115 条、 JGB 業務方法書 5、91、92、93 条

【文書番号３】システム障害発生時等における対応に係る基本方針について

想定ケース	対応	備考	根拠規定
ⅲ．地震等天災地変が発生した場合	・　２．ｉと同様の対応を行うこととする。		業務方法書 4、80、81、82 条 商品取引債務引受業に関する業務方法書 4、84、85、86 条 CDS 業務方法書 5、113、114、115 条 IRS 業務方法書 5、113、114、115 条、 JGB 業務方法書 5、91、92、93 条

以　　上