

## システム障害等に係るコンティンジェンシー・プラン

平成 26 年 4 月 30 日  
東京金融取引所

本取引所は、取引所システムの障害に加えて、決済委託先のシステムに障害が発生した場合などにより、市場デリバティブ取引の状況に異常があると認められる場合若しくはそのおそれがあると認められる場合又はその他取引管理上業務を継続して行わせることが適当でないとする場合などにおいて、本コンティンジェンシー・プランに沿った運用を行う。

また、本取引所は、天災地変又は電力・通信網などの社会基盤が停止した場合など、その他やむを得ない理由に基づいて、取引又は清算が不可能又は著しく困難であると認められるに至ったときにおいても、本コンティンジェンシー・プランを適用する。

### 1. 具体的な対応策

	想定されるケース	本取引所の対応	考え方	関連規定等
1	取引所の取引システムに障害等緊急事態が発生	<ul style="list-style-type: none"> <li>○ 取引システムの停止や誤作動といった障害をはじめとする緊急事態の発生により取引が困難な銘柄については、取引を停止する。</li> <li>○ 取引システムの部分的な障害や回線障害をはじめとする緊急事態の発生により一部の取引参加者が通常の取引ができなくなった場合は、取引できなくなった取引参加者の過去の取引シェアや取引参加者数等を総合的に勘案し、公正な価格形成が確保できないと本取引所が認めた場合等には取引を停止する。</li> <li>○ システム障害等緊急事態の発生により取引最終日にあたる限月取引が停止され、そのままその付合せ時間帯が終了した場合においても、当該限月取引の取引最終日の繰り延べ措置等特別な措置は行なわない。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 取引システムには為替・株価指数取引・清算システムを含むものとする。</li> <li>・ システム障害等の緊急事態発生により取引システムが稼働しなくなった場合は取引を停止する。</li> <li>・ 正常に稼働できる銘柄は取引を継続する。</li> <li>・ 可能な限り取引を継続し、取引参加者等に取引機会を提供するが、公正な価格形成が確保できないと本所が認めた場合等には取引を停止する。</li> <li>・ 商品性等に大きな影響を与えるため取引最終日は繰り延べない。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 業務規程第7条、第14条、第20条の9</li> <li>・ 業務規程施行規則第4条、第6条の5</li> </ul>

	想定されるケース	本取引所の対応	考え方	関連規定等
		<p>○ 付合せ時間の途中で取引を停止した場合、既に約定している取引は有効なものとして処理する。</p> <p>但し、取引システムの障害発生時において本取引所の諸規則その他市場秩序に関する決定事項に抵触する取引が成立したときは当該取引を取消すこと及びこれに伴う所要の措置を行うことができる。</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>参加者システムの障害等緊急事態や電力等の社会インフラの障害等緊急事態については、それが取引システムに影響を及ぼして左記の状況とならない限り取消を行わない。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>業務規程第 14 条の 2、第 14 条の 3</li> <li>業務規程施行規則第 4 条の 2</li> </ul>
2	取引所の相場情報を提供するシステムに障害等緊急事態が発生	<p>○ 障害等緊急事態の発生により相場情報の提供が困難となった場合でも、取引システムが正常に稼働していれば、取引は通常どおり実施する。</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>取引システムが正常に稼働している場合は、取引を優先する。</li> <li>取引参加者は、参加者端末から相場情報を入手でき、顧客も取引参加者から相場情報を入手可能である。</li> </ul>	
3	取引所の清算システムに障害等緊急事態が発生	<p>○ 清算システムの全面停止をはじめとする緊急事態の発生により取引参加者に対し提供する決済情報を作成できない場合、または日本銀行／決済銀行に対して行う振替(決済)依頼に関する情報を作成できない場合は、全ての決済について、決済時限および決済日を繰延べることがある。繰延べ後の決済時限、決済日および決済の条件等についてはシステムの復旧状況等をもとに決定する。</p> <p>○ 清算システムの部分停止をはじめとする緊急事態の発生により取引参加者および決済銀行に対し必要な決済情報を清算システム等を通じて通知できない場合は、FAX等により対応する。</p> <p>○ 清算システムの復旧に日数を要する場合は、取引を停止することがある。</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>清算システムには為替・株価指数取引・清算システムを含むものとする。</li> <li>未決済取引が累積することにより決済リスクが増加することを回避する。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>業務方法書第 99 条、第 100 条、第 103 条</li> <li>業務規程第 7 条、第 14 条、第 20 条の 9</li> <li>業務規程施行規則第 4 条、第 6 条の 5</li> </ul>

	想定されるケース	本取引所の対応	考え方	関連規定等
4	日本銀行金融ネットワークシステムに障害等緊急事態が発生	<p>○ 日本銀行金融ネットワークシステム(当該ネットワークを利用するための機器などを含め、以下「日銀ネット」という。)に障害等緊急事態が発生した場合でも、取引所システムが正常に稼働していれば、取引は通常どおり実施する。</p> <p>○ 日銀ネットに障害等緊急事態が発生し、決済銀行が振替店において日銀ネットを利用して振替依頼を行うことができない場合は、代替手段により、通常どおり円決済銀行資金決済を継続する。ただし、取引所為替証拠金取引及び取引所株価指数証拠金取引には適用しない。</p> <div style="border: 1px solid black; border-radius: 15px; padding: 10px; margin: 10px 0;"> <p>決済銀行は、以下の代替手段を利用して迅速に決済を継続できるよう、手続等を整備しておくことが必要。</p> <p>(i)振替店または振替店以外の店舗による書面取引</p> <p>(ii)振替店以外の店舗による日銀ネットの利用</p> <p>※代替手段を用いる場合は、取引所の了解を得るものとする。</p> </div> <p>○ 日銀ネットに障害等緊急事態が発生し、取引所が日銀ネットを利用して振替依頼を行うことができない場合は、本取引所は速やかに決済銀行にその旨通知するとともに、本取引所の日銀当預口座への全ての入金が行われたことを確認したうえで、日本銀行に対し、書面取引による決済銀行の日銀当預口座への振替を依頼する。</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>取引所システムが正常に稼働している場合は、取引を優先する。</li> </ul>	

	想定されるケース	本取引所の対応	考え方	関連規定等
		<ul style="list-style-type: none"> <li>○ 書面取引等の代替手段により決済を継続する場合において、決済銀行における事務遂行状況等を勘案し、真にやむを得ないと判断した場合は、一部または全ての決済について、決済時限および決済日を繰延べることがある。</li> <li>○ 日銀ネットの復旧に日数を要し、かつ、代替手段による円決済銀行資金決済の円滑な継続が著しく困難と認められる場合は、取引を停止することがある。</li> </ul>		<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 業務方法書第 99 条、第 100 条、第 103 条</li> <li>・ 業務規程第 7 条、第 14 条、第 20 条の 9</li> <li>・ 業務規程施行規則第 4 条、第 6 条の 5</li> </ul>
5	決済銀行のシステムに障害等緊急事態が発生	<ul style="list-style-type: none"> <li>○ 決済銀行のシステムに障害等緊急事態が発生した場合でも、取引所システムが正常に稼働していれば、取引および決済は通常どおり実施する。</li> <li>○ 決済銀行における緊急事態の発生により、同行または日本銀行に本取引所が開設している円決済口座に資金不足が発生する場合は、不足資金の手当てを行う。</li> <li>○ ただし、障害等の状況を勘案し、真にやむを得ないと判断した場合は、一部または全ての決済について、決済時限および決済日を繰延べることがある。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 取引所システムが正常に稼働している場合は、取引を優先する。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 円資金決済規則第 28 条</li> <li>・ 業務方法書第 99 条、第 100 条、第 103 条</li> </ul>
6	取引参加者自社システムに障害等緊急事態が発生	<ul style="list-style-type: none"> <li>○ 取引参加者自社システムに障害等緊急事態が発生し、一部の取引参加者が通常の取引ができなくなった場合は「1-取引所の取引システムに障害等緊急事態が発生」の一部取引参加者障害を準用する。</li> <li>○ 取引参加者自社システムに障害等緊急事態が発生し、当該取引参加者の清算業務に支障が生じている場合、当該取引参加者の自社システムが復旧したことが確認されるまで、当該取引参加者の取引を停止することがある。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 取引所取引全体の安全性を確保する。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 業務規程第 14 条、第 20 条の 9</li> </ul>

	想定されるケース	本取引所の対応	考え方	関連規定等
7	取引最終日当日、差金決済数値の基準となる基準金利等を公表する一般社団法人全銀協TIBOR運営機関等諸機関にシステム障害等緊急事態が発生	○ 取引最終日に左記諸機関においてシステム障害等緊急事態が発生し、差金決済数値の基準となる基準金利等を公表できない場合、本取引所が当日の取引状況、前日清算価格等を総合的に勘案し、当該商品の差金決済数値を決定する。ただし、取引所為替証拠金取引及び取引所株価指数証拠金取引には適用しない。		・ 業務方法書第55条第4項等
8	電力等の社会インフラに障害等緊急事態が発生	○ 電気等の供給が停止し、取引システムに障害等緊急事態が発生した場合の対応は「1-取引所の取引システムに障害等緊急事態が発生」を準用する。		

## 2. システム障害等発生時の取引参加者等への通知・連絡体制

システム障害をはじめとする緊急事態発生時には、障害等の状況(発生状況、原因、取引停止状況、回復見通し等)および今後の取扱い(取引再開に関する指示等)を取引参加者、情報ベンダーに対し、緊急連絡用ファックス、端末メッセージ、インターネット・ホームページ、E-Mailのうち、その時点で利用可能な状態にあるものを用いて連絡するほか、上記以外の関係諸機関にも併せて障害状況等を連絡する。

—— 上記1の対応により、決済時限および決済日の繰り延べを決定した場合は、速やかに全ての取引参加者、決済銀行および日本銀行に通知する。

以上