

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14年12月17日

東京金融先物取引所

本取引所では、西暦2000年問題に対応するため平成11年7月に「西暦2000年対応に係るコンティンジェンシー・プラン」（以下「コンチ・プラン」）を策定し、その後は西暦2000年問題に限らず、システム障害を始めとする緊急事態には本「コンチ・プラン」を適用することとしてきた。

今般、平成15年3月に予定しているコンピュータ・システムの全面更改に合わせ、一部会員障害等に係る従来の「コンチ・プラン」の見直しを行い、さらに取引最終日に係る緊急時の取り扱いを加え「システム障害等に係るコンティンジェンシー・プラン」として新たに適用することとする。

なお、今回のコンピュータ・システムの全面更改においては、専用端末の廃止・ISVの導入といった制度の変更に伴い、現在取引所に設置してある障害時専用端末設備がなくなることから、会員各位におかれては、ギブアップ制度の利用をはじめとした端末障害時等の緊急事態への対応検討が望まれる。

1. 具体的な対応策

	想定されるケース	T I F F Eの対応	考え方	関連規定等
1	取引所の付合せシステムに障害等緊急事態が発生	<p>センター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。</p> <p>センター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会員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会員の過去の取引シェアや会員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所が認めた場合等には取引を停止する。</p> <p>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</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・ システム障害等の緊急事態発生により付合せシステムが稼働しなくなった場合は取引を停止する。 ・ 正常に稼働できる銘柄は取引を継続する。 ・ 可能な限り取引を継続し、会員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。 ・ 取引最終日を翌営業日以降に繰り延べた場合、その商品性等に大きな影響を与えるおそれがあるため繰り延べは行わない。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 業務規程第7条、第14条 ・ 業務規程施行規則第3条、第4条

	想定されるケース	T I F F Eの対応	考え方	関連規定等
		わない。 付合せ時間の途中で取引を停止した場合、既に約定済となっている取引は有効なものとして処理する。		
2	取引所の相場報道システムに障害等緊急事態が発生	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、付合せ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。	<ul style="list-style-type: none"> 付合せシステムが正常に稼働している場合は、取引を優先する。 会員は、会員端末から相場情報を入手でき、顧客も会員から相場情報を入手可能である。 	
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会員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）指図に関する情報を作成できない場合は、決済を繰延べることがある。</p> <p>繰延べ後の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会員および決済銀行に対し必要な決済情報を配信できない場合は、FAXにより対応する。また、日本銀行に対し磁気テープによる振替（決済）指図を行えない場合は、書面の持込みにより対応する。</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"> 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。 	<ul style="list-style-type: none"> 定款第107条、第168条 業務規程第71条 業務規程第7条、第14条

	想定されるケース	T I F F Eの対応	考え方	関連規定等
				<ul style="list-style-type: none"> ・ 業務規程施行規則第3条、第4条
4	日本銀行システムに障害等緊急事態が発生（円資金決済）	<p>日本銀行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、取引は通常どおり実施する。</p> <p>日本銀行システムに障害等緊急事態が発生した場合の対応は、日本銀行の指示に基づき、書面の持込みにより対応する。</p> <p>障害等の状況により、決済時限の繰下げ、または書面依頼等の代替手段による対応が困難な場合、決済を繰延べることがある。</p> <p>日本銀行システム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"> ・ 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。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 定款第107条、第168条 ・ 業務規程第71条 ・ 業務規程第7条、第14条
5	決済銀行のシステムに障害等緊急事態が発生	<p>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、取引は通常どおり実施する。</p> <p>ただし、障害等の状況により、決済時限の繰下げ等による対応が困難な場合、決済を繰延べることがある。</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・ 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。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 定款第107条、第168条 ・ 業務規程71条
6	会員自社システムに障害等緊急事態が発生	<p>会員自社システムに障害等緊急事態が発生し、一部の会員が通常の取引ができなくなった場合は「1 - 取引所の付合せシステムに障害等緊急事態が発生」の一部会員障害を準用する。</p> <p>会員自社システムに障害等緊急事態が発生し、当</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・ 取引所取引全体の安全性を確保する。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 定款第49条（4）

	想定されるケース	T I F F Eの対応	考え方	関連規定等
		該会員の清算業務に支障が生じている場合、当該会員の自社システムが復旧したことが確認されるまで、当該会員の取引を停止することがある。		・業務規程第14条(1)
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全国銀行協会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。		・業務規程第53条第4項、第57条第41項、第64条の3第41項等
8	電力等社会インフラに障害等緊急事態が発生	電気、水道等の供給が停止し、付合せシステムに障害等緊急事態が発生した場合の対応は「1 - 取引所の付合せシステムに障害等緊急事態が発生」を準用する。		

(注)ドル受渡決済集中銀行(チェース・マンハッタン銀行)のシステムに障害が発生した場合など、ドル通貨先物の最終決済時(3ヵ月に1度)に生じる可能性のある緊急事態については、障害等の状況により、決済時限の繰下げ、又は書面依頼等の代替手段を講じ、それらによる対応が困難な場合、決済の繰延べその他本取引所が必要と認める措置をとることとする。

2. システム障害等発生時の会員等への通知・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)を会員、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。

以 上