

## 西暦2000年対応に係る危機管理計画（案）

本所システムのコンピュータ西暦2000年問題については、その対応を本年2月末で完了し、3月より証券業界の総合的なテストに日程を合わせて対応テストを実施するなど対策に万全を期しております。しかしながら、西暦2000年問題によってもたらされる恐れのある障害は、広範囲かつ同時多発的に発生する可能性があり、また、本所システムが正常に稼働している場合においても関連する他のシステムにおいて障害が起きる可能性もあることから、今般、下記のとおり様々な障害を想定した対応策を取りまとめました。

### 1. 想定されるケースと本所の対応策・考え方

	想定されるケース	本所の対応	考え方	根拠規定
1	本所売買システムに障害が発生した場合	<p>1. 媒介系</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 障害発生により売買継続が困難なシステム売買銘柄について売買を停止</li> </ul> <p>2. 発注系</p> <p>システム売買において</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 売買に参加できない正会員の過去の売買高シェアが概ね2割超となった場合には、売買システムにおける株券の売買を停止する。</li> <li>・ 又、売買高シェア2割超の正会員に影響が出るおそれがある場合には、売買を停止した上で障害発生状況の確認を行った後、売買停止継続か、売買再開の決定を行うなどの対応を採ることとする。</li> </ul> <p>但し、大口・バスケット取引及び終値取引（N-NET）については、注文発注の可能な正会員が存在する限り、取引を続行するものとする。</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 人手での対応は事実上不可能</li> <li>・ 障害発生時における顧客の再委託等の実務面を考慮すると、短時間での処理は困難であり、一定程度以上の市場シェアを有する正会員に係る障害が市場の流動性に与える影響は甚大であると考えられることから売買を停止する。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 業務規程第28条第4号等</li> <li>・ 業務規程第28条第4号等</li> </ul>

2	N - N E Tシステムに障害が発生した場合	<p>1 . 回線及びN - N E Tサーバ系</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・大口相対交渉取引及び終値実商い取引において、売買を停止</li> <li>・大口クロス取引、終値クロス取引及びバスケット取引においては、注文受付をファックスにより行う。</li> </ul> <p>2 . 清算システムへの約定データの引き渡しが無能となった場合</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・立会外取引の売買を停止する。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・付合せの即時性を求められる取引において、注文受付をファックスにより行うことは、事実上不可能</li> <li>・清算システムへ引継がれる清算データの作成の人手による対応は不可能</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・大口取引に関する業務規程等の特例第 1 1 条第 4 号等、終値取引に関する業務規程等の特例第 1 2 条第 4 号等</li> <li>・大口取引に関する業務規程等の特例第 1 1 条第 4 号等、終値取引に関する業務規程等の特例第 1 2 条第 4 号等</li> <li>・バスケット取引に関する業務規程等の特例第 1 4 条第 4 号等</li> </ul>
3	相場伝達システムに障害が発生した場合	<ul style="list-style-type: none"> <li>・障害が回復するまで、相場送信銘柄について売買を停止する。</li> <li>・但し、N - N E Tにおいて取引銘柄情報及び取引価格情報（基準値段、前・後場終値等）が取得できない場合は、当該銘柄について、下記の取扱いとする。 大口相対交渉取引及び終値実商い取引において売買を停止する。 大口クロス取引、終値クロス取引及びバスケット取引においては、注文受付をファックスにより行う。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・市場情報が十分に伝達されない中で、投資が行われると市場の価格形成を歪めるおそれがある。</li> <li>・付合せの即時性を求められる取引において、注文受付をファックスにより行うことは、事実上不可能</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・業務規程第 2 8 条第 3 号等</li> <li>・大口取引に関する業務規程等の特例第 1 1 条第 4 号等、終値取引に関する業務規程等の特例第 1 2 条第 4 号等</li> </ul>
4	東証相場が入手無能となった場合（東証相場報道システムに障害が発生した場合）	<p>1 . システム売買銘柄・立会銘柄（株券及び転換社債券等）</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・障害が回復するまで、全ての銘柄について売買を停止する。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・市場情報が十分に伝達されない中で、投資が行われると市場の価格形成を歪めるおそれがある。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・業務規程第 2 8 条第 3 号等</li> </ul>

		<p>2. 立会外取引</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ N - N E Tにおいて取引銘柄情報及び取引価格情報（基準値段、前・後場終値等）が取得できない場合は、当該銘柄について、下記の取扱いとする。</li> <li>大口相対交渉取引及び終値実商い取引において、売買を停止する。</li> <li>大口クロス取引、終値クロス取引及びバスケット取引においては、注文受付をファックスにより行う。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 付合せの即時性を求められる取引において、注文受付をファックスにより行うことは、事実上不可能</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 大口取引に関する業務規程等の特例第11条第4号等、終値取引に関する業務規程等の特例第12条第4号等</li> </ul>
5	東証売買システムに障害が発生した場合	<p>1. システム売買銘柄・立会銘柄（株券及び転換社債券等）</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 売買を継続する。但し、流動性と本所注文処理能力の状況を勘案の上、売買を停止することがある。</li> </ul> <p>2. 立会外取引</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ N - N E Tにおいて取引銘柄情報及び取引価格情報（基準値段、前・後場終値等）が取得できない場合は、当該銘柄について、下記の取扱いとする。</li> <li>大口相対交渉取引及び終値実商い取引において、売買を停止する。</li> <li>大口クロス取引、終値クロス取引及びバスケット取引においては、注文受付をファックスにより行う。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 市場の代替性と注文処理能力との兼ね合いを判断する必要がある。</li> <li>・ 付合せの即時性を求められる取引において、注文受付をファックスにより行うことは、事実上不可能</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 業務規程第28条第3号等</li> <li>・ 大口取引に関する業務規程等の特例第11条第4号等、終値取引に関する業務規程等の特例第12条第4号等</li> </ul>
6	照合システムに障害が発生した場合	立会銘柄（株券及び転換社債券等）の取引について売買を停止	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 場立がほとんどいない状況において、照合業務を手作業で行うことは事実上不可能</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 業務規程第28条第3号等</li> </ul>
7	本所清算システムに障害が発生した場合	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 正会員等に対し必要な決済情報を提供できない場合、または（財）証券保管振替機構（以下「機構」という。）に対し振替指図を行えない場合は、決済を繰り延べる。繰り延べ後の決済日についてはシステムの復旧状況をもとに別途定める。</li> <li>なお、特別会員を相手方とする売買取引の決済については、特別会員と正会員との間で決済するものとする。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 他の証券取引所の決済に影響するため</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 定款第27条</li> <li>・ 定款第25条、諸規則内規集特別会員関係4条</li> </ul>

		<ul style="list-style-type: none"> <li>・システムの復旧に日数を要する場合は、すべての売買を臨時に停止することがある。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <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</li> </ul>	業務規程第4条
8	特別会員のシステムに障害が発生した場合	<ul style="list-style-type: none"> <li>・特別会員（日本協栄証券）が本所に売買データを交付できない場合には、特別会員を相手方とする売買とそれに係る貸借取引を除外して決済を実施する。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・特別会員を利用しない取引の決済を履行する必要がある。</li> </ul>	
9	機構システムに障害が発生した場合	<ul style="list-style-type: none"> <li>・決済日前日の段階で口座振替等の処理が行えないことが判明した場合には、株券及び受益証券につき翌日の決済（有価証券、資金共）を繰り延べる。繰り延べ後の決済日については同システムの復旧状況をもとに別途定める。</li> <li>・決済日当日に機構システムに障害が発生した場合には、その復旧状況に応じ株券及び受益証券の決済時限を繰り下げ、または決済未了分につき決済（有価証券）を繰り延べる等の措置を講ずる。</li> <li>・機構システムのシステムの復旧に日数を要する場合には、株券及び受益証券の売買を臨時に停止することがある。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <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</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・定款第27条</li> <li>・業務規程47条2項、定款第27条</li> <li>・業務規程第4条</li> </ul>
10	中部証券金融(株)のシステムに障害が発生した場合	<ul style="list-style-type: none"> <li>・売買は通常どおり実施する。</li> <li>・中部証券金融(株)が本所に貸借取引に係るデータを交付できない場合には、貸借取引を加味せずに本所における決済を実施する。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・貸借取引を利用していない市場参加者の取引機会を確保する必要がある。</li> <li>・貸借取引と無関係な決済を履行する必要がある。</li> </ul>	
11	清算銀行のシステムに障害が発生した場合	<ul style="list-style-type: none"> <li>・障害の状況により、決済時限を繰り下げ、または清算銀行利用正会員の過半数に影響が生じる程度に清算銀行のシステム障害が発生し、かつ書面依頼等の代替手段により対応することが実務的に困難であると本所が認める場合には、決済（資金）を繰り延べる場合がある。</li> </ul>		<ul style="list-style-type: none"> <li>・業務規程第47条、定款第27条等</li> </ul>

12	正会員のシステムの西暦2000年対応への準備状況が十分でないと思われる場合	<ul style="list-style-type: none"> <li>・西暦2000年対応が万全でない正会員については、市場における売買、決済全般に影響を及ぼす恐れがあり、取引の安全を確保するために西暦2000年に決済を迎える売買への参加を認めない。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・取引所取引全体の安全を確保</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・定款第37条等</li> </ul>
13	正会員の自社側システムに障害が発生した場合	<ul style="list-style-type: none"> <li>・売買に参加できない正会員の過去の売買高シェアが概ね2割超となった場合には、当該市場における取扱有価証券の売買を停止する。</li> <li>・又、売買高シェア2割超の正会員に影響が出るおそれがある場合には、売買を停止した上で障害発生状況の確認を行った後、売買停止継続か、売買再開の決定を行うなどの対応を採ることとする。</li> <li>・但し、大口・バスケット取引及び終値取引（N-NET）については、注文発注の可能な正会員が存在する限り、取引を続行するものとする。</li> <li>・なお、当該正会員の自社側システムの問題で清算業務に支障が生じている場合は、当該正会員のシステムが復旧したことが確認されるまで、本所における売買を停止する。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・障害発生時における顧客の再委託等の実務面を考慮すると、短時間での処理は困難であり、一定程度以上の市場シェアを有する正会員に係る障害が市場の流動性に与える影響は甚大であると考えられることから売買を停止する。</li> <li>・取引所取引全体の安全性を確保</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・業務規程第28条第3号等</li> <li>・業務規程第57条等</li> </ul>
14	電力、通信網等の社会インフラに障害が発生した場合	<ul style="list-style-type: none"> <li>・売買に参加できない正会員の過去の売買高シェアが概ね2割超となった場合には、当該市場における取扱有価証券の売買を停止する。</li> <li>・又、売買高シェア2割超の正会員に影響が出るおそれがある場合には、売買を停止した上で障害発生状況の確認を行った後、売買停止継続か、売買再開の決定を行うなどの対応を採ることとする。</li> <li>・但し、大口・バスケット取引及び終値取引（N-NET）については、注文発注の可能な正会員が存在する限り、取引を続行するものとする。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・障害発生時における顧客の再委託等の実務面を考慮すると、短時間での処理は困難であり、一定程度以上の市場シェアを有する正会員に係る障害が市場の流動性に与える影響は甚大であると考えられることから売買を停止する。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・業務規程第28条第3号等</li> </ul>

## 2 . 本所と正会員等との通知、連絡体制

平時利用している電話、ファックス、インターネット（名証ホームページ）のうち、その時点で利用可能な状態にあるものを全て用いることとします。

## 3 . 2 0 0 0 年到来時の本所の対応

- ・ 2 0 0 0 年 1 月 2 日には全システムを稼働して 1 月 4 日を想定した確認のテストを実施します。テスト結果については F A X によりお知らせします。  
なお、確認テストにおいて本所システム、会員等関連システムに万一問題が発生した場合にそなえ、1 月 3 日を予備日とします。
- ・ 1 月 4 日については、オンライン開始後速やかに本所各システムの稼働状況を F A X によりお知らせします。

（上記テスト結果、稼働状況についてはインターネット「名証ホームページ」にも掲載します。）

以上