

空売り残高情報の提供方法及び公表方法の見直しについて

平成25年9月4日

株式会社東京証券取引所

1. 概要

本年11月5日（火）に施行が予定されております、空売り規制の総合的な見直しに併せ¹、空売り残高情報の提供者及び利用者の利便性等を考慮し、空売り残高情報の提供方法及び公表方法を見直すことといたします²。

空売り残高情報の提供に当たっては、現状、当取引所が提示している参考フォーマットをもとに空売り残高情報を作成し、PDFファイル形式に変換したうえでご提供いただいておりますが、見直し後は、新たにEXCELファイル形式の統一フォーマットを整備いたします。空売り残高情報の提供者におかれましては、当該新しいEXCELファイル形式の統一フォーマットに従って空売り残高情報を作成のうえ、PDFファイル形式に変換することなく、EXCELファイル形式のまま、当取引所にご提供いただくこととなります。

また、空売り残高情報の公表に当たっては、現状、提供されたPDFファイル形式の空売り残高情報について、ZIPファイル形式にまとめたうえで、日々、当取引所のホームページに掲載しておりますが、見直し後は、提供された空売り残高情報を集約等したうえで、EXCELファイル形式の単一のファイルとして、日々、当取引所のホームページに掲載するものといたします。

なお、空売り規制の総合的な見直しに伴い、空売り残高報告・公表制度につきましては、現行の0.25%以上で報告・公表となる方式（One-Tier Model）から、0.2%以上で報告・0.5%以上で公表となる方式（Two-Tier Model）に見直されることとなりますが、空売り残高情報の提供に当たっては、報告対象から公表対象となるものを峻別する必要はありません。提供された空売り残高情報のうち、当取引所で公表対象となるもののみを集約等したうえで、当取引所のホームページに掲載いたします。

空売り残高情報の提供方法及び公表方法の見直しの詳細については、それぞれ下記2及び3、また、これらの実施時期については下記4をご参照ください。

2. 空売り残高情報の提供方法の見直しについて

(1) 提供するファイルについて

空売り残高情報の提供に当たっては、原則として、「空売りをした指定有価証券に係る残高情報」を記載したファイル（以下、「ファイルA」という。）及び「商号、名称又は氏名及び住所又は所在地」を記載したファイル（以下、「ファイルB」という。）の2つのファイルをご提供いただき

¹ 空売り規制の総合的な見直しの詳細につきましては、金融庁のホームページ（<http://www.fsa.go.jp/news/25/syouken/20130821-3.html>）をご参照ください。

² 平成25年3月7日付「空売り規制の総合的な見直しについて（案）」（金融庁、<http://www.fsa.go.jp/news/24/syouken/20130307-1/01.pdf>）における1（5）並びに平成25年5月17日付「空売り規制の総合的な見直しに係る東証の対応について」（東証株総第145号）の別紙における3（1）及び（2）をご参照ください。

ます（有価証券の取引等の規制に関する内閣府令（平成19年内閣府令第59号。以下「取引規制府令」という。）第15条の2各項）。

但し、空売りを行った者が個人以外の者である場合は、ファイルBの提供は要さないものとします³。

なお、ファイルAで提供された空売り残高情報のうち、公表対象となるもののみが当取引所のホームページに掲載されることとなりますが、従来どおり、ファイルBで提供された氏名及び住所等の情報につきましては、公表されることはありません。

（2）新しい統一フォーマットについて

空売り残高情報の提供に係る、新しい統一フォーマット（ファイルA及びファイルB）については、下記の当取引所のホームページよりダウンロードすることができます。

なお、統一フォーマット（ファイルA及びファイルB）は日本語及び英語が併記される方式となっており、下記の日本語ページ及び英語ページに掲載される統一フォーマットは同様のものとなります。

空売り残高情報の提供に係る統一フォーマット

<http://www.tse.or.jp/market/juran/karauri/announce.html>（日本語ページ）

<http://www.tse.or.jp/english/market/report/announce.html>（英語ページ）

（3）ファイルAに記載すべき情報について

空売り残高情報報告書 Report on Outstanding Short Positions							
提供年月日 Date of Reporting		①					
商号・名称・氏名 Name of Short Seller				②			
住所・所在地 Address of Short Seller				③			
委託者・投資一任契約の相手方の商号・名称・氏名 Name of Discretionary Investment Contractor				④			
委託者・投資一任契約の相手方の住所・所在地 Address of Discretionary Investment Contractor				⑤			
信託財産・運用財産の名称 Name of Investment Fund				⑥			
計算年月日 Date of Calculation				⑦			
銘柄コード Code of Stock	銘柄名 Name of Stock	空売り残高割合 Ratio of Short Positions to Shares Outstanding	空売り残高数量 Number of Short Positions in Shares	空売り残高売買単位数 Number of Short Positions in Trading Units	直近計算年月日 Date of Calculation in Previous Reporting	直近空売り残高割合 Ratio of Short Positions in Previous Reporting	備考 Notes
⑧	⑨	⑩	⑪	⑫	⑬	⑭	⑮

①提供年月日 (Date of Reporting)

³ 従来は個人以外の者であっても、ファイルAとファイルBの2つをご提供いただいておりましたが、両ファイルに記載される情報が重複しているため、空売りを行った者が個人以外の者の場合は、ファイルBの提供を要さないものとしたものです。なお、当該取扱いについては、金融庁より、法令の趣旨に反するものではない旨の見解を得ております。

ファイルAの提供年月日を記載してください。

②商号・名称・氏名 (Name of Short Seller)

取引規制府令第15条の3第1項第1号に基づき、指定有価証券について空売りを行った者の商号、名称又は氏名を記載してください。但し、空売りを行った者が個人（下記⑩に記載する空売り残高割合が0.05未満である個人に限ります。）である場合には、個人である旨を記載してください。

③住所・所在地 (Address of Short Seller)

取引規制府令第15条の3第1項第2号に基づき、指定有価証券について空売りを行った者の住所又は所在地を記載してください。但し、空売りを行った者が個人（下記⑩に記載する空売り残高割合が0.05未満である個人に限ります。）である場合には、空欄としてください。

④委託者・投資一任契約の相手方の商号・名称・氏名 (Name of Discretionary Investment Contractor)

指定有価証券の空売りが、取引規制府令第15条の3第1項第3号イ又はロに該当する場合に、委託者又は投資一任契約の相手方の商号、名称又は氏名を記載してください。本項目に該当しない場合は、空欄としてください。

⑤委託者・投資一任契約の相手方の住所・所在地 (Address of Discretionary Investment Contractor)

指定有価証券の空売りが、取引規制府令第15条の3第1項第3号イ又はロに該当する場合に、委託者又は投資一任契約の相手方の住所又は所在地を記載してください。本項目に該当しない場合は、空欄としてください。

⑥信託財産・運用財産の名称 (Name of Investment Fund)

指定有価証券の空売りが、取引規制府令第15条の3第1項第3号イ、ハ又はニに該当する場合に、信託財産又は運用財産の名称を記載してください。本項目に該当しない場合は、空欄としてください。

⑦計算年月日 (Date of Calculation)

取引規制府令第15条の3第1項第5号に基づき、空売り残高割合の計算年月日を記載してください。

⑧銘柄コード (Code of Stock)

取引規制府令第15条の3第1項第4号に基づき、空売りを行った指定有価証券の銘柄コードを記載してください。ここで言う銘柄コードとは、証券コード協議会が付番する銘柄コード（通常4桁の数字）を意味します。

⑨銘柄名 (Name of Stock)

取引規制府令第15条の3第1項第4号に基づき、空売りを行った指定有価証券の銘柄名を記載してください。銘柄名は、正式名称でなくとも、その内容が把握できる範囲において、略記等できるものとします。

⑩空売り残高割合 (Ratio of Short Positions to Shares Outstanding)

取引規制府令第15条の3第1項第7号に基づき、指定有価証券に係る空売り残高割合を記載してください。この場合において、空売り残高割合は、パーセント表示で記載するものとします（例えば、空売り残高割合が0.003である場合、0.3%として記載するものとします）。また、取引規制府令第15条の3第1項第7号に基づき、空売り残高割合は、小数点以下4位未満の端数を切り捨てて計算する点及び負の数値にはならない点にご留意ください（正の数値として記載してください）。

⑪空売り残高数量 (Number of Short Positions in Shares)

取引規制府令第15条の3第1項第6号に基づき、指定有価証券に係る空売り残高数量を記載してください。取引規制府令第15条の3第2項に基づき、空売り残高数量は、負の数値にはならない点にご留意ください（正の数値として記載してください）。

⑫空売り残高売買単位数 (Number of Short Positions in Trading Units)

取引規制府令第15条の3第1項第6号に基づき、指定有価証券に係る空売り残高売買単位数を記載してください。取引規制府令第15条の2第7項に基づき、空売り残高売買単位数は、1未満の端数を切り捨てて計算する点及び負の数値にはならない点にご留意ください（正の数値として記載してください）。

⑬直近計算年月日 (Date of Calculation in Previous Reporting)

取引規制府令第15条の3第1項第8号に基づき、直近に提供した残高情報に係る空売り残高割合の計算年月日を記載してください。本項目に該当しない場合は、空欄としてください。

⑭直近空売り残高割合 (Ratio of Short Positions in Previous Reporting)

取引規制府令第15条の3第1項第8号に基づき、直近に提供した残高情報に係る空売り残高割合を記載してください（記載に当たっては、上記⑩もご参照ください）。本項目に該当しない場合は、空欄としてください。なお、変更報告水準に至らない場合であっても、自主的に空売り残高情報をご提供いただくことは差し支えありませんが、その場合における当該直近空売り残高割合については、自主的に提供した空売り残高情報を含め直近に提供した空売り残高情報に係るものを記載する必要がある点にご留意ください。

⑮備考 (Notes)

特筆すべき事項がある際に、その内容をわかりやすく記載してください（例えば、既に提供した空売り残高情報に誤りがあり、それを修正する場合等）。当該空売り残高情報が公表対象であ

る場合には、備考欄に記載された内容も併せて公表されることとなります。特筆すべき事項がない場合は、空欄としてください。

(4) ファイルBに記載すべき情報について

空売り残高報告に係る商号等報告書 Report on Name and Address	
提供年月日 Date of Reporting	①
商号・名称・氏名 Name of Short Seller	②
住所・所在地 Address of Short Seller	③

①提供年月日 (Date of Reporting)

ファイルBの提供年月日を記載してください。

②商号・名称・氏名 (Name of Short Seller)

指定有価証券について空売りを行った者の商号、名称又は氏名を記載してください。空売りを行った者が個人の場合であっても、フルネームを記載してください。

③住所・所在地 (Address of Short Seller)

指定有価証券について空売りを行った者の住所又は所在地を記載してください。空売りを行った者が個人であっても、フルアドレスを記載してください。

(5) ファイルの名称について

ファイルAについては、「YYYYMMDD_提供者名-1」の名称を付してください。YYYYMMDDの部分については、YYYYは4桁の西暦年、MMについては2桁の月、DDについては2桁の日付とし、半角英数字で名称付与してください。当該日付は、上記(3)の⑦に記載する、空売り残高割合の計算年月日を記載してください。提供者名の部分については、上記(3)の②に記載する、空売りを行った者の商号、名称又は氏名を記載してください(但し、その内容が把握できる範囲において、略記等できるものとします。)

また、ファイルBについては、「YYYYMMDD_提供者名-2」の名称を付してください。YYYYMMDDの部分については、ファイルAと同様となりますが、提供者名の部分については、上記(4)の②に記載する、空売りを行った者の商号、名称又は氏名を記載してください(但し、その内容が把握できる範囲において、略記等できるものとします。)

(6) ファイルの提出方法について

ファイルA及びファイルBともに、EXCELファイル形式のまま、ご提供いただきます。提供は、従来どおり、Target(東証WAN)への登録をもって行います。

Targetにおける登録箇所については、従来どおり、ファイルAは、「届出書類」→「株式会社(売買監理関係)」→「届出書類」→「【公表用】空売り残高情報登録(空売りに係るポジショ

ン情報を含む)」から、また、ファイルBについては、「届出書類」→「株式部（売買監理関係）」→「届出書類」→「空売り残高情報登録（空売りに係るポジション情報を含まない）」から、それぞれEXCELファイル形式で登録してください⁴。

ファイルA及びファイルBの提供期限については、取引規制府令第15条の2各項をご参照ください。なお、当取引所においては、原則として、日々、午後4時までに提供された空売り残高情報を対象として集約等を行ったうえで、当日の午後4時30分を目途に当取引所のホームページに掲載するものとします。

※ 上記（6）は、当取引所の取引参加者から当取引所に対する、ファイルの提供方法を記載したものです。当取引所の取引参加者以外の空売り残高情報の提供者におかれましては、当取引所の取引参加者を通じてファイルをご提供いただくこととなりますので、その詳細につきましては、お取引のある証券会社までお問い合わせください（併せて、取引規制府令第15条の2各項もご参照ください）。

（7）ファイルの作成及び提供に当たっての留意事項

- ✓ ファイルA及びファイルBの作成及び提供に当たっては、統一フォーマットのレイアウト（情報が入力されるセルの位置等）は変更しないでください（但し、後述するように、ファイルAの銘柄レコード不足によって、行を追加する場合はこの限りではありません）。
- ✓ ファイルA及びファイルBは、日本語又は英語のどちらで記載いただいても構いません。
- ✓ ファイルAについて、統一フォーマット上の銘柄レコードが不足する場合には、適宜、行を追加することができます。
- ✓ ファイルAに記載すべき銘柄コードと銘柄名について、これらの間に不整合があった場合には、当取引所における集約等では、銘柄コードを優先して処理を行います。
- ✓ ファイルAに記載される空売り残高割合等の数値情報の正確性について、当取引所では一切の確認又は検証を行いません。また、提供された空売り残高割合等の数値情報については、一切の修正又は加工を行わず、記載された情報に基づき集約等を行います。そのため、記載された数値情報に誤りがあった場合には、空売り残高情報の公表時に予期せぬ結果をもたらす可能性がございますので、空売り残高情報の作成に当たっては十分にご留意ください。
- ✓ ファイルA及びファイルBをTargetに登録する際には、パスワードは付さないでください。
- ✓ 金融商品取引法施行令（昭和40年政令第321号。以下「金商法施行令」という。）第26条の5第1項及び第2項に基づき、当取引所に提供される空売り残高情報は、当取引所が主たる金融商品取引所となる銘柄に限られます⁵。当取引所以外が主たる金融商品取引所となる

⁴ なお、提出すべきファイルが多くなる場合等、必要に応じて、ZIPファイル形式にまとめたうえで、Targetにご登録いただくこともできるものとします。但し、この場合においても、ファイルA及びファイルBの別に、Targetに登録していただく必要があります。

⁵ 主たる金融商品取引所に係る実務的な取扱い等については、平成25年9月4日付「空売り規制の総合的な見直しに係る空売り残高報告の取扱い等について」（東証株総第211号）の別紙2「空売り規制に係る主たる市場の取扱い及びその公表について」をご参照ください。

銘柄に係る空売り残高情報については、当該銘柄の主たる金融商品取引所まで提供してください。

3. 空売り残高情報の公表方法の見直しについて

(1) 空売り残高情報の集約等について

金商法施行令第26条の5第1項及び第2項に基づき、当取引所に提供された空売り残高情報（ファイルA）について、当取引所では、金商法施行令第26条の5第5項及び取引規制府令第15条の4第1項に基づき、当該空売り残高情報のうち、公表対象となるもののみを集約等いたします。

(2) 空売り残高情報の公表方法について

当取引所に提供された空売り残高情報（ファイルA）のうち、公表対象となる空売り残高情報を集約等した結果については、EXCELファイル形式の単一のファイルに取り纏めたうえで、日々、午後4時30分を目途に、下記の当取引所のホームページに掲載いたします⁶。

また、前営業日に当取引所ホームページに掲載した集約後の空売り残高情報については、当取引所の公衆縦覧スペース（インフォメーション・テラス）においても公表いたします。

空売りの残高に関する情報

<http://www.tse.or.jp/market/juran/karauri/index.html>（日本語ページ）

<http://www.tse.or.jp/english/market/report/index.html>（英語ページ）

(3) 公表フォーマットについて

空売り残高情報の公表に係る、新しい公表フォーマットについては、下記の当取引所のホームページよりダウンロードすることができます。

なお、公表フォーマットは、日本語及び英語が併記される方式となっており、下記の日本語ページ及び英語ページに掲載される公表フォーマットは同様のものとなります。

空売り残高情報の公表に係るフォーマット

<http://www.tse.or.jp/market/juran/karauri/announce.html>（日本語ページ）

<http://www.tse.or.jp/english/market/report/announce.html>（英語ページ）

(4) 公表フォーマットに記載される情報について

⁶ なお、新しい取扱いを適用するまでの間は、従来どおり、PDFファイル形式で提供された空売り残高情報について、ZIPファイル形式にまとめたうえで、当取引所のホームページに掲載いたします。

空売り残高に関する情報 Information on Outstanding Short Selling Positions													
公表年月日 Date of Disclosure		①											
計算年月日 Date of Calculation	銘柄コード Code of Stock	銘柄名 (日本語・英語) Name of Stock (Japanese / English)	商号・名称・氏名 Name of Short Seller	住所・所在地 Address of Short Seller	委託者・投資一任契約の相手方の商号・名称・氏名 Name of Discretionary Investment Contractor	委託者・投資一任契約の相手方の住所・所在地 Address of Discretionary Investment Contractor	信託財産・運用財産の名称 Name of Investment Fund	空売り残高割合 Ratio of Short Positions to Buy-in Outstanding	空売り残高数量 Number of Short Positions in Shares	空売り残高数量比率 Number of Short Positions in Total Assets	最近計算年月日 Date of Calculation in Previous Reporting	最近空売り残高割合 Ratio of Short Positions in Previous Reporting	備考 Notes
②	③	④	⑤	⑥	⑦	⑧	⑨	⑩	⑪	⑫	⑬	⑭	⑮

①公表年月日 (Date of Disclosure)

当該ファイルが当取引所によって公表された日付が記載されます。なお、前述2(6)に記載の通り、当取引所においては、原則として、日々、午後4時まで提供された空売り残高情報を対象として集約等を行ったうえで、当日の午後4時30分を目途に当取引所のホームページに掲載するものとします。

②計算年月日 (Date of Calculation)

当該空売り残高情報について、計算年月日が記載されます。

③銘柄コード (Code of Stock)

当該空売り残高情報について、銘柄コードが記載されます。

④銘柄名 (Name of Stock)

当該空売り残高情報について、銘柄名が記載されます。日本語の銘柄名及び英語の銘柄名が併記される方式となります。

⑤商号・名称・氏名 (Name of Short Seller)

当該空売り残高情報について、空売りをを行った者の商号、名称又は氏名が記載されます。但し、空売りを行った者が個人(下記⑩に記載する空売り残高割合が0.05未満である個人に限りません。)である場合には、個人である旨が記載されます。

⑥住所・所在地 (Address of Short Seller)

当該空売り残高情報について、空売りを行った者の住所又は所在地が記載されます。但し、空売りを行った者が個人(下記⑩に記載する空売り残高割合が0.05未満である個人に限りません。)である場合には、空欄とされます。

⑦委託者・投資一任契約の相手方の商号・名称・氏名 (Name of Discretionary Investment Contractor)

当該空売り残高情報について、委託者又は投資一任契約の相手方の商号、名称又は氏名が記載されます。本項目に該当しない場合は、空欄とされます。

⑧委託者・投資一任契約の相手方の住所・所在地 (Address of Discretionary Investment Contractor)

当該空売り残高情報について、委託者又は投資一任契約の相手方の住所又は所在地が記載され
ます。本項目に該当しない場合は、空欄とされます。

⑨信託財産・運用財産の名称 (Name of Investment Fund)

当該空売り残高情報について、信託財産又は運用財産の名称が記載されます。本項目に該当し
ない場合は、空欄とされます。

⑩空売り残高割合 (Ratio of Short Positions to Shares Outstanding)

当該空売り残高情報について、空売り残高割合が記載されます。この場合において、空売り残
高割合は、パーセント表示で記載されます。

⑪空売り残高数量 (Number of Short Positions in Shares)

当該空売り残高情報について、空売り残高数量が記載されます。

⑫空売り残高売買単位数 (Number of Short Positions in Trading Units)

当該空売り残高情報について、空売り残高売買単位数が記載されます。

⑬直近計算年月日 (Date of Calculation in Previous Reporting)

当該空売り残高情報について、直近に提供された残高情報に係る空売り残高割合の計算年月日
が記載されます。本項目に該当しない場合は、空欄とされます。

⑭直近空売り残高割合 (Ratio of Short Positions in Previous Reporting)

当該空売り残高情報について、直近に提供された残高情報に係る空売り残高割合が記載されま
す。本項目に該当しない場合は、空欄とされます。

⑮備考 (Notes)

当該空売り残高情報について、特筆すべき事項がある場合に、その内容が記載されます。本項
目に該当しない場合は、空欄とされます。

(5) ファイルの公表に当たっての留意事項

- ✓ 新しいフォーマットでの空売り残高情報の公表につきましては、実施日以降のもののみを対
象とし、過去に遡及しての集約等及びその公表は行いません。
- ✓ 前述2(7)に記載のとおり、提供されたファイルAにおいて、銘柄コードと銘柄名の間
に不整合があった場合には、当取引所における集約等では、銘柄コードを優先して処理を行
います。
- ✓ 前述2(7)に記載のとおり、提供されたファイルAにおける空売り残高割合等の数値情報
の正確性について、当取引所では一切の確認又は検証を行いません。また、提供された空売
り残高割合等の数値情報については、一切の修正又は加工を行わず、記載された情報に基づ
き集約等を行います。そのため、記載された数値情報に誤りがあった場合には、空売り残高

情報の公表時に予期せぬ結果をもたらす可能性がございますので、空売り残高情報の作成に当たっては十分にご留意ください。

4. 実施時期について

空売り残高情報の提供方法の見直し（前述2）については、空売り規制の総合的な見直しの施行日である本年11月5日（火）を計算年月日として、当取引所に提供する空売り残高情報から適用いたします⁷。

また、空売り残高情報の公表方法の見直し（前述3）については、本年11月7日（木）の午後4時30分を目途に当取引所が公表する空売り残高情報から適用いたします^{8, 9}。

以 上

⁷ 本年11月5日（火）よりも前に、任意に、EXCELファイル形式の新しい統一フォーマットに従って空売り残高情報を作成していただくことも可能ですが、その場合は、従来どおり、当該ファイルをPDFファイル形式に変換し、ZIPファイル形式にまとめたうえでご提供いただくこととなります。

⁸ 新しい公表フォーマット（EXCELファイル形式の単一のファイル）での公表タイミングを統一するための経過的な対応として、本年11月5日（火）を計算年月日として、11月6日（水）の午後4時までに当取引所に空売り残高情報をご提供いただく場合（早期提供の場合）については、11月7日（木）の公表分に含めることといたします（11月6日（水）の公表分には含まれませんのでご注意ください。）。

⁹ 本年11月6日（水）の午後4時以降に、11月5日（火）よりも前の日を計算年月日とする空売り残高情報を当取引所にご提供いただく場合（提供遅延や過去提供分の修正の場合等）については、新しい統一フォーマットに従いEXCELファイル形式でご提供いただくものとします。この場合、提供された空売り残高情報は、従来の基準（One-Tier Model）に従って、新しい公表フォーマット（EXCELファイル形式の単一のファイル）に集約等したうえで、当取引所のホームページに掲載いたします。