

東証先物・オプション取引の清算機関変更に伴う各種担保及び清算関係情報の取扱いについて

株式会社日本証券クリアリング機構
株式会社東京証券取引所

項目	内容	備考								
<p>1. 清算基金・取引証拠金の取扱い</p> <p>(1) 1月30日の預託・返戻の取扱い</p> <p>(2) 先物・オプション取引清算基金・取引証拠金の引継ぎについて</p>	<p>・ 1月30日(金) 預託・返戻分の以下の帳票に記載された余剰額・不足額に応じて、預託・返戻を行ってください。(通常どおりの事務となります。)</p> <table border="1" data-bbox="584 608 1541 852"> <thead> <tr> <th data-bbox="584 608 875 655">担保の種類</th> <th data-bbox="875 608 1541 655">御確認いただく帳票</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="584 655 875 703">現物取引清算基金</td> <td data-bbox="875 655 1541 703">「現物取引清算基金差入・返戻可能表」</td> </tr> <tr> <td data-bbox="584 703 875 804">先物・オプション取引清算基金</td> <td data-bbox="875 703 1541 804">「先物・オプション取引清算基金差入・返戻可能表」</td> </tr> <tr> <td data-bbox="584 804 875 852">取引証拠金</td> <td data-bbox="875 804 1541 852">「取引証拠金差入・返戻可能表」</td> </tr> </tbody> </table> <p>・ 1月30日(金) 現在で東証に預託されている先物・オプション取引清算基金及び取引証拠金は、2月2日(月) にクリアリング機構に引き継がれます。この先物・オプション取引清算基金及び取引証拠金の引継ぎに関しては、清算参加者はクリアリング機構・東証・顧客との間で特段の手続きをする必要はありません。</p>	担保の種類	御確認いただく帳票	現物取引清算基金	「現物取引清算基金差入・返戻可能表」	先物・オプション取引清算基金	「先物・オプション取引清算基金差入・返戻可能表」	取引証拠金	「取引証拠金差入・返戻可能表」	<p>・ 1月30日預託・返戻分の帳票は、DVPWANを御利用の場合は1月29日夜間に配信され、書面による帳票を御利用の場合は、1月30日朝に交付されます。</p> <p>・ 先物・オプション取引清算基金の移行前後の取扱いについては別紙1を御参照ください。</p> <p>・ 先物・オプション取引に関して顧客から預託を受けている委託証拠金についても、顧客との間で特段の手続きをする必要はありません。</p>
担保の種類	御確認いただく帳票									
現物取引清算基金	「現物取引清算基金差入・返戻可能表」									
先物・オプション取引清算基金	「先物・オプション取引清算基金差入・返戻可能表」									
取引証拠金	「取引証拠金差入・返戻可能表」									

項目	内容	備考						
(3) 2月2日の預託・返戻の取扱い	<p data-bbox="582 231 1545 311">・ 2月2日(月)預託・返戻分の以下の帳票に記載された余剰額・不足額に応じて、預託・返戻を行ってください。</p> <table border="1" data-bbox="582 359 1541 510"> <thead> <tr> <th data-bbox="582 359 869 406">担保の種類</th> <th data-bbox="869 359 1541 406">御確認いただく帳票</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="582 406 869 454">清算基金</td> <td data-bbox="869 406 1541 454">「清算基金差入・返戻可能表」^{1 2}</td> </tr> <tr> <td data-bbox="582 454 869 510">取引証拠金</td> <td data-bbox="869 454 1541 510">「取引証拠金差入・返戻可能表」</td> </tr> </tbody> </table> <p data-bbox="627 566 1556 694">1 清算基金現在高は、1月30日(金)現在で東証に預託されている先物・オプション取引清算基金の額と1月30日(金)現在でクリアリング機構に預託されている現物取引清算基金の額の合計額となります。</p> <p data-bbox="627 710 1556 933">2 清算基金所要額は、それまでの計算方式を踏襲するため1月29日(木)夜間に配信される「先物・オプション取引清算基金差入・返戻可能表」の“先物・オプション取引清算基金所要額”と「現物取引清算基金差入・返戻可能表」の“現物取引清算基金所要額”の合計額と同一となります。</p>	担保の種類	御確認いただく帳票	清算基金	「清算基金差入・返戻可能表」 ^{1 2}	取引証拠金	「取引証拠金差入・返戻可能表」	<ul style="list-style-type: none"> <li data-bbox="1590 231 2004 502">・ 2月2日預託・返戻分の帳票は、DVPWANを御利用の場合は1月30日夜間に配信され、書面による帳票を御利用の場合は、2月2日朝に交付されます。 <li data-bbox="1590 518 2004 742">・ 「現物取引清算基金差入・返戻可能表」と「先物・オプション取引清算基金差入・返戻可能表」は統合され「清算基金差入・返戻可能表」となります。 <li data-bbox="1590 758 2004 933">・ 担保の預託・返戻手続きに御利用いただいているOCR伝票については、現行のものがそのまま御利用いただけます。 <li data-bbox="1590 949 2004 1268">・ 預り目的「00～45」(取引証拠金)の預託先・返戻元はクリアリング機構となります。保振代用有価証券の返戻には【HM5-2 <クリアリング機構用> 保管振替代用有価証券 返戻伝票】を御使用ください。
担保の種類	御確認いただく帳票							
清算基金	「清算基金差入・返戻可能表」 ^{1 2}							
取引証拠金	「取引証拠金差入・返戻可能表」							

項目	内容	備考
<p>3 清算関係情報の取扱い</p> <p>(1) DVPWAN 配信データについて</p> <p>(2) 帳票配付について</p> <p>(3) 東証WAN(Target) 及び JSCCWAN の表示について</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・ 1月30日(金) 配信帳票以降、順を追ってDVPWAN 配信データに文言等の変更があります。 ・ 現在配信を行っている「先物・オプション取引清算基金差入・返戻可能表(データ種別: 00600019)」及び「現物取引清算基金差入・返戻可能表(データ種別: 00600020)」は1月29日(木) 配信分をもって廃止し、1月30日(金) 以降、これらの内容は「清算基金差入・返戻可能表(データ種別: 00600009)」により配信します。 ・ 2月2日(月) 配付帳票以降、順を追って配付帳票に文言等の変更があります。 ・ 現在配付を行っている「先物・オプション取引清算基金差入・返戻可能表」は1月30日(金) 配付分をもって廃止し、2月2日(月) 以降、これらの内容は「清算基金差入・返戻可能表」により配付します。 ・ 2月2日(月) 以降、東証WAN(Target) 及び JSCCWAN の表示に一部変更があります。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 別紙3を御参照ください。 ・ 別紙4を御参照ください。 ・ 従来、東証WAN の“届出書類”を通じて「派生商品部」に届け出していた『委託分証拠金所要額の申告』の部署名ボタンが「JSCC」に変更となります。2月2日(月) 以降、届出部署の選択には十分ご注意ください。 ・ 変更箇所と変更画面については、別紙5を御参照ください。

以上

東証先物・オプション取引の清算機関変更に伴う移行時の清算基金の取扱いについて

(東証総合取引参加者)

項目	～1月30日		移行処理(2月2日朝実施)	2月2日～
預り目的コード	60	65		60
所要額	現物取引清算基金 (A)	先物・オプション取引清算基金 (B)		清算基金 ¹ (C)
預り目的と差入れ先及び保管先の関係				
備考	<ul style="list-style-type: none"> 2月2日にクリアリング機構の先物・オプション取引に係る清算資格を取得する場合は、1月30日に東証の「先物・オプション取引清算基金」を東証に預託していることが条件となります。 		<ul style="list-style-type: none"> 2月2日の朝、東証は、東証に「先物・オプション取引清算基金」として預託されている金銭及び代用有価証券を、参加者に代って「清算基金」としてクリアリング機構に預託します。 	<ul style="list-style-type: none"> 2月2日以後における「清算基金」の預託・返戻については、クリアリング機構との間で行うこととなります²。

1 2月2日以後の清算基金所要額(C)はそれまでの計算方式を踏襲するため、現物取引清算基金の所要額(A)と先物・オプション取引清算基金の所要額(B)の合計額となります。

2 東証の「先物・オプション取引清算基金」は2月2日に廃止されますので、2月2日以後、東証に預託する必要はありません。

(国債先物等取引参加者・株価指数先物等取引参加者・株券オプション取引参加者)

項目	～1月30日	移行処理(2月2日朝実施)	2月2日～
預り目的コード	65		60
所要額	先物・オプション取引清算基金 (D)		清算基金 ³ (E)
預り目的と差入れ先及び保管先の関係	<p>東証 (東証先物・オプション取引の清算機関) 65</p> <p>クリアリング機構 (現物取引の清算機関) 65</p> <p>国債先物等取引参加者 株価指数先物等取引参加者 株券オプション取引参加者</p> <p>----- D</p>	<p>東証 (東証先物・オプション取引の清算機関) 65</p> <p>クリアリング機構 (現物取引の清算機関) 60</p> <p>国債先物等取引参加者 株価指数先物等取引参加者 株券オプション取引参加者</p>	<p>クリアリング機構 (現物取引及び東証先物・オプション取引の清算機関) 60</p> <p>国債先物等取引参加者 株価指数先物等取引参加者 株券オプション取引参加者</p> <p>----- E (= D)³</p>
備考	<ul style="list-style-type: none"> 2月2日にクリアリング機構の先物・オプション取引に係る清算資格を取得する場合は、1月30日に東証の「先物・オプション取引清算基金」を東証に預託していることが条件となります。 	<ul style="list-style-type: none"> 2月2日の朝、東証は、東証に「先物・オプション取引清算基金」として預託されている金銭及び代用有価証券を、参加者に代って「清算基金」としてクリアリング機構に預託します。 	<ul style="list-style-type: none"> 2月2日以後における「清算基金」の預託・返戻については、クリアリング機構との間で行うこととなります⁴。

3 2月2日以後の清算基金所要額(E)については、それまでの計算方式を踏襲するため、先物・オプション取引清算基金の所要額(D)と同一となります。

4 東証の「先物・オプション取引清算基金」は2月2日に廃止されますので、2月2日以後、東証に預託する必要はありません。

移行時における清算基金所要額の表示等について

移行に伴う各清算基金差入・返戻可能表の表示及び各清算基金の所要額は以下の(基金推移表)のとおりとなります。

～(基金推移表)のデータ設定例～

- ・東証総合取引参加者は、現物取引清算基金、先物・オプション取引清算基金につき所要額・預託額が右表のとおりあるものとします。
- ・上記以外の東証取引参加者は、先物・オプション取引清算基金について所要額・預託額が右表のとおりあるものとします。
- ・日々の預託額は変わらないものとします。
- ・現物取引清算基金の余剰額は前日担保に利用するものとします。

(単位:万円)

	所要額	預託額
現物取引清算基金	3,000	7,000
先物・オプション取引清算基金	2,000	2,500

(基金推移表)

東証総合取引参加者

(単位:万円)

帳票名	DVPWAN配信日付	1月28日	1月29日	1月30日	2月2日	2月3日
	項目名					
現物取引清算基金 差入・返戻可能表	現在高	7,000	7,000			
	所要額	3,000	3,000	配信せず	配信せず	配信せず
	余剰額	4,000	4,000			
	前日担保利用額	4,000	4,000			
先物・オプション取引清算基金 差入・返戻可能表	現在高	2,500	2,500			
	所要額	2,000	2,000	配信せず	配信せず	配信せず
	余剰額	500	500			
清算基金 差入・返戻可能表	現在高			9,500	9,500	9,500
	所要額	配信せず	配信せず	5,000	5,000	5,000
	余剰額			4,500	4,500	4,500
	前日担保利用額			4,000	4,500	4,500

(項目説明)

- 1/30配信の現在高は、現物取引清算基金と先物・オプション取引清算基金をあわせた額となります。
- 1/30配信の所要額は、現物取引清算基金と先物・オプション取引清算基金をあわせた額となります。
- 1/30配信の前日担保利用額は、現物取引清算基金の余剰額が対象となります。
- 2/2配信以降の前日担保利用額は、清算基金の余剰額が対象となります。

国債先物等取引参加者/株価指数先物等取引参加者/株券オプション取引参加者

(単位:万円)

帳票名	紙帳票配付日付	1月29日	1月30日	2月2日	2月3日	2月4日
	項目名					
先物・オプション取引清算基金 差入・返戻可能表	現在高	2,500	2,500			
	所要額	2,000	2,000	配布せず	配布せず	配布せず
	余剰額	500	500			
清算基金 差入・返戻可能表	現在高			2,500	2,500	2,500
	所要額	配布せず	配布せず	2,000	2,000	2,000
	余剰額			500	500	500
	前日担保利用額			0	0	0

DVPWAN帳票の変更点等について

別紙 3

変更日は配信日ベースとなります。

項番	帳票名	帳票コード	変更日	変更内容
1	株券オプション取引権利行使 申告割当明細表 / 清算引受明細表:東証分	00100010	2月2日	・帳票名を「株券オプション取引権利行使申告・割当明細表:東証分」に変更 (Webメニュー画面/ボタン名/検索名及び同報通知画面の帳票名の変更) ・表下部の発行元を「株式会社 日本証券クリアリング機構」に変更 (旧帳票の発行元は「(株)東京証券取引所、(株)日本証券クリアリング機構」の連名) ・表上部の注釈を削除
2	総受払代金計算表(予定額/速報)	00200005	2月2日	・表中の文言変更: 「先物・オプション取引総括清算表」総受払代金/東証分 「先物・オプション取引総括清算表」総受払代金
	総受払代金計算表(予定額)	00200007	1月30日	
	総受払代金計算表(確定額)	00300002	2月2日	
3	代金領収通知	00300004	2月2日	・表中の文言変更: 「先物・オプション取引総括清算代金/東証分」 「先物・オプション取引総括清算代金」
4	前日担保残高表	00600010	2月2日	・表下部の注釈1を変更 「前日担保利用額とは、……、現物取引清算基金残高の……」 「前日担保利用額とは、……、清算基金残高の……」
5	受払状況表(東証参加者用)	00600011	2月2日	・表中の預り目的の変更: (旧帳票で表示されていた取引証拠金に係る預り目的(1)は、「受払状況表(清算参加者用)」 に表示される) (旧帳票で表示されていた預り目的「先物基金」は削除)
	受払状況表(清算参加者用)	00600012		・表中の預り目的の変更: 「現物基金」「清算基金」、取引証拠金に係る預り目的(1)の追加
6	預り有価証券等残高通知(東証参加者用)	00600013	2月2日	・画面上部プルダウンメニューの預り目的の変更: (旧帳票で画面上部プルダウンメニューに表示されていた取引証拠金に係る預り目的(2)は、 「預り有価証券等残高通知(清算参加者用)」に表示される) (旧帳票で表示されていた預り目的「先物・オプション取引清算基金」は削除)
	預り有価証券等残高通知(清算参加者用)	00600014		・画面上部プルダウンメニューの預り目的の変更: 「現物取引清算基金」「清算基金」、取引証拠金に係る預り目的(2)の追加
7	実質株主担保受入残高通知(東証参加者用)	00600015	2月3日	・画面上部プルダウンメニューの預り目的の変更: (旧帳票で画面上部プルダウンメニューに表示されていた取引証拠金に係る預り目的(2)は、 「実質株主担保受入残高通知(清算参加者用)」に表示される) (旧帳票で表示されていた預り目的「先物・オプション取引清算基金」は削除)
	実質株主担保受入残高通知(清算参加者用)	00600016		・画面上部プルダウンメニューの預り目的の変更: 「現物取引清算基金」「清算基金」、取引証拠金に係る預り目的(2)の追加
8	転換社債利金関係残高通知(東証参加者用)	00600017	2月2日	・画面上部プルダウンメニューの預り目的の変更: (旧帳票で画面上部プルダウンメニューに表示されていた取引証拠金に係る預り目的(2)は、 「転換社債利金関係残高通知(清算参加者用)」に表示される) (旧帳票で表示されていた預り目的「先物・オプション取引清算基金」は削除)

項番	帳票名	帳票コード	変更日	変更内容
	転換社債利金関係残高通知(清算参加者用)	00600018		・画面上部プルダウンメニューの預り目的の変更: 「現物取引清算基金」、「清算基金」、取引証拠金に係る預り目的 ⁽²⁾ の追加
9	取引証拠金差入・返戻可能表	00600003	1月30日	・表下部の発行元を「株式会社 日本証券クリアリング機構」に変更
10	清算基金差入・返戻可能表	00600009	1月30日 (配信開始日)	<旧帳票「清算基金差入・返戻可能表」に対する変更点> (移行時における清算基金所要額の表示例は”別紙2”を参照) ・表下部発行元を「株式会社 日本証券クリアリング機構」に変更 ・所要額内訳の表中の文言変更: 「現物取引等所要額」、「現物取引所要額」 ・画面下部の注釈を追加 「5 現物取引所要額には株券オプション取引所要額が含まれています。」
11	現物取引清算基金差入・返戻可能表	00600020	1月30日 (配信停止日)	移行時における清算基金所要額の表示例は”別紙2”を参照
12	先物・オプション取引清算基金差入・返戻可能表	00600019		
13	国債DVP決済に係る遅延損害金明細書	00410002	2月2日	・表下部の発行元を「株式会社 日本証券クリアリング機構」に変更 ・表下部の注釈を変更 「整理通番の…、国債現物取引に係る遅延損害金(日本証券クリアリング機構分)」 「整理通番の…、国債現物取引に係る遅延損害金」 「整理通番の…、国債先物取引の受渡決済に係る遅延損害金(東証分)」 「整理通番の…、国債先物取引の受渡決済に係る遅延損害金」

1 「自己」「直接預託」「取次差換」「差換預託」「非自直接」「非自差換」「非委直接」「非委取差」「非委差換」

2 「取引証拠金(清算参加者自己)」「取引証拠金(清算参加者委託(直接預託))」「取引証拠金(清算参加者委託(取次者差換預託))」

「取引証拠金(清算参加者委託(差換預託))」「取引証拠金(非清算参加者自己(直接預託))」「取引証拠金(非清算参加者自己(差換預託))」

「取引証拠金(非清算参加者委託(直接預託))」「取引証拠金(非清算参加者委託(取次者差換預託))」「取引証拠金(非清算参加者委託(差換預託))」

書面配付による帳票の変更点について

別紙 4

以下の帳票につき、2月3日(印がついている帳票は2月2日)配付分より変更となります。

項番	帳票名	変更内容
1	国債証券先物取引仮売買明細表(イブニング・セッション)	・帳票名を「国債証券先物取引 仮売買明細表 / 仮清算引受明細表(イブニング・セッション)」に変更 ・表右下部の発行元を「株式会社 東京証券取引所、株式会社 日本証券クリアリング機構」の連名に変更 ・表下部に注釈「当帳票は清算参加者には仮売買明細表兼仮清算引受明細表として、非清算参加者には仮売買明細表として配信しております。」を追加
2	国債証券先物限月間スプレッド取引仮売買明細表(イブニング・セッション)	・帳票名を「国債証券先物限月間スプレッド取引 仮売買明細表 / 仮清算引受明細表(イブニング・セッション)」に変更 ・表右下部の発行元を「株式会社 東京証券取引所、株式会社 日本証券クリアリング機構」の連名に変更 ・表下部に注釈「当帳票は清算参加者には仮売買明細表兼仮清算引受明細表として、非清算参加者には仮売買明細表として配信しております。」を追加
3	国債証券先物取引売買明細表	・帳票名を「国債証券先物取引 売買明細表 / 清算引受明細表」に変更 ・表右下部の発行元を「株式会社 東京証券取引所、株式会社 日本証券クリアリング機構」の連名に変更 ・表下部に注釈「当帳票は清算参加者には売買明細表兼清算引受明細表として、非清算参加者には売買明細表として配信しております。」を追加
4	国債証券先物限月間スプレッド取引売買明細表	・帳票名を「国債証券先物限月間スプレッド取引 売買明細表 / 清算引受明細表」に変更 ・表右下部の発行元を「株式会社 東京証券取引所、株式会社 日本証券クリアリング機構」の連名に変更 ・表下部に注釈「当帳票は清算参加者には売買明細表兼清算引受明細表として、非清算参加者には売買明細表として配信しております。」を追加
5	国債証券先物取引建玉残高表	・表右下部の発行元を「株式会社 日本証券クリアリング機構」に変更
6	国債証券先物取引建玉残高表(権利行使対応確定分)	・表右下部の発行元を「株式会社 日本証券クリアリング機構」に変更
7	長期国債先物オプション取引仮取引明細表(イブニング・セッション)	・帳票名を「長期国債先物オプション取引 仮取引明細表 / 仮清算引受明細表(イブニング・セッション)」に変更 ・表右下部の発行元を「株式会社 東京証券取引所、株式会社 日本証券クリアリング機構」の連名に変更 ・表下部に注釈「当帳票は清算参加者には仮取引明細表兼仮清算引受明細表として、非清算参加者には仮取引明細表として配信しております。」を追加
8	長期国債先物オプション取引取引明細表	・帳票名を「長期国債先物オプション取引 取引明細表 / 清算引受明細表」に変更 ・表右下部の発行元を「株式会社 東京証券取引所、株式会社 日本証券クリアリング機構」の連名に変更 ・表下部に注釈「当帳票は清算参加者には取引明細表兼清算引受明細表として、非清算参加者には取引明細表として配信しております。」を追加
9	長期国債先物オプション取引建玉残高表	・表右下部の発行元を「株式会社 日本証券クリアリング機構」に変更
10	長期国債先物オプション取引権利行使申告・割当明細表	・表上部の「取引日」を「権利行使日」に変更 ・表の右下部の発行元を「株式会社 日本証券クリアリング機構」に変更
11	株価指数先物取引取引明細表	・帳票名を「株価指数先物取引 取引明細表 / 清算引受明細表」に変更 ・表右下部の発行元を「株式会社 東京証券取引所、株式会社 日本証券クリアリング機構」の連名に変更 ・表下部に注釈「当帳票は清算参加者には取引明細表兼清算引受明細表として、非清算参加者には取引明細表として配信しております。」を追加

項番	帳票名	変更内容
12	株価指数先物限月間スプレッド取引取引明細表	・帳票名を「株価指数先物限月間スプレッド取引 取引明細表 / 清算引受明細表」に変更 ・表右下部の発行元を「株式会社 東京証券取引所、株式会社 日本証券クリアリング機構」の連名に変更 ・表下部に注釈「 当帳票は清算参加者には取引明細表兼清算引受明細表として、非清算参加者には取引明細表として配信しております。」を追加
13	株価指数先物取引建玉残高表	・表右下部の発行元を「株式会社 日本証券クリアリング機構」に変更
14	TOPIXオプション取引取引明細表	・帳票名を「TOPIXオプション取引 取引明細表 / 清算引受明細表」に変更 ・表右下部の発行元を「株式会社 東京証券取引所、株式会社 日本証券クリアリング機構」の連名に変更 ・表下部に注釈「 当帳票は清算参加者には取引明細表兼清算引受明細表として、非清算参加者には取引明細表として配信しております。」を追加
15	TOPIXオプション取引建玉残高表	・表右下部の発行元を「株式会社 日本証券クリアリング機構」に変更
16	TOPIXオプション取引権利行使申告・割当明細表	・表上部の「取引日」を「権利行使日」に変更 ・表の右下部の発行元を「株式会社 日本証券クリアリング機構」に変更
17	株券オプション取引取引明細表	・帳票名を「株券オプション取引 取引明細表 / 清算引受明細表」に変更 ・表右下部の発行元を「株式会社 東京証券取引所、株式会社 日本証券クリアリング機構」の連名に変更 ・表下部に注釈「 当帳票は清算参加者には取引明細表兼清算引受明細表として、非清算参加者には取引明細表として配信しております。」を追加
18	株券オプション取引建玉残高表	・表右下部の発行元を「株式会社 日本証券クリアリング機構」に変更
19	株券オプション取引権利行使申告・割当明細表 / 清算引受明細表: 東証分	・帳票名を「株券オプション取引 権利行使申告・割当明細表: 東証分」に変更 ・表上部の注釈を削除 ・表右下部の発行元を「株式会社 日本証券クリアリング機構」に変更
20	先物取引引直差金・更新差金明細表	・表右下部の発行元を「株式会社 日本証券クリアリング機構」に変更
21	先物・オプション取引総括清算表	・表右下部の発行元を「株式会社 日本証券クリアリング機構」に変更
22	総受払代金計算表(予定額)	・表中の文言変更: 「先物・オプション取引総括清算表」総受払代金 / 東証分 「先物・オプション取引総括清算表」受払代金
23	国債先物取引建玉決済受渡明細表	・表上部の「売買対象銘柄」を「対象銘柄」に変更
24	国債先物取引銘柄間格差調整金明細表	・表上部の「売買対象銘柄」を「対象銘柄」に変更
25	国債先物取引課税・非課税別申告書	・表上部の「売買対象銘柄」を「対象銘柄」に変更 ・表下部の発行元を「株式会社 日本証券クリアリング機構」に変更
26	国債先物取引課税・非課税別申告明細表	・表上部の「売買対象銘柄」を「対象銘柄」に変更 ・表下部の発行元を「株式会社 日本証券クリアリング機構」に変更
27	国債先物取引課税・非課税別割当指定書	・表上部の「売買対象銘柄」を「対象銘柄」に変更 ・表下部の発行元を「株式会社 日本証券クリアリング機構」に変更
28	国債先物取引課税・非課税別数量変更通知書	・表上部の「売買対象銘柄」を「対象銘柄」に変更 ・表下部の発行元を「株式会社 日本証券クリアリング機構」に変更
29	国債先物取引決済物件申告書	・表上部の「売買対象銘柄」を「対象銘柄」に変更 ・表下部の発行元を「株式会社 日本証券クリアリング機構」に変更
30	国債先物取引店内受渡申告書	・表上部の「売買対象銘柄」を「対象銘柄」に変更 ・表下部の発行元を「株式会社 日本証券クリアリング機構」に変更

項番	帳票名	変更内容
31	受払状況表	<ul style="list-style-type: none"> 発行元が東証である受払状況表から「取引証拠金」に係る預り目的(1)を削除 発行元がクリアリング機構の受払状況表に「取引証拠金」に係る預り目的を追加 発行元が東証である受払状況表から預り目的「先物・オプション取引清算基金」を削除 発行元がクリアリング機構の受払状況表に「清算基金」として統合
32	取引証拠金差入・返戻可能表	<ul style="list-style-type: none"> 表下部の発行元を「株式会社 日本証券クリアリング機構」に変更
33	実質株主担保受入残高通知	<ul style="list-style-type: none"> 東証参加者用の帳票から「取引証拠金」に係る預り目的(1)を削除 清算参加者用の帳票に「取引証拠金」に係る預り目的を追加 東証参加者用の帳票から預り目的「先物・オプション取引清算基金」を削除 清算参加者用の帳票に「清算基金」として統合
34	転換社債利金関係残高通知	
35	預り有価証券等残高通知書	
36	清算基金差入・返戻可能表	<p><旧帳票「清算基金差入・返戻可能表」に対する変更点> (移行時の清算基金所要額の表示例は”別紙2”を参照)</p> <ul style="list-style-type: none"> 表下部発行元を「株式会社 日本証券クリアリング機構」に変更 所要額内訳の表中の文言変更:「現物取引等所要額」「現物取引所要額」 画面下部の注釈を追加「5 現物取引所要額には株券オプション取引所要額が含まれています。」
37	緊急取引証拠金 所要額・過不足額表	<ul style="list-style-type: none"> 表下部の発行元を「株式会社 日本証券クリアリング機構」に変更

1 「自己」「委託直接預託」「委託取次者差換預託」「委託差換預託」「非清算自己直接預託」「非清算自己差換預託」
「非清算委託直接預託」「非清算委託取次差換預託」「非清算委託差換預託」

JSCCWAN及び東証WAN(Target)の変更点について

別紙 5

(1) JSCCWANの変更点

2月2日より下表の箇所が変更・追加となります。

タブ名 (第一階層)	画面左側ボタン (第二階層)	画面中央ボタン(新規ボタン名) (第三階層)	変更内容	主な掲載情報
提供書類	先物・オプション取引関係 (新規追加ボタン)	(銘柄関係) 国債証券先物取引等関係	左記ボタンを追加	
		(銘柄関係) 株価指数先物取引等関係	"	
		(銘柄関係) 株券オプション取引関係	"	
		(銘柄関係) その他	"	代用有価証券からの除外
		(決済関係) 国債証券先物取引等関係	左記ボタンを追加	<ul style="list-style-type: none"> 中心限月取引の交代について 清算値段の算出に係る理論スプレッド値段の設定 国債先物取引の受渡決済事務について 中心限月取引の交代について
		(決済関係) 株価指数先物取引等関係	"	
		(決済関係) 株券オプション取引関係	"	
		(決済関係) その他	"	
		(SPAN関係) SPANパラメータ関係	左記ボタンを追加	<ul style="list-style-type: none"> SPANパラメータの設定/定例見直し SPANパラメータの追加設定 SPANパラメータの一部変更 SPAN商品コードの追加 SPANパラメータの取扱い
		(SPAN関係) 緊急取引証拠金関係	"	<ul style="list-style-type: none"> 緊急取引証拠金基準限月の交代について 緊急取引証拠金の預託について
	(SPAN関係) その他	"		
	代表者宛通知		清算参加者代表者(現物清算参加者)	ボタン名を変更: 「清算参加者代表者」 「清算参加者代表者(現物清算参加者)」
清算参加者代表者(国債先物等清算参加者)			左記ボタンを追加	
清算参加者代表者(株価指数先物等清算参加者)			"	
清算参加者代表者(株券オプション清算参加者)			"	
届出書類	フォーマット集	提出書類フォーマット(証券会社用) (従来の「提出書類フォーマット」のボタン名を変更)	ボタン名を変更: 「提出書類フォーマット」 「提出書類フォーマット(証券会社用)」	
		提出書類フォーマット(登録金融機関用)	ボタン名を変更: 「フォーマット集」 「提出書類フォーマット(登録金融機関用)」	届出・報告等のフォーマット
		証明書フォーマット	従来の「証明書フォーマット」のボタン配置を変更	<ul style="list-style-type: none"> 建玉残高証明書を追加 権利行使申告・割当証明書を追加

(2) 東証WAN(Target)の変更点

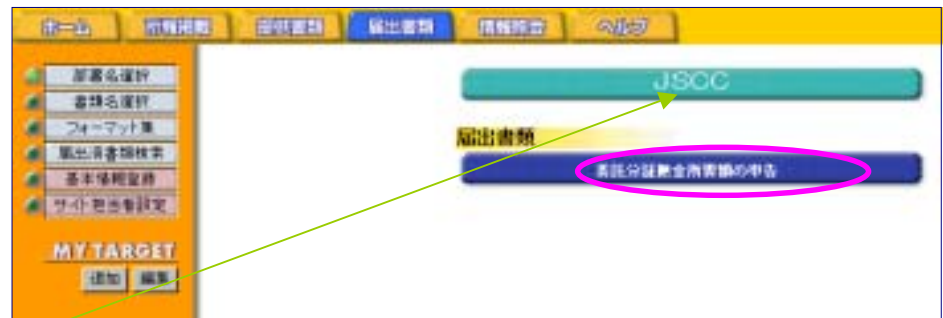
2月2日より下表の箇所が変更となります。

タブ名 (第一階層)	画面左側ボタン (第二階層)	画面中央ボタン(新規ボタン名) (第三階層)	変更内容	画面中央ボタン (第四階層)
届出書類	部署名選択	派生商品部	届出書類の変更: 「委託分証拠金所要額の申告」ボタンを 第三階層の”JSCC”ボタンへと移動	<ul style="list-style-type: none"> 株価指数先物取引大口対当取引報告書 株価指数オプション取引大口対当取引報告書 株券オプション取引大口対当取引報告書 株券オプション取引大口建玉報告書 株券オプション取引のマーケットメイクに係る建玉報告書
		JSCC (新規追加ボタン)	部署名に左記ボタンを追加 「委託分証拠金所要額の申告」ボタンを設定	<ul style="list-style-type: none"> 委託分証拠金所要額の申告

(注) 現在東証WANに掲載している情報のうち、以下の情報については、2月2日以降JSCCWANに掲載いたします。

- ・SPAN商品コード
- ・「SPAN関連業務」の概要
- ・緊急取引証拠金基準限月の交代について
- ・受渡決済に係る事務等(国債先物取引)
- ・国債先物取引の受渡決済状況

(変更後画面イメージ)



・従来、「派生商品部」に届け出していた「委託分証拠金所要額申告」の申告先が「JSCC」に変更となります。
 なお、「委託分証拠金所要額申告」以外の届出書類の届出先に変更はありません。

清算基金差入・返戻可能表

差入・返戻日 2004年2月2日
 清算基金残高 2004年1月30日現在

兜証券
 コード 99905

単位:円

○現在高等

	清算基金現在高	清算基金所要額	清算基金余剰(不足)額	
				前日担保利用額
現金	6,134,993,827			
代用有価証券				
合計	6,134,993,827	6,134,993,827		

単位:円

○所要額内訳

現物取引所要額	3,900,863,827
国債先物取引等所要額	115,320,000
受渡決済割増所要額	
株価指数先物取引等所要額	2,118,810,000

最終差引建玉がある場合、取引最終日から受渡決済最終日までの間、所要額が変更となります。

単位:円

(参考)

次回清算基金所要額 (----年--月--日から適用)	
銘柄別受渡決済割増額	14年6月限月
中期国債先物取引	270,000
長期国債先物取引	640,000
超長期国債先物取引	1,310,000

次回所要額は、月初10営業日目の日(9営業日目夜間)に通知されます。また、月初15営業日目の日に適用される所要額に基づく差入・返戻の手続きは、月初16営業日目の日に行います。

銘柄別受渡決済割増額については、2月・5月・8月・11月の月初10営業日目の日(9営業日目夜間)に通知されます。

- ※1 前日担保利用額とは、「差入・返戻日」当日の株券等DVP決済において、清算基金残高の余剰額のうち、(受領有価証券金額±値洗差金額-前日担保現在高)を限度とし、前日担保に準じて取扱う予定額を意味します。
- ※2 次回清算基金所要額には、国債先物取引に係る受渡決済割増所要額は含まれません。
- ※3 前日担保利用額に相当する額は、返戻申込日の株券等DVP決済に係る資金決済支払時限(14:15)以降に返戻を実行します。
- ※4 銘柄別受渡決済割増額は、額面1億円あたり金額です。
- ※5 現物取引所要額には株券オプション取引所要額が含まれています。