

先物・オプション取引に係る清算機関の変更 に伴うWANテスト実施要領

実施日：平成16年1月10日(土)

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

~ 目次 ~

1 . テストの目的.....	1
2 . テスト対象者.....	1
3 . テスト環境.....	1
4 . テスト実施日等.....	2
5 . テストスケジュール・確認事項.....	2
6 . テストデータについて.....	7
7 . テスト参加申込みについて.....	8
8 . 連絡先.....	9

1．テストの目的

本テストは、(株)東京証券取引所(以下「東証」といいます。)の先物・オプション取引に係る証券取引清算機関を東証から(株)日本証券クリアリング機構(以下「クリアリング機構」といいます。)に変更することに伴い、清算・決済業務の円滑な導入及び移行に向け、次の事項を目的として実施いたします。

- (1) J S C C W A N / 決済情報システム(以下「D V P W A N」といいます。)を通じて参加者へ配信を行う帳票のうち、今回の対応に伴い変更がある帳票の内容確認
- (2) J S C C W A N 及び東証 W A N の変更点(メニューの変更及び追加、ボタンの追加等)の確認

本テストでは「清算情報ファイル伝送サービス」の配信は行いません。

2．テスト対象者

クリアリング機構の清算参加者、クリアリング機構の清算参加者となる予定の証券会社等、クリアリング機構、東証

本テストの参加形態は任意とします。

本テストにおいては、保振機構とのシステム接続は行いません。

3．テスト環境

本テストにおけるシステムは本番環境を使用します。

4. テスト実施日等

- (1) テスト実施日 平成 16 年 1 月 10 日(土) 10:00~14:00 に実施します。
- (2) テスト設定日 当日を平成 16 年 2 月 9 日(月)とみなしたテストを行います。
- (3) データ基準日 本テストでは一律ダミーデータを設定するため、各帳票で異なります。

5. テストスケジュール・確認事項

(1) DVPWAN

本項目の対象：現在、クリアリング機構の清算資格を持つ参加者

DVPWANでご確認頂く配信帳票は次のとおりです。テスト当日は、各帳票が既に配信された状態となっていますので、テスト時間内(10:00~14:00)にご確認ください。なお、各データについては、各業務(「照合業務」/「決済業務」/「担保管理」)画面の左に表示される「本日の配信情報」ボタンで日付「2004年2月9日」を指定してご覧ください。

DVPWANによる配信帳票名等	確認事項	チェック	(参考)本番配信日時	
清算基金差入・返戻可能表	<旧帳票「清算基金差入・返戻可能表」に対する変更点> ・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。」		1/30	22:30~

DVPWANによる配信帳票名等	確認事項	チェック	(参考)本番配信日時	
取引証拠金差入・返戻可能表	・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		1/30	22:30～
総受払代金計算表(予定額/速報)	・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」		2/2	14:30～
総受払代金計算表(予定額)			1/30	22:00～
総受払代金計算表(確定額)			2/2	～13:30
代金領収通知	・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」		2/2	14:45～
受払状況表(東証参加者用)	・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)		2/2	16:00～
受払状況表(清算参加者用)		・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の追加		
前日担保残高表	・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・・・」		2/2	22:30～
預り有価証券等残高通知(東証参加者用)	・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)		2/2	22:30～
預り有価証券等残高通知(清算参加者用)	・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の追加		2/2	22:30～

DVPWANによる配信帳票名等	確認事項	チェック	(参考)本番配信日時	
転換社債利金関係残高通知(東証参加者用)	(預り有価証券等残高通知(東証参加者用)と同様の変更)		2/2	22:30~
転換社債利金関係残高通知(清算参加者用)	(預り有価証券等残高通知(清算参加者用)と同様の変更)			
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	<ul style="list-style-type: none"> ・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 		2/2	23:00~
実質株主担保受入残高通知(東証参加者用)	(預り有価証券等残高通知(東証参加者用)と同様の変更)		2/3	08:30~
実質株主担保受入残高通知(清算参加者用)	(預り有価証券等残高通知(清算参加者用)と同様の変更)			
国債DVP決済に係る遅延損害金明細書	<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 ・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」 		2/5	22:30~
< DVPWAN 閲覧終了 >				

(2) J S C C W A N

本項目の対象：全参加者

J S C C W A Nに係る確認事項は次のとおりです。なお、閲覧可能時刻は 10 : 00 ~ 14 : :00 です。

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	チェック	
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	"		
		(決済関係) 国債証券先物取引等関係	左記ボタンを追加		
		(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	"		
		(S P A N関係) S P A Nパラメータ関係	左記ボタンを追加		
		(S P A N関係) 緊急取引証拠金関係	"		
	(S P A N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)		"			

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	チェック
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)」	
		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	

(3) 東証WAN

本項目の対象：現在、東証の取引資格を持つ参加者

東証WANに係る確認事項は次のとおりです。なお、閲覧可能時刻は10:00~14:00です。

データの入力を行わないでください。

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	チェック
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」ボタンへと移管	
		JSCC	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	

6. テストデータについて

本テストのうち、DVPWAN配信帳票には一律ダミーデータを設定します。各データの設定内容は以下のとおりです。

#	配信帳票名	ダミーデータ設定内容
1	株券オプション取引権利行使申告・割当明細表：東証分	・権利行使データ（売）を一律設定
2	総受払代金計算表（予定額/速報）	・「株券等DVP受払代金（予定額）」に一律、支払1,000万を設定
	総受払代金計算表（予定額）	・「株券等DVP受払代金（予定額）」に一律、支払1,000万を設定
	総受払代金計算表（確定額）	・「先物・オプション取引総括清算表受払代金」に一律、支払1,000万を設定（東証取引参加者）
3	代金領収通知	対象：JSCC清算参加者（現物）かつ資金決済銀行利用参加者 ・「株券等DVP受払代金」に一律、1,000万を設定） ・「先物・オプション取引総括清算代金」に一律、1,000万を設定（東証取引参加者）
4	受払状況表（東証参加者用）	・信認金及び保証金に一律、現金入金1,000万設定
	受払状況表（清算参加者用）	・取引証拠金及び清算基金に一律、現金入金1,000万設定（東証取引参加者）
5	前日担保残高表	・「前日担保現在高」に現金1,000万円を設定
6	預り有価証券等残高通知（東証参加者用）	・保証金及び信認金に一律、現金1,000万円設定
	預り有価証券等残高通知（清算参加者用）	・取引証拠金及び清算基金に一律、現金1,000万円設定（東証取引参加者）
7	実質株主担保受入残高通知（東証参加者用）	・保証金及び信認金に一律、ダミー銘柄1,000株設定
	実質株主担保受入残高通知（清算参加者用）	・取引証拠金及び清算基金に一律、ダミー銘柄1,000株設定（東証取引参加者）

#	配信帳票名	ダミーデータ設定内容
8	転換社債利金関係残高通知 (東証参加者用)	・保証金及び信認金に一律、ダミー銘柄 額面 1,000 千円設定
	転換社債利金関係残高通知 (清算参加者用)	・取引証拠金及び清算基金に一律、ダミー銘柄 額面 1,000 千円設定 (東証取引参加者)
9	取引証拠金差入返戻可能表	・所要額に一律、1,000 万円を設定 (東証取引参加者) ・現在高に一律、現金 1,000 万円を設定 (東証取引参加者)
10	清算基金差入・返戻可能表	・所要額内訳として一律、現物分 3,000 万、国債先物分及び指数先物分各 1,000 万を設定 ・現在高として一律、現金 3,000 万、代用有価証券 2,000 万を設定
11	国債 D V P 遅延損害金明細書	・ダミー銘柄の支払データを一律設定

7. テスト参加申込みについて

今回のテストにつき、皆様の参加状況を把握する必要から、別紙「先物・オプション取引に係る清算機関の変更に伴う W A N テストの参加申込書」により参加の可否をご記入の上、平成 15 年 12 月 26 日 (金) までに次の送信先まで F A X 送信をお願いします。

テストの参加・不参加に関わらず、必ず申込書の F A X 送信をお願いします。

FAX 送信先 < テスト参加申込書 > 0 3 (3 6 6 5) 1 2 3 5 (株) 日本証券クリアリング機構

8 . 連絡先

テストの内容に関するお問い合わせは、以下の連絡先までお願いします。

(1) テスト実施日当日のお問合せ先

a. (株)日本証券クリアリング機構

電話：03 - 3665 - 1381 E-mail：info@jsc.co.jp FAX：03 - 3665 - 1235

b. WAN運用ヘルプデスク

電話：03 - 3615 - 9865 E-mail：help@target.ne.jp FAX：03 - 3615 - 9867

(2) テスト実施日以外の日でのお問合せ先

a. テスト内容、WAN決済情報の内容等業務面に関するお問合せ

(株)日本証券クリアリング機構

電話：03 - 3665 - 1381 E-mail：info@jsc.co.jp

b. WANシステムの技術面に関するお問合せ

(株)東京証券取引所 情報システム部WAN担当

電話：03 - 3666 - 0141 (代) E-mail：tsewan@tse.or.jp / tsewan_admin01@target.ne.jp

以 上

別紙

先物・オプション取引に係る清算機関の変更に伴うWANテストの参加申込書

1. テストに関するご連絡先

会社名 _____

部署名 _____

ご役職名・ご氏名 _____ 様

TEL:() - _____

FAX:() - _____

2. テスト参加予定

「参加予定」欄、「参加・不参加」のどちらかを で囲んでください。

	日 程	参加予定
WANテスト	H16.1.10(土)	参加 ・ 不参加

3. テスト当日の連絡先

テスト当日にご連絡が可能な方をご記入ください。(1.テストに関するご連絡先と同様の場合、ご記入は不要です。)

会社名 _____

ご住所 _____

ご連絡先 _____ 様

TEL:() - _____

ご協力ありがとうございます。