

上場デリバティブ市場に係るポストトレードの対応

I. 清算値段の確定・配信時刻及び取引証拠金パラメータの配信時刻： 原則として30分後ろ倒し (青字箇所)

II. 取引証拠金及び差金代金の配信時刻： 変更なし

III. 各種ポストトレード業務に係る時限： 建玉移管申告のみ30分後ろ倒し (青字箇所)

- 建玉確定時限 (19時)、それまでに行われる各種申告 (ギブアップ・テイクアップ、アロケーション、クローズアウト・ポジション申告) 及びオプションの権利行使時限 (17時) については、**変更なし**。
- その他のデリバティブに関する決済時限 (受渡に関する時限含む) は変更なし。

時	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27	28	29	30	
取引証拠金・差金代金 情報の配信時刻/時限									★ 16:10頃 清算値段 ★ 16:15頃 証拠金パラメータ		★ 18:00頃 差金代金 配信	★ 19:00 建玉確定 時限	★ 19:30頃 取引証拠金 所要額配信											★ 30:10 当日建玉 訂正時限
ギブアップ申告 (当日分)	8:00~16:45									17:00頃~ 17:30	19:00~30:10 (訂正申告)													
テイクアップ申告 (当日分)	8:00~17:45										19:00 ~30:10 (訂正申告)													
アロケーション申告	8:00~18:00										19:00 ~30:10 (訂正申告)													
クローズアウト申告/ ポジション申告	8:00~19:00										19:00 ~30:10 (訂正申告)													
オプション 権利行使申告	8:00~17:00										★17:00 権利行使・割当													
建玉移管申告	8:00~14:30																							

	変更後 (変更があるものは青字下線)	(参考) 変更前 (VaR対応稼働後想定)
1. 清算値段の確定		
(1) 国債先物・オプション		15:15頃
(2) 指数先物・オプション	<u>16:10頃</u>	15:40頃
(3) 商品先物・オプション	<u>16:10頃</u>	15:40頃
2. 取引証拠金関係パラメータファイルの配信		
(1) BPF (EOD証拠金計算用。商品別にファイルを配信。) 国債先物・オプション計算用ファイル 指数先物・オプション計算用ファイル、商品先物・オプション計算用ファイル * 上記以外のファイルは今後公表。	15:45頃 <u>16:15頃</u>	15:45頃 15:45頃
(2) VPF	<u>16:15頃</u>	15:45頃
(3) APF(証拠金割増額計算用ファイル)	<u>17:00頃</u>	16:30頃
(4) AS-VaR方式におけるリスクファクター情報	<u>毎週末17:30頃</u>	毎週末17:00頃
3. ポストトレード業務		
(1) 建玉移管申請	08:00~ <u>14:30</u>	08:00~14:00
(2) ギブアップ申告、テイクアップ申告、アロケーション申告、 クローズアウト申告、ポジション申告、オプション権利行使申告	p.1表参照 (変更なし)	
4. 差金代金・取引証拠金情報の配信		
(1-1) 差金代金情報配信 (cCran)	17:00頃 (暫定額) 、18:00頃 (確定額)	
(1-2) 差金代金レポート配信 (EOD1: WebPortal/FTP)	19:30頃	
(2-1) 取引証拠金額計算・配信 (cCran - Historical Riskの配信)	17:00、18:00、19:00、30:10	
(2-2) 取引証拠金所要額配信 (EOD1,2: WebPortal/FTP)	19:30頃 (EOD1) 、30:30頃 (EOD2)	