

先物・オプション取引に係る取引最終日及び特別清算指数算出日に関するコンティンジェンシー・プランについて

平成21年10月5日

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

先物・オプション取引の取引最終日及び指数先物・オプション取引の特別清算指数（以下「S.Q.」という。）算出日にシステム障害等により取引が行えない場合等の当該取引最終日及びS.Q.算出日について、以下のとおり取り扱うこととする。

項目	具体的対応	考え方等
1. 取引最終日の取扱い		○ 派生売買システムの障害等により取引最終日に取引が行えない場合には、取引最終日の繰延べについて、商品ごとに以下のとおり取り扱うこととする。
(1) 取引最終日の繰延べ対象商品	<ul style="list-style-type: none"> ・ 国債先物取引（ミニ長期国債先物取引を除く。限月間スプレッド取引及びToSTNeT取引を含む。以下同じ。） 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 国債先物取引については、最終建玉のすべてを受渡決済することとした場合の決済物件（国債現物）及び決済代金の調達に伴う市場の混乱の可能性等を考慮し、建玉整理の機会を設けるため、受渡決済期日を変更しない範囲で取引最終日を繰り延べる。 ・ ミニ長期国債先物取引については、国債先物取引とは異なり受渡決済がなく、差金決済を行うなどの理由から、取引最終日の繰延べは行わない。 ・ 有価証券オプション取引、国債先物オプション取引及び指数オプション取引については、取引最終日を繰り延べた場合、権利行使日等も繰り延べることとなるほか、オプション価値に予期せぬ変動を生じさせることとなるなど、その商品性に大きな影響を与える可能性があるため、取引最終日の繰延べは行わない。 ・ 指数先物取引については、差金決済を行うことに加え、指数オプション取引と同じS.Q.により決済を行うなどの理由から、取引最終日の繰延べは行わない。
(2) 国債先物取引に係る取引最終日の繰延べ期間	<ul style="list-style-type: none"> ・ 最長2営業日 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 受渡決済期日は変更しないことを前提として、取引最終日から受渡決済期日までの事務日程を可能な限り短縮し、最長2営業日とする。

項 目	具体的対応	考え方等
(3) 国債先物取引に係る取引最終日を繰り延べた場合の新たな限月取引の開始	<ul style="list-style-type: none"> 国債先物取引について、繰り延べた取引最終日の翌営業日に開始する。 	<ul style="list-style-type: none"> 国債先物取引については、3限月取引制を維持する。 ミニ長期国債先物取引の新たな限月取引の開始日は、同一限月の長期国債先物取引の開始日と同一とする。
(4) 国債先物取引に係る取引最終日の繰延べの判断基準	<ul style="list-style-type: none"> 午後立会の引けの板寄せを含む一定時間において売買が行えない場合は、取引最終日を繰り延べる。 	<ul style="list-style-type: none"> 以下のいずれかに該当する場合には、国債先物取引に係る取引最終日を繰り延べる。 <ol style="list-style-type: none"> 立会市場における取引（限月間スプレッド取引を除く。以下同じ。）について、午後立会開始前までにシステム障害等が発生した場合で、午後立会において取引停止を行った場合。ただし、午後1時30分までに注文受け付けを開始又は再開するとともに午後2時まで取引停止を解除し（午後立会開始前までにその旨公表した場合に限る。）、かつ午後立会終了時まで立会を行った場合を除く。 立会市場における取引について、午後立会開始以降にシステム障害等が発生し、午後立会において取引停止を行った場合。 立会市場における取引について、午後立会の引けの板寄せにおいてシステム障害等が発生し、当該板寄せに係る取引が成立しなかった場合（注文状況等によりザラバ引けとなる場合を除く。）。 <p>(注)午後3時15分までに当該板寄せに係る取引についてシステム処理を行うことができないときは、取引不成立とする。</p>
(5) 国債先物取引のイブニング・セッションの取扱い	<ul style="list-style-type: none"> 取引最終日を繰り延べる場合の当該繰延べに係る限月取引のイブニング・セッションは行わない。 	<ul style="list-style-type: none"> 国債先物取引について、取引最終日を繰り延べた場合においても、当該繰延べに係る限月取引の当初の取引最終日以降、当該限月取引のイブニング・セッションは行わない。
(6) ミニ長期国債先物取引の最終清算値段算出日に係る取扱い	<ul style="list-style-type: none"> 長期国債先物取引の取引最終日の繰延べに伴って、最終清算値段算出日を繰り延べる場合がある。 	<ul style="list-style-type: none"> 長期国債先物取引の取引最終日が繰り延べられた場合であって、ミニ長期国債先物取引に係る最終清算値段とすべき値段がある場合（長期国債先物取引の当初の取引最終日（当該日におけるイブニング・セッションを除く。）において、当該長期国債先物取引に係る約定値段がある場合）には、ミニ長期国債先物取引の最終清算値段算出日を繰り延べずに、当初の予定通り最終決済を行う。

項 目	具体的対応	考え方等
(7) その他（指数先物取引等の ToSTNeT 取引）	<ul style="list-style-type: none"> ・ 臨時措置としてファックスによる申込みを受け付ける。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 長期国債先物取引の取引最終日が繰り延べられた場合であって、ミニ長期国債先物取引の最終清算値段とすべき値段がない場合（長期国債先物取引の当初の取引最終日（当該日におけるイブニング・セッションを除く。）において、当該取引に係る約定値段がない場合）は、ミニ長期国債先物取引の最終清算値段算出日を繰り延べる。 ・ この場合の最終清算値段は、原則として、長期国債先物取引の取引最終日を繰り延べた後の当該長期国債先物取引に係る最初の約定値段とする。また、最終決済については、当該最終清算値段が算出された日の翌営業日に行うものとする。 ・ 指数先物取引、ミニ長期国債先物取引、指数オプション取引、有価証券オプション取引及び国債先物オプション取引においては、取引最終日を繰り延べない一方、ロールオーバー等を可能とするため、臨時措置として ToSTNeT 取引のファックスによる申込みを可能とする。
<p>2. S.Q. 算出日の繰延べ</p> <p>(1) S.Q. 算出日の繰延べ対象商品</p> <p>(2) S.Q. 算出日の繰延べ期間</p> <p>(3) S.Q. 算出日繰延べの判断基準</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・ 指数先物取引、指数オプション取引 ・ 指数構成銘柄の売買立会が開始される日まで ・ 指数構成銘柄の売買立会が株式売買システムの障害等により終日不可能な場合 	<ul style="list-style-type: none"> ○ S.Q. 算出日において株式売買システムの障害等により、指数構成銘柄の売買が行えないときは、以下のとおり、S.Q. 算出日の繰延べを行う取扱いとする。 ・ S.Q. を用いて最終決済を行う商品を対象とする。 ・ 指数先物・オプション取引は、裁定取引の解消等のための現物株式等の売買が S.Q. 算出の元となる株価等の形成に関与することが重要であることから、これらの株券等の売買立会が開始され、各指数先物・オプション取引に係るすべての S.Q. 値が算出される日まで、S.Q. 算出日を繰り延べる。 ・ 当該システムの障害等が回復した以降においても、会社情報を周知する等のために売買停止が行われている銘柄にあっては、当該判断基準に該当しないものとする。

項 目	具体的対応	考え方等
(4) S. Q. 値算出用株価等	<ul style="list-style-type: none"> ・ 当初の S. Q. 算出日以降に決定した各銘柄の始値に基づき算出する。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 当初の S. Q. 算出日以降、銘柄ごとに売買立会を開始した日の始値に基づき算出する。ただし、最終特別気配を表示したまま立会を終了するなど、注文状況により始値が決定しない場合には当該気配値段（気配値段がない場合には直前の約定値段（最終特別気配値段を含む。以下同じ。)) を、また、会社情報を周知する等のために売買停止が行われている場合には直前の約定値段を用いて算出する。 ・ S. Q. 算出に係る指数算出用上場銘柄数及び基準時価総額の数値は、原則として当初の S. Q. 算出日のものを用いる。
(5) 当初 S. Q. 算出日における指数先物・オプション取引の取扱い	<ul style="list-style-type: none"> ・ 株式売買システム稼働の有無にかかわらず取引を行う。 ・ 新たな限月取引を開始する。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 通常どおり（現行のコンティンジェンシー・プランに則した対応）
(6) 指数先物・オプション取引の決済期日等	<ul style="list-style-type: none"> ・ 先物・オプション取引の決済期日及びオプション取引の権利行使日も繰り延べる。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ S. Q. 算出日の繰延べに伴い、S. Q. に基づき行う指数先物・オプション取引の決済は、各指数先物・オプション取引に係るすべての S. Q. 値が決定した日の翌日に行うこととし、また、指数オプション取引の権利行使も繰り延べた S. Q. 算出日に行う。
3. 清算システムに障害が発生した場合等におけるギブアップ（訂正含む）、転売・買戻し申告及び権利行使の申告・割当て結果の通知	<ul style="list-style-type: none"> ・ Target、FAX を利用して行う。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 当取引日中に成立した取引に係るギブアップ（訂正含む）、転売・買戻し又はオプション取引の権利行使の申告・割当てについて、清算システムを通じて申告等ができない場合には、原則として Target、FAX を利用して行う。 ・ 原則としてオプション取引に係る自動権利行使制度を適用する。 ・ 先物・オプション取引のギブアップ（訂正含む）、テイクアップ（訂正含む）、転売・買戻し及び権利行使の申告時限は通常どおりとする。

* このプランは、西暦 2000 年問題対応時に策定されたコンティンジェンシー・プラン及び SQ 日直前の平成 13 年 9 月に起こった米国同時多発テロ事件等を踏まえ、SQ 日等にシステム障害等が起こった場合の対応を明確化するために、平成 14 年 6 月 18 日に制定されたものです。

* 平成 16 年 2 月 2 日に東証先物・オプション取引に係る清算機関が東証から日本証券クリアリング機構に変更となったことに伴い、所要の改正を行っていま

す。

- * 平成 18 年 1 月 30 日に日本証券クリアリング機構の清算システムのリプレイスに伴い、所要の改正を行っています。
- * 平成 20 年 1 月 15 日に、派生売買システムの稼働、清算システムへの建玉管理機能の移管に伴い、所要の改正を行っています。
- * 平成 20 年 6 月 16 日に、先物・オプション取引に係る新商品導入に伴い、所要の改正を行っています。
- * 平成 21 年 3 月 23 日に、ミニ長期国債先物取引の導入及びギブアップ訂正のオンライン化対応に伴い、所要の改正を行っています。
- * 平成 21 年 10 月 5 日に、有価証券オプションの ToSTNeT 取引がシステム売買に移行したことに伴い、所要の改正を行っています。

以 上

先物・オプション取引に係る取引最終日及び特別清算指数算出日に関するコンティンジェンシー・プラン発動時における運用上の留意点等

平成21年10月5日

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

I. 取引最終日の取扱い…派生売買システムの障害等により取引最終日に取引が行えない場合の対応

項 目	内 容	備 考
1. 国債先物取引関係	概要：国債先物取引の取引最終日を最長2営業日まで繰り延べる。	
(1) 取引最終日の繰延べ対象商品	<ul style="list-style-type: none"> 国債先物取引(ミニ長期国債先物取引を除きます。限月間スプレッド取引及びToSTNeT取引を含みます。以下同じ。)について取引最終日の繰延べを行います。 	<ul style="list-style-type: none"> ミニ長期国債先物取引及び国債先物オプション取引は取引最終日の繰延べを行いません。 繰延べの判断基準については、要綱「先物・オプション取引に係る取引最終日及び特別清算指数算出日に関するコンティンジェンシー・プランについて」(以下「コンティンジェンシー・プラン」といいます。)1.(4)を参照してください。
(2) 取引最終日の繰延べ期間	<ul style="list-style-type: none"> 繰延べ後の取引最終日は、翌営業日とします。 受渡決済に係る事務日程を考慮し、繰延べは2営業日を限度とします。 受渡決済期日は変更しません。 	
(3) 取引最終日におけるイブニング・セッションの取扱い	<ul style="list-style-type: none"> 国債先物取引のうち、取引最終日を迎える限月の当初取引最終日におけるイブニング・セッションは行いません。 	<ul style="list-style-type: none"> 繰り延べた取引最終日においてもイブニング・セッションは行いません。
(4) 新たな限月の取引開始日	<ul style="list-style-type: none"> 国債先物取引の新たな限月取引は、繰り延べた取引最終日の翌営業日から開始します。 長期国債先物取引について取引最終日の繰延べを行い、新たな限月取引の開始日を繰り延べた場合、ミニ長期国債先物取引の新たな限月取引も同一日に繰り延べて開始します。 	<ul style="list-style-type: none"> 国債先物取引は、常時3限月取引制とします。
(5) 派生売買システム取引端末(以下、「取	<ul style="list-style-type: none"> 画面表示及び通知メッセージに変更はありません。 	<ul style="list-style-type: none"> 特別な端末操作及び設定等の必要はありません。

項 目	内 容	備 考
<p>引端末」といいます。)の画面表示等について</p> <p>(6) 受渡決済事務日程について</p> <p>(7) 各種報告資料の取扱い</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・ 受渡決済期日を変更しないことから、通常時における取引最終日から受渡決済期日までの事務日程を短縮して行うこととなります。 ・ 各種申告内容等に変更はありません。 ・ 毎週御報告いただいている投資部門別売買内容及び建玉内容等の報告については、繰り延べた取引最終日までの分を含めて御報告ください。 	<p>せん。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 受渡事務日程を短縮する場合の短縮パターンは別紙1を参照してください。 ・ 具体的な繰延べ日程は、コンティンジェンシー・プラン適用時に御連絡します。
<p>2. 指数先物取引/ミニ長期国債先物取引/オプション取引関係</p>	<p>概要：取引最終日の繰延べは行わない。指数先物取引、ミニ長期国債先物取引、指数オプション取引、有価証券オプション取引及び国債先物オプション取引の ToSTNeT 取引の申込みをファックスで受け付ける。</p>	
<p>(1) ToSTNeT 取引の申込みをファックスで受け付けるケース</p> <p>(2) 適用限月</p> <p>(3) 申込数量</p> <p>(4) 申込方法</p> <p>(5) 申込時間</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・ 指数先物取引、ミニ長期国債先物取引、指数オプション取引、有価証券オプション取引及び国債先物オプション取引の取引最終日において、派生売買システムに障害が発生した場合等により、当該売買システムによる取引が行えなくなった場合に適用します。 ・ 派生売買システムによる取引が行えなくなった限月に適用します。 ・ 1 単位から申込み可能とします。 ・ 所定の申込書を、当取引所にファックス送信をする方法により行います。 ・ 派生売買システムにおける取引時間と同じとします。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 指数先物取引、ミニ長期国債先物取引及びオプション取引は取引最終日の繰延べを行いません。 ・ ToSTNeT 取引のみシステム障害であった場合にも、本運用を適用します。 ・ 通常時どおり。 ・ 申込書は、別紙2を参照してください。なお、申告用紙は Target にも掲載しております。(届出書類→フォーマット集→派生商品部フォーマット集)

項 目	内 容	備 考
(6) ToSTNeT 取引の基準値段	<ul style="list-style-type: none"> 理論価格等とします。 	<ul style="list-style-type: none"> 先物取引は立会市場での取引価格がないため、理論価格を利用します。ただし、ToSTNeT 取引のみシステム障害であった場合には、通常通り立会内の約定値段等を利用します。 オプション取引は平常時と同様、理論価格を利用します。
<div data-bbox="152 515 622 592" style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-bottom: 10px;">3. 共通事項(証拠金関係)</div> (1) 証拠金の取扱い (2) 清算値段の取扱い (3) SPAN の取扱い	<div data-bbox="676 515 2096 592" style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-bottom: 10px;">概要：未決済建玉については証拠金を預託する。(通常どおり)</div> <ul style="list-style-type: none"> 国債先物取引において、当初取引最終日の午後立会終了時点で転売・買戻しを行っていない未決済の建玉については、受渡決済期日まで証拠金を預託していただくことになります。 繰り延べた取引最終日の午後立会終了時点で未決済の建玉については、受渡決済期日まで証拠金を預託していただくことになります。 先物取引については直前の売買立会における最終約定値段等を、オプション取引については理論価格を採用します。 当初取引最終日において日本証券クリアリング機構が SPAN リスク・パラメーター・ファイルを午後 4 時 30 分までに作成できない場合や、日本証券クリアリング機構がその清算参加者の自己分の証拠金所要額を計算できない場合等においては、「取引証拠金関連業務事務処理要領」に定める障害発生時の対応を行うこととします。 	<ul style="list-style-type: none"> 通常どおり

II. 特別清算指数(S.Q.)算出日の取扱い…東証株式売買システム等の障害により S.Q.算出日に指数構成銘柄の株券等の売買立会が行えない場合の対応

項 目	内 容	備 考
<p>指数先物・オプション取引関係 (国債先物・オプション取引には影響はありません。)</p> <p>(1) S.Q.算出日の繰延べ対象商品</p> <p>(2) S.Q.算出日の繰延べ期間</p> <p>(3) S.Q.算出用株価等</p> <p>(4) S.Q.算出用銘柄数</p> <p>(5) 新たな限月の取引開始日</p> <p>(6) 決済期日等</p> <p>(7) 相場報道システム(小型選択テレビ等)における表示等</p> <p>(8) 証拠金関係(SPAN におけるポジションの認識期間)</p>	<p>概要 : 指数先物・オプション取引の S.Q.算出日を繰り延べる</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 指数先物取引及び指数オプション取引 ・ 指数を構成する全銘柄の売買立会が開始され、かつ、各指数先物・オプション取引の取引対象となる指数のすべての S.Q.値が確定した日を S.Q.算出日とします。 ・ 当初の S.Q.算出日以降、東証株式売買システムの障害が回復したこと等により売買立会を再開した日の始値等を採用します。 ・ 指数算出用上場銘柄数及び基準時価総額は、原則として当初 S.Q.算出日の数値を採用します。 ・ 当初 S.Q.算出日から開始します。 ・ 指数オプション取引の権利行使は繰り延べた S.Q.算出日に行います。 ・ 指数先物取引の最終決済期日及び指数オプション取引の権利行使に係る決済日は、繰り延べた S.Q.算出日の翌営業日とします。 ・ S.Q.算出日を繰り延べた場合、相場報道システムから S.Q.値の配信は行いません。 ・ SPAN による証拠金計算におけるポジションの認識期間において、指数先物・オプション取引は、S.Q.算出日から対象外とします。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 繰延べの判断基準については、コンティンジェンシー・プラン 2.(3)を参照してください。 ・ 指数構成銘柄の一部分の銘柄についてのみ売買立会が開始されなかった場合でも、S.Q.算出日を繰り延べます。 ・ 詳細はコンティンジェンシー・プラン 2.(4)を参照してください。 ・ 通常どおり ・ 現行も、権利行使は S.Q.算出日に行うこととしています。 ・ 現行も、最終決済等は S.Q.算出日の翌営業日に行うこととしています。 ・ S.Q.算出日を繰り延べた場合でも、S.Q.対象限月の指数先物・オプション取引の最終決済等はすべて同一日に行います。 ・ 当初 S.Q.算出日に無効な S.Q.値を配信及び表示することはありません。 ・ 正しい S.Q.値については、繰り延べた S.Q.算出日にファックス等を通じて御連絡することになります。 ・ 詳細は、「取引証拠金関連業務事務処理要領」V.SPAN パラメータの取扱い等の2.ポジ

項 目	内 容	備 考
(9) 清算指数等の取扱い	<ul style="list-style-type: none"> ▪ S.Q.対象限月の指数先物取引の清算指数及び指数オプション取引の清算値段については、前日の数値を用いることとします。 	<p>ションの認識期間」を参照してください。</p>
(10) 清算関係情報	<ul style="list-style-type: none"> ▪ 清算システム参加者標準端末(以下「CMF 端末」といいます。)の通常時と同じ画面から御確認いただくことができます。 	<ul style="list-style-type: none"> ▪ 通常どおり
(11) 東証 WAN を通じた届出書類 (投資部門別内容報告書)	<ul style="list-style-type: none"> ▪ S.Q.対象限月の取引高については、先物取引及びオプション取引ともに取引最終日までの数値を御報告ください。 	<ul style="list-style-type: none"> ▪ 通常どおり
(12) 手口、建玉残高情報等の公表	<ul style="list-style-type: none"> ▪ 参加者別取引手口については、取引最終日までの数値を公表します。また、参加者別週末建玉残高について、S.Q.対象限月の情報は、当初 S.Q.算出日の前週末までの情報を公表します。 	<ul style="list-style-type: none"> ▪ 通常どおり ▪ その他、ToSTNeT取引の手口等についても通常どおりです。

Ⅲ. 清算システムの障害等により、当該システムを通じてギブアップ(訂正含む)、転売・買戻し及び権利行使が行えない場合の対応

項 目	内 容	備 考
国債先物取引(ミニ長期国債先物取引を含む。以下、同じ。)、国債先物オプション取引、指数先物・オプション取引及び有価証券オプション取引共通事項		
<p>1. 概要</p> <p>(1) 対応内容</p> <p>(2) 当対応実施に関する連絡</p> <p>2. ギブアップ(訂正含む)</p> <p>(1) 申告用紙</p> <p>(2) 申告方法</p> <p>(3) 申告時限</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・ 清算システムに障害が発生し、当該システムを通じてギブアップ(訂正含む)、転売・買戻し及びオプション取引の権利行使申告ができない場合には、原則としてギブアップ(訂正含む)、転売・買戻し等に関する情報を伝票に御記入いただき、Target、ファックスで東京証券取引所(以下、東証という。)に御送付いただくことにより処理することとします。 ・ 当対応の実施については、Target 及び一斉ファックスを通じて御連絡いたします。 ・ 商品別に以下の用紙に記入をお願いいたします。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin: 10px 0;"> <p>○商品 国債証券先物取引、国債証券先物オプション取引、指数先物取引、指数オプション取引、有価証券オプション取引</p> <p>○用紙 「ギブアップ申告書(障害時用)」、 「ギブアップ訂正申告書(障害時用)」</p> </div> <ul style="list-style-type: none"> ・ Target またはファックスで御送付願います。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin: 10px 0;"> <p>申込用紙のファックス送付先 株式会社東京証券取引所 派生商品部 国債先物・オプション取引: 03-3668-2856 指数先物・オプション取引: 03-3639-4688 有価証券オプション取引: 同上</p> </div> <ul style="list-style-type: none"> ・ ギブアップ・テイクアップの申告時限は、17 時までです。 ・ ギブアップ訂正・テイクアップ訂正の申告時限は、13 時までです。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 取引最終日に限らず、清算システム障害発生時等には当対応を適用します。 ・ 当該対応は、日本証券クリアリング機構から事務委託を受け、当面の間、東証が行うものとなっています。 ・ 各用紙及び記載例は別紙 3 を参照してください。なお、申告用紙は Target にも掲載しております。(届出書類→フォーマット集→派生商品部フォーマット集) ・ ファックスの場合、送付状は不要です。 ・ 通常時の時限と同じ。

項 目	内 容	備 考
<p>(4) ギブアップ(訂正含む)後の建玉残高等の確認</p> <p>2. 転売・買戻し</p> <p>(1) 申告用紙</p> <p>(2) 申告方法</p> <p>(3) 申告時限</p> <p>(4) 転売買戻し後の建玉残高の確認</p> <p>3. 権利行使申告及び割当結果通知</p> <p>(1) 申告用紙</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・ 清算システムの復旧後、CMF 端末(「ギブアップテイクアップ明細画面」「参加者別建玉残高照会」画面等)で確認してください。 ・ 商品別に以下の用紙に記入をお願いいたします。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin: 10px 0;"> <p>国債証券先物取引:「転売・買戻し申告書(障害時用)」 国債証券先物取引:「転売・買戻し申告書(権利行使対応分)(障害時用)」 国債証券先物オプション取引:「転売・買戻し・権利行使数量申告書(障害時用)」 指数先物取引:「転売・買戻し申告書(障害時用)」 指数オプション取引:「転売・買戻し申告書(障害時用)」 有価証券オプション取引:「転売・買戻し申告書(障害時用)」</p> </div> <ul style="list-style-type: none"> ・ Target またはファックスで御送付願います。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin: 10px 0;"> <p>申込用紙のファックス送付先(転売・買戻し/権利行使申告用) 株式会社東京証券取引所 派生商品部 国債先物・オプション取引: 03-3668-2856 指数先物・オプション取引: 03-3639-4688 有価証券オプション取引: 同上</p> </div> <ul style="list-style-type: none"> ・ 申告時限は 17 時までです。 ・ 清算システムの復旧後、CMF 端末(「参加者別建玉残高照会」画面)で確認してください。 ・ 商品別に以下の用紙に記入をお願いいたします。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 各用紙及び記載例は別紙 4 を参照してください。なお、申告用紙は Target にも掲載しております。(届出書類→フォーマット集→派生商品部フォーマット集) ・ 国債先物オプション取引において権利行使申告を行う場合には、転売・買戻し数量と合わせて権利行使数量を御記入ください。 ・ 指数オプション取引及び有価証券オプション取引の権利行使日には、転売・買戻し数量と合わせてそれぞれ別の用紙に御記入ください。(以下「3.権利行使申告及び割当結果通知」欄を参照してください。) ・ ファックスの場合、送付状は不要です。 ・ 通常どおり ・ 各用紙及び記載例は別紙 4 を参照してください。なお、申告用紙は東証WAN(Target)にも

項 目	内 容	備 考
<p>(2) 申告方法</p> <p>(3) イン・ザ・マネー銘柄の取扱い</p> <p>(4) 申告時限</p> <p>(5) 権利行使申告・割当結果の確認</p>	<div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-bottom: 10px;"> <p>国債証券先物オプション取引:「転売・買戻し・権利行使数量申告書(障害時 用)」 指数オプション取引:「転売・買戻し・権利行使数量申告書(障害時用)」 有価証券オプション取引:「転売・買戻し・権利行使数量申告書(障害時用)」</p> </div> <ul style="list-style-type: none"> ・ Target またはファックスで御送付願います。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-bottom: 10px;"> <p>申込用紙のファックス送付先(転売・買戻し/権利行使申告用) 株式会社東京証券取引所 派生商品部 国債先物・オプション取引: 03-3668-2856 指数先物・オプション取引: 03-3639-4688 有価証券オプション取引: 同上</p> </div> <ul style="list-style-type: none"> ・ 権利行使に係る処理を円滑に行うため、イン・ザ・マネー銘柄についても、権利行使を行う場合には申告用紙に記入のうえ、上記あて先へファックスで御送付ください。 ・ 申告時限は 17 時までです。 ・ 清算システムの復旧後、CMF 端末(「権利行使申告割当明細照会」、「株券オプション取引 権利行使申告割当明細/清算引受明細照会」)で確認してください。 	<p>掲載しております。(届出書類→フォーマット集→派生商品部フォーマット集)</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ ファックスの場合、送付状は不要です。 ・ 申告数量等の確認のため、内容を確認させていただく場合があります。 ・ 最終的に東証が貴社の保有するイン・ザ・マネー銘柄(国債先物オプションについては取引最終日に限る。)の買建玉について権利行使申告の有無を確認できなかった場合は、権利行使の申告があったものとみなします。この際、イン・ザ・マネー銘柄であるかどうかは、通常どおり、国債先物オプション取引においては権利行使対象先物限月取引の清算値段を、指数オプション取引においては S.Q. 値を、有価証券オプション取引においては対象株券等の終値等を基準として判断します。 ・ 通常どおり ・ 転売・買戻し申告と同じ時限です。

以 上

—お問合せ先電話番号一覧—

株式会社 東京証券取引所

取引制度に関するお問合せ	派生商品部	03-3665-1385
売買取引の運用（転売買戻し申告等）に関するお問合せ （国債先物・オプション取引関係）	〃	03-3665-5740（先物） 03-3665-1334（オプション） FAX：03-3668-2856
（指数先物・オプション取引、有価証券オプション取引関係）		03-3665-1832（先物） 03-3665-1334（オプション） FAX：03-3639-4688
相場報道システム（S.Q. 値の配信等）に関するお問合せ	IT開発部	03-3665-1822
統計関係情報報告（投資部門別取引内容報告書等）に関する お問合せ	情報サービス部	03-3665-1728

株式会社 日本証券クリアリング機構

SPAN、受渡決済、清算システムに関するお問合せ		03-3665-1381 FAX：03-3666-0971
--------------------------	--	----------------------------------