

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10月11日（平成28年9月26日一部改訂）

証券会員制法人 札幌証券取引所

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、本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等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、本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、提供された空売り残高情報について、日々、本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、本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、本所で公表対象となるもののみを集約等したうえで、本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本所のホームページに

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/24/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）及び平成25年6月12日付「空売り規制の総合的な見直しに係る札証の対応について」の別紙における3（1）及び3（2）をご参照ください。

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すが、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。

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）につきましては、下記の本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.sse.or.jp/market/karauri>

(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)

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、空売りを行ったものが個人（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、空売りを行ったものが個人（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、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、原則、パスワードを設定したうえで、メールによる送信をもってご提供いただきます⁴。

したがって、従来の提供方法のうち、ファクシミリによる送信及び本所への持ち込みは、原則不可となります。

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、本所においては、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5時を目途に本所のホームページに掲載するものとします。

ファイルの提出先

soumu@sse.or.jp

※ 上記（6）は、本所の会員から本所に対する、ファイルの提供方法を記載したものです。本所の会員以外の空売り残高情報の提供者におかれましては、本所の会員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、本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、本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をメールで送信する際には、原則として、パスワードを付してください。
- ✓ 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、本所に提供される空売り残高情報は、本所が主たる金融商品取引所となる銘柄に限られます。本所以外が主たる金融商品取引所となる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。

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、当該ZIPファイルにパスワードを原則追加し、メールで送信してください。

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、本所に提供された空売り残高情報（ファイルA）について、本所では、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

本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5時を目途に、下記の本所のホームページに掲載いたします⁵。

空売りの残高に関する情報

http://www.sse.or.jp/market/karauri/zandaka_jyouhou

(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きましては、下記の本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ます。

空売り残高情報の公表に係るフォーマット

<http://www.sse.or.jp/market/karauri>

(4) 公表フォーマットに記載される情報について

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	銘柄コード Code of Stock	銘柄名 (日本語/英語) Name of Stock (Japanese/English)	空売り数量・割合 Stakes of Short Seller	住所・所在地 Address of Short Seller	開示者・開示一任機関の名称 開示者 Name of Discloser Name of Discloser	開示者・開示一任機関の住所 住所 Address of Discloser Address of Discloser	開示日 Date of Disclosure	空売り残高の割合 Ratio of Short Positions to Shares Outstanding	空売り残高の数量 Number of Short Positions to Shares	空売り残高の割合 Ratio of Short Positions to Shares	空売り残高の数量 Number of Short Positions to Shares	公表年月日 Date of Disclosure	空売り残高の割合 Ratio of Short Positions to Shares	備考 Notes
①	②	③	④	⑤	⑥	⑦	⑧	⑨	⑩	⑪	⑫	⑬	⑭	⑮

①公表年月日 (Date of Disclosure)

当該ファイルが本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、本所においては、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5時を目途に本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。

⁵ なお、新しい取扱いを適用するまでの間は、従来どおり、提供された空売り残高情報について、本所のホームページに掲載いたします。

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形となります。

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す。）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す。）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、直前に提出し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、直近に提出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は不整合があった場合には、本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、提出されたファイル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、本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、本所に提供する空売り残高情報から適用いたします⁶。

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5時を目途に本所が公表する空売り残高情報から適用いたします^{7, 8}。

以上

⁶ 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、その場合で提供をメールにより行うときは、従来どおり、当該ファイルをPDFファイル形式に変換し、ZIPファイル形式などにまとめたうえ(パスワード設定推奨)でご提供いただくこととなります。

⁷ 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時までに本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)の公表分には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)。

⁸ 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本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、本所のホームページに掲載いたします。