



VaR証拠金計算ソフトウェアのバージョンアップ に係る対応概要

2023年12月
株式会社 日本証券クリアリング機構

- このたび、VaR証拠金算出時に用いるパラメータを各商品の価格変動等を踏まえてきめ細やかに設定できるよう、**2024年6月10日付で、「VaRパラメータファイル」(VPF)のファイルレイアウトの変更を予定**しております。
 - ✓ 将来に備えたシステム面の対応であり、現時点で、本番業務で適用しているVaR証拠金算出用パラメータの設定値の変更予定はございません。パラメータ変更の際は参加者等のご意見も伺いながら検討します。
- また、このVPFのレイアウト変更に伴い、同ファイルに対応する**「VaR証拠金計算ソフトウェア」(VMA)のバージョンアップ(v1.0版⇒v2.0版)**も行います。
 - ✓ VMAのアップデートのなかで、**VMAの機能改善も実施**します。
 - ✓ **レイアウト変更後のVPFを使ってVaR証拠金を計算するためには、バージョンアップ後のVMA(v2.0版)が必要**です。
 - ✓ そのため、今回のVMAのバージョンアップは、**利用形態 (GUI、CLI、API)に関わらず、VMAをご利用頂くすべての利用者様が対象**となります(レイアウト変更後のVPFは、現在提供中のVMA(v1.0版)では読み込めません)。
- 本資料は、本案件に係る対応概要をまとめたものになりますので、**VMAをご利用されている場合は必ずご一読ください。**

I. システム対応概要編

1. VPF及びVMAの変更点について
2. 各変更点の概要

II. スケジュール等

1. 全体スケジュール
2. ドキュメント・ソフトウェアの開示スケジュール

I. システム対応概要編



1. VPF及びVMAの変更点について

- 今回、VPF及びVMAについて、下表のとおり変更します。
 - ✓ VMAを利用していない場合は、今回の変更による影響はございません。
- 各変更点の詳細は次ページ以降でご説明します。今回の変更に係る仕様書等は準備ができ次第、別途公表予定です。

変更点	影響先	必須/任意	対応内容
①VPFの ファイルレイアウト変更	-	- (対応不要)	• VPFに収録する証拠金パラメータの設定粒度の変更
②VMAソフトウェアの バージョンアップ	VMAの全利用者 (GUI、CLI、API)	必須	• VMAアプリケーション (GUI、CLI、API) の置き換え
③VMA機能改善	VMA利用者のうち、 <u>追加機能の利用希望者のみ</u> (GUI、CLI、API)	任意	• 機能改善箇所は次のとおり ✓ エラーポジションスキップモードの追加 (API) ✓ インプットファイル基準日返却機能追加 (API) ✓ ポジションファイル内許容文字の追加 (GUI・CLI・API)
④VMAのサポート対象の OS及びjavaの変更	VMA利用者 (CLI・API)	任意	• OS及びjavaのバージョン変更

2. 各変更点の概要 ① VPFのファイルレイアウト変更

- VPFに収録する証拠金算出パラメータ（ストレスシナリオ本数、信頼水準）について、現行VPFでは全商品共通の設定値を使うことになっているところ、より細かい単位（アグリゲーショングループ）で設定可能となるよう、**VPFのファイルレイアウトの変更**を行います。
 - ✓ VPFを利用者側で編集する必要はありません。
 - ✓ 証拠金算出パラメータ（ストレスシナリオ本数、信頼水準）の設定粒度を細かくできるようになりますが、今回のレイアウト変更タイミングでのパラメータ（設定値）の変更はございません。
(レイアウト変更に起因する証拠金の変動はございません。)
 - ✓ 将来に今回粒度を見直すパラメータのストレスシナリオ本数や信頼水準の設定値そのものを変更する必要がある場合は、別途ご案内します。
 - ✓ シナリオPLファイル（BPF）と取引証拠金割増額計算用ファイル（APF）のレイアウト変更はありません。
- VPFの新ファイルレイアウトの仕様書については、2024年1月目途に公表予定です。

2. 各変更点の概要 ②VMAソフトウェアのバージョンアップ

- 新レイアウトのVPFに対応したVMA更新版（v2.0）をご提供しますので、**すべてのVMA利用者は更新版への置換えをお願いします。**
 - ✓ 利用形態（GUI,CLI,API）によらず、6/10以降の証拠金計算ではVMA更新版に置き換える作業を行っていただく必要がございます。
 - ✓ 現行のVMA（v1.0）では、新レイアウトのVPFを読み込むことができませんので、ご注意ください。
※VMA更新版を使って過日分の証拠金計算ができるよう、新レイアウトへの変更前に本番配布したVPFについて、新レイアウトに変換したものを公開予定です。

	～2024/6/7(金)	2024/6/10(月)～
VMA (v1.0)	○	× (以後、VMA1.0はご利用になれません)
VMA (v2.0)	× (VMA(v2.0)で利用可能な新レイアウトのVPFファイルを順次提供します)	○

- VMA更新版提供および、新レイアウトに変換したVPF（過日分）の提供方法の詳細の公表については、2024年1月を目途を予定しております。

2. 各変更点の概要 ③VMAの機能改善

- 利用者の利便性向上のため、VMAについて以下の機能改善を行います。
- すべての新機能の利用は任意です。
- 利用形態ごとの利用可能機能は下表のとおりです。

変更内容	利用形態		
	API	CLI	GUI
<p>□エラーポジションスキップモードの追加</p> <ul style="list-style-type: none"> □エラーポジションスキップモードを指定した場合、ポジションファイル（Position情報部のみ）内にエラーとなるレコードがあった際、当該レコードを読み飛ばして処理を継続することを可能とします。 □同モードを指定しない場合、これまで通りの挙動（エラーとなるレコードがあった際は処理をキャンセル）となります。 	○	N/A	N/A
<p>□インプットファイル基準日返却機能追加</p> <ul style="list-style-type: none"> □メモリにロードされたインプットファイルの基準日を返却するAPIを追加します。 	○	N/A	N/A
<p>□ポジションファイル内許容文字の追加</p> <ul style="list-style-type: none"> □ポジションファイル（csv）（GUI版、CLI版）及びポジションデータ（json）（API版）の以下項目において、英数字に加え、<u>スペースを含む記号の入力を許容</u>します。 <ul style="list-style-type: none"> ・オムニバス顧客ID ・取引参加者コード及びアカウントコード 	○	○	○

2. 各変更点の概要 ④サポート対象のOS及びjavaの変更

- VMA CLI版及びAPI版について、Red Hatによるサポート期限切れバージョン及び新規追加されたバージョンを踏まえて下表のとおりサポート対象を変更いたします。
- VMA GUI版に関係する更新はございません。
- ソフトウェアを起動するOSにはサポート対象のJavaのインストールが必要です。

OS/Java	バージョン		GUI (参考)	CLI	API
OS	Windows Client Enterprise	Windows10 (64ビット版) (※1)	○	○	○
		Windows11	○	○	○
	Windows Server Standard	Windows Server 2016	×	○	○
		Windows Server 2019	×	○	○
		Windows Server 2022	×	○	○
	Red Hat Enterprise Linux7	7.7	×	○	○
		7.9	×	○	○
	Red Hat Enterprise Linux8	8.2	×	○→×	○→×
		8.4	×	○→×	○→×
		8.6	×	×	○
		8.8	×	×	○
	Red Hat Enterprise Linux9	9.0	×	×	○
9.2		×	×	○	
Java	JRE	8 (64ビット版) (※2)	○	○	○
		11	○	○	○
		17	○	○	○

(*1) Windows 10 Enterprise(32ビット)はサポート対象外

(*2) JRE 8(32ビット版)はサポート対象外

(○ : 対象、× : 対象外)

Ⅱ. スケジュール等



1. 全体スケジュール

- 本番稼働予定日を2024年6月10日とします。
- 本番稼働予定日までのスケジュールは以下のとおりを予定しています。

	2023	2024					
	12	1	2	3	4	5	6
マイルストーン		★VaR証拠金 計算ソフトウェア (v2.0版)公開					★本番稼働
資料公開 タイミング	★対応概要書(本資料)	★VaR証拠金計算ソフトウェア概要書 及び接続仕様書一式					
(参考)その他				★3/18	JPXプライム150指数先物取引 電力先物週間物取引 本番稼働		

2. ドキュメント・ソフトウェアの提供スケジュール

- 各ドキュメント及びソフトウェアは2024年1月頃に公開します。
- ソフトウェア及び仕様書はJSCC Webページへ掲載予定です。
- VaR証拠金ソフトウェア（API/CLI）については専用ページに掲載します。

#	カテゴリ	ドキュメント等	掲載箇所	公表時期
1	VaR証拠金ソフトウェア 仕様関連ドキュメント	VaR証拠金ソフトウェア概要書2.0版	JSCC Web	2024年1月頃
		VaR証拠金ソフトウェア接続仕様書2.0版 (GUI/CLI/API) (*)	JSCC Web (CLI版、API版については対 象者専用ページ)	
2	VaR証拠金ソフトウェア	VaR証拠金ソフトウェアv2.0版 (GUI/CLI/API) (*)	JSCC Web (CLI版、API版については対 象者専用ページ)	

(*) API版については、VMAのAPI利用契約を締結した利用者のみ公開いたします。