

本番並行稼働の概要

- 本番稼働に先立ち、円滑なVaR証拠金への移行を促進するために、2023年8月から本番データに基づいて証拠金計算用パラメータファイルを公開いたします。
- 証拠金計算用パラメータファイルとVaR証拠金計算ソフトウェアを利用することで、VaR方式による証拠金所要額を事前に把握することができます。
- 証拠金計算用パラメータファイル公開の運用は以下のとおりです。

#	項目	概要
1	BPFに収録される銘柄	<ul style="list-style-type: none">• J-GATEの本番環境で実際に取引可能な銘柄が収録されます。• また、これらの銘柄は上場派生清算システムのcCranやFIX電文から取得できる銘柄と同一です。
2	清算値段等のマーケットデータ	<ul style="list-style-type: none">• 実際の清算値段およびこれらをもとに算出したヒストリカルシナリオ等が収録されます。
3	配信日	<ul style="list-style-type: none">• 原則毎営業日公表いたします（ただし、祝日取引実施日は除く）。
4	配信対象	<ul style="list-style-type: none">• EODで公表するBPF、VPFおよび1枚あたりの証拠金所要額を対象に公表いたします。• 日中証拠金、緊急証拠金、翌日向けの各種ファイルおよびEODのAPFについては、配信いたしません。
5	配信時刻	<ul style="list-style-type: none">• 通常19時頃までに公表いたしますが、システムの運行状況によりこれを超える可能性があります。
5	公表先URL	<ul style="list-style-type: none">• BPF、VPF https://jscc-h.jpx.co.jp/jscc/listed-derivatives/weekday/index.html• 銘柄別VaR証拠金額ファイル（1枚あたり証拠金額ファイル） https://jscc-h.jpx.co.jp/jscc/listed-derivatives/im/index.html （本番稼働後に上記ファイルを掲載するURLと同じ）
6	AS-VaRパラメータ	<ul style="list-style-type: none">• 原則毎週最終営業日にJSCCウェブサイトにて公表いたします。 https://www.jpx.co.jp/jscc/datafeed/derivatives/reference/ （本番稼働後にAS-VaRパラメータファイルを掲載するURLと同じ）