

SPANリスク・パラメーター・ファイル仕様書

株式会社日本証券クリアリング機構

2017年11月改訂版

※フレックス・オプション取引に関する記載については、大阪取引所における同商品の導入以降に適用する。

SPAN及びPC-SPANは、CME (Chicago Mercantile Exchange) に登録された商標です。この資料における使用は許諾されていますが、CMEは、いかなる者もしくは団体によるSPANの利用について、一切の責任を負いません。なお、当資料の記載内容については、CMEが公表する内容が優先し、これらは予告なしに変更することがありますので、ご注意ください。

SPANリスク・パラメーター・ファイル仕様書

| #(変更歴) 版 | 日付 | 項目 | 項番 | 概要 |
|-------------|-------------------|--------------------------------|----|--|
| 2015年5月 | 2015/5/25 | Weeklyオプションの導入に伴う変更 | 1 | <ul style="list-style-type: none"> ・タイプ3レコード No.05,06,08,09,11,12,14,15における内容を備考参照に変更 備考に限月に係る記載を追加し、Weeklyオプションに係る限月設方法記載 ・タイプ4レコード No.06,09における内容をタイプ3レコードの備考3を参照するように変更 ・タイプ81・82レコード No.07,10における内容をタイプ3レコードの備考3を参照するように変更 ・タイプ8レコード No.08,11における内容を備考4を参照するように変更 備考4の記載を変更 ・タイプBレコード No.05,08における内容をタイプ3レコードの備考3を参照するように変更 ・タイプ6レコード No.06,09における内容を備考5を参照するように変更 備考4,5の記載を変更 ・タイプEレコード No.05,09,13,17における内容をタイプ3レコードの備考3を参照するように変更 ・タイプSレコード No.06,07,09,10,12,13,15,16,18,19における内容をタイプ3レコードの備考3を参照するように変更 |
| 2018年2月 | 2017/3/31 公表版 | Weeklyオプションレコードの収録方法の一部変更 | 1 | <ul style="list-style-type: none"> ・タイプ3レコード No.5(ティア1の開始限月)の備考欄における内容について、Weeklyオプションの限月コード設定方法の変更に伴い、記載を変更。 |
| | | フレックス・オプションの導入に伴う変更 | 2 | <ul style="list-style-type: none"> ・タイプ81レコード、タイプ82レコード No.11(オプション限日/限週コード)における内容について、フレックス・オプション導入後の取扱いを追加。 ・タイプBレコード No.9(オプション限日/限週コード)における内容について、フレックス・オプション導入後の取扱いを追加。 |
| | | 有価証券オプション取引に係る商品グループ群コード設定値の変更 | 3 | <ul style="list-style-type: none"> ・タイプ5レコード、タイプ6レコード No.2(商品グループ群コード)における内容について、有価証券オプション取引に係る商品グループ群コード設定値を変更。 |
| | | ファイル種別等に係る設定値の変更 | 4 | <ul style="list-style-type: none"> ・タイプ0レコード No.4(ファイル種別)、No.5(ファイルID)、No.6(営業日時刻)における内容について、デリバティブ清算刷新プロジェクト以降の取扱いを追加。 |
| | 2017/11/22 改訂版 | その他 | 1 | <ul style="list-style-type: none"> ・表紙 フレックス・オプション取引に関する記載を追加。 ・タイプ0レコード、タイプ3レコード、タイプBレコード、タイプCレコード、タイプPレコード、タイプTレコードの |

SPANリスク・パラメーター・ファイル仕様書

タイプ0レコード 【取引所グループヘッダー】

| No. | 項目名 | Name of Item | 位置 From | 桁数 Length | 属性 Format | 内容 Description | 設定例(△は空白) Example(△ indicates blank) |
|-----|-------------------|---------------------------------|------------|--------------|--------------|--|---|
| 01 | レコードID | Record ID | 1 | 2 | X(02) | 「0」：タイプ0レコード(固定) | 0△ |
| 02 | 取引所グループ略称 | Exchange Complex Acronym | 3 | 6 | X(06) | 「0SE」：大阪取引所 | 0SE△△△ |
| 03 | 営業日付 | Business Date | 9 | 8 | 9(08) | 西暦4桁+月2桁+日2桁の形式で指定 | 20170215 |
| 04 | ファイル種別 | Settlement or Intraday Flag | 17 | 1 | X(01) | 「I」：日中取引証拠金 「I」：緊急取引証拠金 「S」：取引終了後 | S |
| 05 | ファイルID | File Identifier | 18 | 2 | X(02) | 「E」：アーリーファイル 「FC」：アーリーファイル以外 | FC |
| 06 | 営業日時刻 | Business Time | 20 | 4 | 9(04) | 「I100」：日中取引証拠金 「I300」：緊急取引証拠金 「I600」：アーリーファイル 「I700」：ファイナルファイル | 1700 |
| 07 | ファイル作成日 | File Creation Date | 24 | 8 | 9(08) | 西暦4桁+月2桁+日2桁の形式で指定 | 20170215 |
| 08 | ファイル作成時刻 | File Creation Time | 32 | 4 | 9(04) | 時2桁+分2桁の形式で指定 | 1545 |
| 09 | ファイルフォーマット | File Format | 36 | 2 | X(02) | 「U2」：エクスパンドフォーマット(固定) | U2 |
| 10 | グロス/ネット証拠金インディケータ | Gross/Net-margining Indicator | 38 | 1 | X(01) | 「G」：グロス 「N」：ネット | N |
| 11 | オプション価値制限フラグ | Overall Limit Option Value Flag | 39 | 1 | X(01) | 「Y」：採用 「N」：不採用 | N |
| 12 | 予備 | Filler | 40 | 11 | X(11) | 空白 | |
| 13 | クリアリング/顧客コード | Clearing or Customer Code | 51 | 1 | X(01) | 「A」：クリアリング 「C」または空白：顧客 | |
| 14 | 予備 | Filler | 52 | 1 | X(01) | 空白 | |
| 15 | クリアリング/顧客の略称 | Clearing or Customer Acronym | 53 | 5 | X(05) | 「CUST」：顧客 「CLR」または空白：クリアリング | |
| 16 | 予備 | Filler | 58 | 1 | X(01) | 空白 | |
| 17 | アカウントタイプコード | Account Type Code | 59 | 1 | X(01) | 清算会社/顧客コード(項目No.13)が「A」(清算会社)の場合 「N」または空白：ノーマル 「M」：メンバー 清算会社/顧客コード(項目No.13)が「C」(顧客)の場合 「H」または空白：ヘッジャー 「M」：メンバー 「S」：スプレューター | |
| 18 | 予備 | Filler | 60 | 1 | X(01) | 空白 | |

タイプ0レコード 【取引所グループヘッダー】

| No. | 項目名 | Name of Item | 位置 From | 桁数 Length | 属性 Format | 内容 Description | 設定例(△は空白) Example(△ indicates blank) |
|-----|-------------|--------------------------------|------------|--------------|--------------|---|---|
| 19 | アカウントタイプの略称 | Account Type Acronym | 61 | 5 | X(05) | 清算会社／顧客コード(項目No.13)が「A」(清算会社)の場合 「NRML」または空白：ノーマル 「MBR」：メンバー 清算会社／顧客コード(項目No.13)が「C」(顧客)の場合 「HEDGE」または空白：ヘッジャー 「MBR」：メンバー 「SPEC」：スペキュレーター | |
| 20 | 予備 | Filler | 66 | 1 | X(01) | 空白 | |
| 21 | 証拠金クラスコード | Performance Bond Class Code | 67 | 1 | X(01) | 「1」または空白：メイン 「2」：予備 | |
| 22 | 予備 | Filler | 68 | 1 | X(01) | 空白 | |
| 23 | 証拠金クラスの略称 | Performance Bond Class Acronym | 69 | 5 | X(05) | 「CORE」または空白：メイン 「RESRV」：予備 | |
| 24 | 予備 | Filler | 74 | 1 | X(01) | 空白 | |
| 25 | 当初・維持証拠金コード | Maintenance or Initial Code | 75 | 1 | X(01) | 「M」または空白：維持証拠金 「I」：当初証拠金 | |
| 26 | 予備 | Filler | 76 | 1 | X(01) | 空白 | |
| 27 | 当初・維持証拠金の略称 | Maintenance or Initial Acronym | 77 | 5 | X(05) | 「MAINT」または空白：維持証拠金 「INITI」：当初証拠金 | |
| 28 | 予備 | Filler | 82 | 51 | X(51) | 空白 | |

【備考】

1. クリアリング／顧客コード(項目No.13)以降のフィールドが空白かNULLの場合、またはレコードの最終の空白が切り捨てられて存在しない場合、上記の通りにデフォルト設定を採用する必要があります。

SPANリスク・パラメーター・ファイル仕様書

タイプ1レコード 【取引所ヘッダー】

| No. | 項目名 | Name of Item | 位置 From | 桁数 Length | 属性 Format | 内容 Description | 設定例(△は空白) Example(△ indicates blank) |
|-----|--------|------------------|------------|--------------|--------------|-------------------|---|
| 01 | レコードID | Record ID | 1 | 2 | X(02) | 「1」：タイプ1レコード(固定) | 1△ |
| 02 | 取引所略称 | Exchange Acronym | 3 | 3 | X(03) | 「0SE」：大阪取引所 | 0SE |
| 03 | 予備 | Filler | 6 | 2 | X(02) | 空白 | △△ |
| 04 | 取引所コード | Exchange Code | 8 | 2 | X(02) | 「0S」：大阪取引所 | 0S |
| 05 | 予備 | Filler | 10 | 123 | X(123) | 空白 | |

SPANリスク・パラメーター・ファイル仕様書

タイプ2レコード 【第1商品グループレコード】

| No. | 項目名 | Name of Item | 位置 From | 桁数 Length | 属性 Format | 内容 Description | 設定例(△は空白) Example(△ indicates blank) |
|-----|----------------------------------|---|------------|--------------|--------------|---|---|
| 01 | レコードID | Record ID | 1 | 2 | X(02) | 「2」：タイプ2レコード(固定) | 2△ |
| 02 | 取引所略称 | Exchange Acronym | 3 | 3 | X(03) | 「OSE」：大阪取引所 | OSE |
| 03 | 予備 | Filler | 6 | 1 | X(01) | 空白 | △ |
| 04 | 商品グループコード | Combined Commodity Code | 7 | 6 | X(06) | 「RPF及びAPFにおいて使用する商品コード」を参照。 | NK225△ |
| 05 | リスク乗数 | Risk Exponent | 13 | 1 | 9(01) | 備考1. 参照 | 2 |
| 06 | 証拠金通貨ISOコード | Performance Bond Currency ISO Code | 14 | 3 | X(03) | 「JPY」：日本円(固定) | JPY |
| 07 | 証拠金通貨コード | Performance Bond Currency Code | 17 | 1 | X(01) | 「Y」：円(固定) | Y |
| 08 | オプション証拠金スタイル | Option Margin Style | 18 | 1 | X(01) | 「P」または空白：プレミアム方式 「F」：先物方式 | P |
| 09 | オプション価値制限(ネット・オプション 価値の上限)フラグ | Limit Option Value (Cap Available Net Option Value) Flag | 19 | 1 | X(01) | 「Y」：採用 「N」または空白：不採用 備考4. 参照 | N |
| 10 | コンビネーション証拠金算出手順 フラグ | Combination Margining Method Flag | 20 | 1 | X(01) | 「S」：split-allocation 「D」または空白：delta-split-allocation | △ |
| 11 | 予備 | Filler | 21 | 2 | X(02) | 空白 | △△ |
| 12 | 商品コード1 | Commodity (Product) Code 1 | 23 | 10 | X(10) | | NK225△△△△△ |
| 13 | 商品タイプ1 | Contract Type 1 | 33 | 3 | X(03) | 備考2. 参照 | PHY |
| 14 | 予備 | Filler | 36 | 3 | X(03) | 空白 | △△△ |
| 15 | 商品コード2 | Commodity (Product) Code 2 | 39 | 10 | X(10) | | NK225F△△△△ |
| 16 | 商品タイプ2 | Contract Type 2 | 49 | 3 | X(03) | 備考2. 参照 | FUT |
| 17 | 予備 | Filler | 52 | 3 | X(03) | 空白 | △△△ |
| 18 | 商品コード3 | Commodity (Product) Code 3 | 55 | 10 | X(10) | | NK225MF△△△ |
| 19 | 商品タイプ3 | Contract Type 3 | 65 | 3 | X(03) | 備考2. 参照 | FUT |
| 20 | 予備 | Filler | 68 | 3 | X(03) | 空白 | △△△ |
| 21 | 商品コード4 | Commodity (Product) Code 4 | 71 | 10 | X(10) | | NK225E△△△△ |
| 22 | 商品タイプ4 | Contract Type 4 | 81 | 3 | X(03) | 備考2. 参照 | OOP |
| 23 | 予備 | Filler | 84 | 3 | X(03) | 空白 | △△△ |

SPANリスク・パラメーター・ファイル仕様書

タイプ2レコード 【第1商品グループレコード】

| No. | 項目名 | Name of Item | 位置 From | 桁数 Length | 属性 Format | 内容 Description | 設定例(△は空白) Example(△ indicates blank) |
|-----|--------|----------------------------|------------|--------------|--------------|-------------------|---|
| 24 | 商品コード5 | Commodity (Product) Code 5 | 87 | 10 | X(10) | | NK225W1△△△ |
| 25 | 商品タイプ5 | Contract Type 5 | 97 | 3 | X(03) | 備考2. 参照 | OOP |
| 26 | 予備 | Filler | 100 | 3 | X(03) | 空白 | △△△ |
| 27 | 商品コード6 | Commodity (Product) Code 6 | 103 | 10 | X(10) | | NK225W3△△△ |
| 28 | 商品タイプ6 | Contract Type 6 | 113 | 3 | X(03) | 備考2. 参照 | OOP |
| 29 | 予備 | Filler | 116 | 17 | X(17) | 空白 | |

【備考】

- リスク乗数(項目No.05)は、リスクアレイ値、売オプション最低証拠金額、プライス・スキャンレンジ、1ネット・デルタ当たりの最終決済証拠金額(消費デルタ)、1ネット・デルタ当たりの最終決済証拠金額(残余デルタ)及び商品内スプレッド割増額に適用されます。
- 商品タイプ(項目No.13,16,19,22,25,28)には、以下の内容が設定されます。
「FUT」: 先物(future)
「PHY」: 現物(physical)
「CMB」: コンビネーション(combination)
「OOF」: 先物オプション(option on future)
「OOP」: 現物オプション(option on physical)
「OOC」: コンビネーションオプション(option on combination)
- 1つのタイプ2レコードで最大6個の商品コードと商品タイプを設定することができます。もし、7個以上の設定をする場合は、最初のタイプ2レコードの直後に追加されます。
- オプション価値制限フラグ(項目No.09)が「Y」の場合、ネット・オプション価値に上限が設定されます。

タイプ3レコード 【第2商品グループレコード（商品内スプレッド割増額パラメーター）】

| No. | 項目名 | Name of Item | 位置 From | 桁数 Length | 属性 Format | 内容 Description | 設定例(△は空白) Example(△ indicates blank) |
|-----|---------------------|--|------------|--------------|--------------|--|---|
| 01 | レコードID | Record ID | 1 | 2 | X(02) | 「3」：タイプ3レコード(固定) | 3△ |
| 02 | 商品グループコード | Combined Commodity Code | 3 | 6 | X(06) | 「RPF及びAPFにおいて使用する商品コード」を参照。 | NK225△ |
| 03 | 商品内スプレッド割増額の計算手順コード | Intra-commodity (Intermonth) Spread Charge Method Code | 9 | 2 | X(02) | 「01」：商品内スプレッド割増額の設定なし 「10」：テーブル制御方式 備考1及び備考2参照 | 10 |
| 04 | ティア1番号 | Tier 1 Tier Number | 11 | 2 | 9(02) | | 01 |
| 05 | ティア1の開始限月 | Tier 1 Starting Contract Month | 13 | 6 | 9(06) | 備考3参照 | 201703 |
| 06 | ティア1の終了限月 | Tier 1 Ending Contract Month | 19 | 6 | 9(06) | 備考3参照 | 202901 |
| 07 | ティア2番号 | Tier 2 Tier Number | 25 | 2 | 9(02) | | △△ |
| 08 | ティア2の開始限月 | Tier 2 Starting Contract Month | 27 | 6 | 9(06) | 備考3参照 | △△△△△△ |
| 09 | ティア2の終了限月 | Tier 2 Ending Contract Month | 33 | 6 | 9(06) | 備考3参照 | △△△△△△ |
| 10 | ティア3番号 | Tier 3 Tier Number | 39 | 2 | 9(02) | | △△ |
| 11 | ティア3の開始限月 | Tier 3 Starting Contract Month | 41 | 6 | 9(06) | 備考3参照 | △△△△△△ |
| 12 | ティア3の終了限月 | Tier 3 Ending Contract Month | 47 | 6 | 9(06) | 備考3参照 | △△△△△△ |
| 13 | ティア4番号 | Tier 4 Tier Number | 53 | 2 | 9(02) | | △△ |
| 14 | ティア4の開始限月 | Tier 4 Starting Contract Month | 55 | 6 | 9(06) | 備考3参照 | △△△△△△ |
| 15 | ティア4の終了限月 | Tier 4 Ending Contract Month | 61 | 6 | 9(06) | 備考3参照 | △△△△△△ |

タイプ3レコード 【第2商品グループレコード（商品内スプレッド割増額パラメーター）】

| No. | 項目名 | Name of Item | 位置 From | 桁数 Length | 属性 Format | 内容 Description | 設定例(△は空白) Example(△ indicates blank) |
|-----|-------------------------------|--|------------|--------------|--------------|-------------------|---|
| 16 | 予備 | Filler | 67 | 2 | X(02) | 空白 | △△ |
| 17 | 当初/維持証拠金比率(メンバーアカウント) | Initial to Maintenance Ratio – Member Account | 69 | 4 | 9(1)V9(3) | 整数1桁＋小数点以下3桁で指定 | 1000 |
| 18 | 当初/維持証拠金比率(ヘッジャーアカウント) | Initial to Maintenance Ratio – Hedger Account | 73 | 4 | 9(1)V9(3) | 整数1桁＋小数点以下3桁で指定 | 1000 |
| 19 | 当初/維持証拠金比率 (スペキュレーターアカウント) | Initial to Maintenance Ratio – Speculator Account | 77 | 4 | 9(1)V9(3) | 整数1桁＋小数点以下3桁で指定 | 1000 |
| 20 | 予備 | Filler | 81 | 52 | X(52) | 空白 | |

【備考】

- 商品内スプレッド割増額の計算手順コード(項目No.03)が「01」の場合、当該商品グループの商品内スプレッド割増額はありません。
- 商品内スプレッド割増額の計算手順コード(項目No.03)が「10」の場合、1レコードに4つの商品内スプレッドティアを設定することができます。
1つの商品グループに5つ以上のティアを設定する場合は、最初のタイプ3レコードの直後に追加されます。
- 限月コード(項目No.04～15)の設定方法は以下のとおりとなります。
西暦(4桁)＋限月※(2桁)を設定する。

【例】

2015年3月限 → 201503

SPANリスク・パラメーター・ファイル仕様書

タイプ4レコード 【第3商品グループレコード（最終決済証拠金パラメーター）】

| No. | 項目名 | Name of Item | 位置 From | 桁数 Length | 属性 Format | 内容 Description | 設定例(△は空白) Example(△ indicates blank) |
|-----|------------------|------------------------------------|------------|--------------|--------------|--|---|
| 01 | レコードID | Record ID | 1 | 2 | X(02) | 「4」：タイプ4レコード(固定) | 4△ |
| 02 | 商品グループコード | Combined Commodity Code | 3 | 6 | X(06) | 「RPF及びAPFにおいて使用する商品コード」を参照。 | NK225△ |
| 03 | 最終決済証拠金額の計算手順コード | Delivery (Spot) Charge Method Code | 9 | 2 | X(02) | 「01」：最終決済証拠金額なし 「10」：テーブル駆動方式 「11」：ベシスリスク方式 備考1. 参照 | 01 |

項目No.03が「01」または「10」の場合

| | | | | | | | |
|----|---------------------------------------|---|----|---|-------|----------------|---------|
| 04 | 最終決済証拠金額の対象限月数 | Number of contract months in delivery | 11 | 2 | 9(02) | | △△ |
| 05 | 最終決済証拠金対象限月1の限月番号 | Delivery Month1 - Month Number | 13 | 2 | 9(02) | | △△ |
| 06 | 対象限月1の限月 | Delivery Month1 - Contract Month | 15 | 6 | 9(06) | タイプ3レコードの備考3参照 | △△△△△△ |
| 07 | 対象限月1の1ネット・デルタ当たりの 最終決済証拠金額(消費デルタ) | Delivery Month1 - Charge Rate Per Delta Consumed By Spreads | 21 | 7 | 9(07) | | △△△△△△△ |
| 08 | 対象限月1の1ネット・デルタ当たりの 最終決済証拠金額(残余デルタ) | Delivery Month1 - Charge Rate Per Delta Remaining In Outrights | 28 | 7 | 9(07) | | △△△△△△△ |
| 09 | 最終決済証拠金対象限月2の限月番号 | Delivery Month2 - Month Number | 35 | 2 | 9(02) | | △△ |
| 10 | 対象限月2の限月 | Delivery Month2 - Contract Month | 37 | 6 | 9(06) | タイプ3レコードの備考3参照 | △△△△△△ |
| 11 | 対象限月2の1ネット・デルタ当たりの 最終決済証拠金額(消費デルタ) | Delivery Month2 - Charge Rate Per Delta Consumed By Spreads | 43 | 7 | 9(07) | | △△△△△△△ |
| 12 | 対象限月2の1ネット・デルタ当たりの 最終決済証拠金額(残余デルタ) | Delivery Month2 - Charge Rate Per Delta Remaining In Outrights | 50 | 7 | 9(07) | | △△△△△△△ |
| 13 | 予備 | Filler | 57 | 6 | 9(06) | | △△△△△△ |

タイプ4レコード 【第3商品グループレコード（最終決済証拠金パラメーター）】

| No. | 項目名 | Name of Item | 位置 From | 桁数 Length | 属性 Format | 内容 Description | 設定例(△は空白) Example(△ indicates blank) |
|------------------------|---------------------|---|------------|--------------|--------------|-----------------------|--|
| 項目No.03が「11」の場合 | | | | | | | |
| 04 | 現渡商品コード | Spot commodity (Product) Code | 11 | 10 | X(10) | 項目No.03が「11」の場合のみ使用 | △△△△△△△△△△ |
| 05 | ベースリスクチャージレート | Basis Risk Charge Rate | 21 | 7 | 9(07) | 項目No.03が「11」の場合のみ使用 | △△△△△△△ |
| 06 | 予備 | Filler | 28 | 35 | X(35) | 項目No.03が「11」の場合のみ使用 | △△△△△△△△△△△△△△△△△△△△ △△△△△△△△△△△△△△△△△△△△ |
| 14 | 売オプション1単位当たりの最低証拠金額 | Short Option Minimum Charge Rate | 63 | 7 | 9(07) | | 0000776 |
| 15 | 維持証拠金調整係数（メンバー用） | Risk Maintenance Performance Bond Adjustment Factor - Members | 70 | 3 | 9(1)V9(2) | 整数1桁＋小数点以下2桁で指定備考2.参照 | 100 |
| 16 | 維持証拠金調整係数（ヘッジャー用） | Risk Maintenance Performance Bond Adjustment Factor - Hedgers | 73 | 3 | 9(1)V9(2) | 整数1桁＋小数点以下2桁で指定備考2.参照 | 100 |
| 17 | 維持証拠金調整係数（スプレューター用） | Risk Maintenance Performance Bond Adjustment Factor - | 76 | 3 | 9(1)V9(2) | 整数1桁＋小数点以下2桁で指定備考2.参照 | 100 |
| 18 | 売オプション最低証拠金額計算方法 | Short Option Minimum Calculation Method | 79 | 1 | X(01) | 備考3.参照 | 2 |
| 19 | 予備 | Filler | 80 | 53 | X(53) | 空白 | |

【備考】

1. 最終決済証拠金額の計算手順コード(項目No.03)が「10」の場合、1レコードに2つの対象限月を設定することができます。1つの商品グループに3つ以上の対象限月がある場合は、最初のタイプ4レコードの直後に追加されます。
2. 維持証拠金調整係数(項目No.15,16,17)が「0」または「空白」の場合、デフォルト値の「100」となります。
3. 売オプション最低証拠金額計算方法(項目No.18)は、売オプション最低証拠金額の計算の対象となる売オプションの建玉数を決定する方法です。「1」はコールとプットの建玉数の多い方、「2」はコールとプットの建玉数合計を使用します。

SPANリスク・パラメーター・ファイル仕様書

タイプ5レコード 【商品グループレコード】

| No. | 項目名 | Name of Item | 位置 From | 桁数 Length | 属性 Format | 内容 Description | 設定例(△は空白) Example(△ indicates blank) |
|-----|-------------|-------------------------------|------------|--------------|--------------|--|---|
| 01 | レコードID | Record ID | 1 | 2 | X(02) | 「5」：タイプ5レコード(固定) | 5△ |
| 02 | 商品グループ群コード | Combined Commodity Group Code | 3 | 3 | X(03) | 「IDX」：指数系グループ群、有価証券オプショング グループ群 「JGB」：国債系グループ群 | IDX |
| 03 | 予備 | Filler | 6 | 7 | X(07) | 空白 | △△△△△△△ |
| 04 | 商品グループコード1 | Combined Commodity Code1 | 13 | 6 | X(06) | 「RPF及びAPFにおいて使用する商品コード」を参照。 | DJIA△△ |
| 05 | 商品グループコード2 | Combined Commodity Code2 | 19 | 6 | X(06) | | FC50△△ |
| 06 | 商品グループコード3 | Combined Commodity Code3 | 25 | 6 | X(06) | | FTSEJP |
| 07 | 商品グループコード4 | Combined Commodity Code4 | 31 | 6 | X(06) | | JN400△ |
| 08 | 商品グループコード5 | Combined Commodity Code5 | 37 | 6 | X(06) | | MOT△△△ |
| 09 | 商品グループコード6 | Combined Commodity Code6 | 43 | 6 | X(06) | | NIFTY△ |
| 10 | 商品グループコード7 | Combined Commodity Code7 | 49 | 6 | X(06) | | NK225△ |
| 11 | 商品グループコード8 | Combined Commodity Code8 | 55 | 6 | X(06) | | NKVI△△ |
| 12 | 商品グループコード9 | Combined Commodity Code9 | 61 | 6 | X(06) | | NKYD△△ |
| 13 | 商品グループコード10 | Combined Commodity Code10 | 67 | 6 | X(06) | | REIT△△ |
| 14 | 予備 | Filler | 73 | 60 | X(60) | 空白 | |

【備考】

- 1つのタイプ5レコードで最大10個の商品グループコードを設定することができます。もし、11個以上の商品グループコードを設定する場合は、最初のタイプ5レコードの直後に追加されます。

タイプ6レコード 【商品間スプレッドレコード】

| No. | 項目名 | Name of Item | 位置 From | 桁数 Length | 属性 Format | 内容 Description | 設定例(△は空白) Example(△ indicates blank) |
|-----|---------------------------------|---|------------|--------------|--------------|---|---|
| 01 | レコードID | Record ID | 1 | 2 | X(02) | 「6」：タイプ6レコード(固定) | 6△ |
| 02 | 商品グループ群コード | Commodity Group Code | 3 | 3 | X(03) | 「IDX」：指数系グループ群、有価証券オブショング ループ群 「JGB」：国債系グループ群 | IDX |
| 03 | スプレッド優先順位 | Spread Priority | 6 | 4 | 9(04) | | 0001 |
| 04 | 商品間スプレッド・クレジットレート | Spread Credit Rate, in Percent | 10 | 7 | 9(3)V9(4) | 整数3桁＋小数点以下4桁で指定 | 0908400 |
| 05 | レグ1の取引所略称 | Exchange Acronym Leg1 | 17 | 3 | X(03) | 「OSE」：大阪取引所 | OSE |
| 06 | 予備 | Filler | 20 | 1 | X(01) | 空白 | △ |
| 07 | レグ1の商品グループコード | Combined Commodity Code Leg1 | 21 | 6 | X(06) | 「RPF及びAPFにおいて使用する商品コード」を参照。 | NK225△ |
| 08 | レグ1の商品間デルタ／スプレッド比率 | Delta Per Spread Ratio Leg1 | 27 | 7 | 9(3)V9(4) | 整数3桁＋小数点以下4桁で指定 | 0010000 |
| 09 | レグ1のマーケットサイド・インディケータ | Spread Side Leg1 | 34 | 1 | X(01) | 「A」または「B」を指定 | A |
| 10 | レグ2の取引所略称 | Exchange Acronym Leg2 | 35 | 3 | X(03) | 「OSE」：大阪取引所 | OSE |
| 11 | 予備 | Filler | 38 | 1 | X(01) | 空白 | △ |
| 12 | レグ2の商品グループコード | Combined Commodity Code Leg2 | 39 | 6 | X(06) | 「RPF及びAPFにおいて使用する商品コード」を参照。 | TOPIX△ |
| 13 | レグ2の商品間デルタ／スプレッド比率 | Delta Per Spread Ratio Leg2 | 45 | 7 | 9(3)V9(4) | 整数3桁＋小数点以下4桁で指定 | 0012500 |
| 14 | レグ2のマーケットサイド・インディケータ | Spread Side Leg2 | 52 | 1 | X(01) | 「A」または「B」を指定 | B |
| 15 | レグ3の取引所略称 | Exchange Acronym Leg3 | 53 | 3 | X(03) | | |
| 16 | 予備 | Filler | 56 | 1 | X(01) | 空白 | |
| 17 | レグ3の商品グループコード | Combined Commodity Code Leg3 | 57 | 6 | X(06) | | |
| 18 | レグ3の商品間デルタ／スプレッド比率 | Delta Per Spread Ratio Leg3 | 63 | 7 | 9(3)V9(4) | 整数3桁＋小数点以下4桁で指定 | |
| 19 | レグ3のマーケットサイド・インディケータ | Spread Side Leg3 | 70 | 1 | X(01) | 「A」または「B」を指定 | |
| 20 | レグ4の取引所略称 | Exchange Acronym Leg4 | 71 | 3 | X(03) | | |
| 21 | 予備 | Filler | 74 | 1 | X(01) | 空白 | |
| 22 | レグ4の商品グループコード | Combined Commodity Code Leg4 | 75 | 6 | X(06) | | |
| 23 | レグ4の商品間デルタ／スプレッド比率 | Delta Per Spread Ratio Leg4 | 81 | 7 | 9(3)V9(4) | 整数3桁＋小数点以下4桁で指定 | |
| 24 | レグ4のマーケットサイド・インディケータ | Spread Side Leg4 | 88 | 1 | X(01) | 「A」または「B」を指定 | |
| 25 | 商品間スプレッド割引額の手順コード | Inter-commodity Spread Method Code | 89 | 2 | 9(02) | 「01」：ティアを使用しない 「20」：ティア使用 | |
| 26 | 商品間スプレッド割引額の手順4の 対象取引所略称 | Method4:Target Exchange Acronym | 91 | 3 | X(03) | | |
| 27 | 予備 | Filler | 94 | 1 | X(01) | 空白 | |
| 28 | 商品間スプレッド割引額の手順4の 対象商品グループコード | Method4:Target Combined Commodity Code | 95 | 6 | X(06) | | |
| 29 | 予備 | Filler | 101 | 1 | X(01) | 空白 | |
| 30 | レグ1のティア番号 | Tier Number Leg1 | 102 | 2 | 9(02) | | |
| 31 | レグ2のティア番号 | Tier Number Leg2 | 104 | 2 | 9(02) | | |
| 32 | レグ3のティア番号 | Tier Number Leg3 | 106 | 2 | 9(02) | | |

タイプ6レコード 【商品間スプレッドレコード】

| No. | 項目名 | Name of Item | 位置 From | 桁数 Length | 属性 Format | 内容 Description | 設定例(△は空白) Example(△ indicates blank) |
|-----|-----------|------------------|------------|--------------|--------------|-------------------|---|
| 33 | レグ4のティア番号 | Tier Number Leg4 | 108 | 2 | 9(02) | | |
| 34 | 予備 | Filler | 110 | 23 | X(23) | 空白 | |

【備考】

- 1つのタイプ6レコードで、1つのスプレッドのレグを最大4個設定することができます。1つのスプレッドに対するレグ数の上限はありません。もし、5個以上のレグを設定する場合は、最終のタイプ6レコードの直後に追加されます。
- 商品間スプレッド割引額の手順コード(項目No.25)の値は、現在のところ「01」または「20」となっています。このフィールドが空白またはこの2つの値以外の場合、「01」であると判断します。
 - ・方式「01」は、商品グループの全限月のデルタを使用してスプレッドを組成します。
 - ・方式「20」は、ティアを使用してスプレッドを組成します。
- 商品間スプレッド割引額の手順コード(項目No.25)が「01」の場合、使用されるレグのティア番号(項目No.30～33)に「00」が設定されます。「20」の場合は、各レグの商品間スプレッドに使用されるティア番号が設定されます。

タイプ81レコード 【リスクアレイ第1レコード】

| No. | 項目名 | Name of Item | 位置 From | 桁数 Length | 属性 Format | 内容 Description | 設定例(△は空白) Example(△ indicates blank) |
|-----|------------------|---|------------|--------------|--------------|-----------------------------|---|
| 01 | レコードID | Record ID | 1 | 2 | X(02) | 「81」：タイプ81レコード(固定) | 81 |
| 02 | 取引所略称 | Exchange Acronym | 3 | 3 | X(03) | 「OSE」：大阪取引所 | OSE |
| 03 | 商品(プロダクト)コード | Commodity (Product) Code | 6 | 10 | X(10) | 「RPF及びAPFにおいて使用する商品コード」を参照。 | NK225E△△△△ |
| 04 | 原資産コード | Underlying Commodity (Product) Code | 16 | 10 | X(10) | 「RPF及びAPFにおいて使用する商品コード」を参照。 | NK225△△△△△ |
| 05 | プロダクトタイプコード | Product Type Code | 26 | 3 | X(03) | 備考7. 参照 | OOP |
| 06 | プット/コール区分 | Option Right Code — for an option only | 29 | 1 | X(01) | 「P」：プット 「C」：コール | P |
| 07 | 先物限月 | Futures Contract Month | 30 | 6 | 9(06) | タイプ3レコードの備考3参照 | 201703 |
| 08 | 先物限日/限週コード | Futures Contract Day or Week Code | 36 | 2 | X(02) | 備考4. 参照 | △△ |
| 09 | 予備 | Filler | 38 | 1 | X(01) | 空白 | △ |
| 10 | オプション限月 | Option Contract Month | 39 | 6 | 9(06) | タイプ3レコードの備考3参照 | 201703 |
| 11 | オプション限日/限週コード | Option Contract Day or Week Code | 45 | 2 | X(02) | 備考5. 参照 | △△ |
| 12 | 予備 | Filler | 47 | 1 | X(01) | 空白 | △ |
| 13 | オプション権利行使価格 | Option Strike Price | 48 | 7 | 9(07) | | 0019250 |
| 14 | シナリオ1のリスクアレイ値 | Array Value1 : Futures No Change / Volatility Up | 55 | 5 | 9(05) | | 01609 |
| 15 | シナリオ1のリスクアレイ値の符号 | Sign for Array Value 1 | 60 | 1 | X(01) | 「+」または「-」を指定 | - |
| 16 | シナリオ2のリスクアレイ値 | Array Value2 : Futures No Change / Volatility Down | 61 | 5 | 9(05) | | 01666 |
| 17 | シナリオ2のリスクアレイ値の符号 | Sign for Array Value 1 | 66 | 1 | X(01) | 「+」または「-」を指定 | + |
| 18 | シナリオ3のリスクアレイ値 | Array Value3 : Futures Up 1/3 / Volatility Up | 67 | 5 | 9(05) | | 00572 |
| 19 | シナリオ3のリスクアレイ値の符号 | Sign for Array Value 3 | 72 | 1 | X(01) | 「+」または「-」を指定 | - |

タイプ81レコード 【リスクアレイ第1レコード】

| No. | 項目名 | Name of Item | 位置 From | 桁数 Length | 属性 Format | 内容 Description | 設定例(△は空白) Example(△ indicates blank) |
|-----|------------------|--|------------|--------------|--------------|-------------------|---|
| 20 | シナリオ4のリスクアレイ値 | Array Value4 : Futures Up 1/3 / Volatility Down | 73 | 5 | 9(05) | | 02126 |
| 21 | シナリオ4のリスクアレイ値の符号 | Sign for Array Value 4 | 78 | 1 | X(01) | 「+」または「-」を指定 | + |
| 22 | シナリオ5のリスクアレイ値 | Array Value5 : Futures Down 1/3 / Volatility Up | 79 | 5 | 9(05) | | 02886 |
| 23 | シナリオ5のリスクアレイ値の符号 | Sign for Array Value 5 | 84 | 1 | X(01) | 「+」または「-」を指定 | - |
| 24 | シナリオ6のリスクアレイ値 | Array Value6 : Futures Down 1/3 / Volatility Down | 85 | 5 | 9(05) | | 00464 |
| 25 | シナリオ6のリスクアレイ値の符号 | Sign for Array Value 6 | 90 | 1 | X(01) | 「+」または「-」を指定 | + |
| 26 | シナリオ7のリスクアレイ値 | Array Value7 : Futures Up 2/3 / Volatility Up | 91 | 5 | 9(05) | | 00242 |
| 27 | シナリオ7のリスクアレイ値の符号 | Sign for Array Value 7 | 96 | 1 | X(01) | 「+」または「-」を指定 | + |
| 28 | シナリオ8のリスクアレイ値 | Array Value8 : Futures Up 2/3 / Volatility Down | 97 | 5 | 9(05) | | 02232 |
| 29 | シナリオ8のリスクアレイ値の符号 | Sign for Array Value 8 | 102 | 1 | X(01) | 「+」または「-」を指定 | + |
| 30 | シナリオ9のリスクアレイ値 | Array Value9 : Futures Down 2/3 / Volatility Up | 103 | 5 | 9(05) | | 04412 |
| 31 | シナリオ9のリスクアレイ値の符号 | Sign for Array Value 9 | 108 | 1 | X(01) | 「+」または「-」を指定 | - |

【備考】

- リスクアレイ値は、正が損失額を表し、負が利益を表します。
- リスクアレイ値は、その商品グループの証拠金通貨で設定されています。
- この商品グループに対するリスク乗数が1以上の場合、「リスクアレイ値 × 10²」を行う必要があります。(Zはこの同属商品のリスク乗数)
- 限日/限週コード(項目No.08)には、空白が設定されます。
- 限日/限週コード(No.11)には、当該銘柄がフレックス・オプションである場合には満期日が設定され、その他の場合には、空白が設定されます。
- 原資産コード(項目No.04)は、証拠金の計算には使用しません。

タイプ81レコード 【リスクアレイ第1レコード】

| No. | 項目名 | Name of Item | 位置 From | 桁数 Length | 属性 Format | 内容 Description | 設定例(△は空白) Example(△ indicates blank) |
|-----|-----|--------------|------------|--------------|--------------|-------------------|---|
|-----|-----|--------------|------------|--------------|--------------|-------------------|---|

7. プロダクトタイプコード(項目No.05)には、以下の内容が設定されます。

「FUT」: 先物(future)

「PHY」: 現物(physical)

「CMB」: コンビネーション(combination)

「OOF」: 先物オプション(option on future)

「OOP」: 現物オプション(option on physical)

「OOC」: コンビネーションオプション(option on combination)

8. 空白の場合は、「+」であることを表します。

タイプ82レコード 【リスクアレイ第2レコード】

| No. | 項目名 | Name of Item | 位置 From | 桁数 Length | 属性 Format | 内容 Description | 設定例(△は空白) Example(△ indicates blank) |
|-----|-------------------|---|------------|--------------|--------------|-----------------------------|---|
| 01 | レコードID | Record ID | 1 | 2 | X(02) | 「82」：タイプ82レコード(固定) | 82 |
| 02 | 取引所略称 | Exchange Acronym | 3 | 3 | X(03) | 「OSE」：大阪取引所 | OSE |
| 03 | 商品(プロダクト)コード | Commodity (Product) Code | 6 | 10 | X(10) | 「RPF及びAPFにおいて使用する商品コード」を参照。 | NK225EFL△△ |
| 04 | 原資産コード | Underlying Commodity (Product) Code | 16 | 10 | X(10) | 「RPF及びAPFにおいて使用する商品コード」を参照。 | NK225△△△△△ |
| 05 | プロダクトタイプコード | Product Type Code | 26 | 3 | X(03) | 備考7. 参照 | OOP |
| 06 | プット/コール区分 | Option Right Code | 29 | 1 | X(01) | 「P」：プット 「C」：コール | C |
| 07 | 先物限月 | Futures Contract Month | 30 | 6 | 9(06) | タイプ3レコードの備考3参照 | 201703 |
| 08 | 先物限日/限週コード | Futures Contract Day or Week | 36 | 2 | X(02) | 備考4. 参照 | △△ |
| 09 | 予備 | Filler | 38 | 1 | X(01) | 空白 | △ |
| 10 | オプション限月 | Option Contract Month | 39 | 6 | 9(06) | タイプ3レコードの備考3参照 | 201703 |
| 11 | オプション限日/限週コード | Option Contract Day or Week | 45 | 2 | X(02) | 備考5. 参照 | 31 |
| 12 | 予備 | Filler | 47 | 1 | X(01) | 空白 | △ |
| 13 | オプション権利行使価格 | Option Strike Price | 48 | 7 | 9(07) | | 0019250 |
| 14 | シナリオ10のリスクアレイ値 | Array Value10 : Futures Down 2/3 / Volatility Down | 55 | 5 | 9(05) | | 03882 |
| 15 | シナリオ10のリスクアレイ値の符号 | Sign for Array Value 10 | 60 | 1 | X(01) | 「+」または「-」を指定 | + |
| 16 | シナリオ11のリスクアレイ値 | Array Value11 : Futures Up 3/3 / Volatility Up | 61 | 5 | 9(05) | | 07204 |
| 17 | シナリオ11のリスクアレイ値の符号 | Sign for Array Value 11 | 66 | 1 | X(01) | 「+」または「-」を指定 | - |
| 18 | シナリオ12のリスクアレイ値 | Array Value12 : Futures Up 3/3 / Volatility Down | 67 | 5 | 9(05) | | 05722 |
| 19 | シナリオ12のリスクアレイ値の符号 | Sign for Array Value 12 | 72 | 1 | X(01) | 「+」または「-」を指定 | - |

タイプ82レコード 【リスクアレイ第2レコード】

| No. | 項目名 | Name of Item | 位置 From | 桁数 Length | 属性 Format | 内容 Description | 設定例(△は空白) Example(△ indicates blank) |
|-----|--------------------|--|------------|--------------|--------------|------------------------------|---|
| 20 | シナリオ13のリスクアレイ値 | Array Value13 : Futures Down 3/3 / Volatility Up | 73 | 5 | 9(05) | | 01932 |
| 21 | シナリオ13のリスクアレイ値の符号 | Sign for Array Value 13 | 78 | 1 | X(01) | 「+」または「-」を指定 | + |
| 22 | シナリオ14のリスクアレイ値 | Array Value14 : Futures Down 3/3 / Volatility Down | 79 | 5 | 9(05) | | 04107 |
| 23 | シナリオ14のリスクアレイ値の符号 | Sign for Array Value 14 | 84 | 1 | X(01) | 「+」または「-」を指定 | + |
| 24 | シナリオ15のリスクアレイ値 | Array Value15 : Futures Up Extreme - Cover Fraction | 85 | 5 | 9(05) | | 06573 |
| 25 | シナリオ15のリスクアレイ値の符号 | Sign for Array Value 15 | 90 | 1 | X(01) | 「+」または「-」を指定 | - |
| 26 | シナリオ16のリスクアレイ値 | Array Value16 : Futures Down Extreme - Cover Fraction | 91 | 5 | 9(05) | | 01246 |
| 27 | シナリオ16のリスクアレイ値の符号 | | 96 | 1 | X(01) | 「+」または「-」を指定 | + |
| 28 | コンポジット・デルタ | Composite Delta | 97 | 5 | 9(05) | 整数1桁＋小数点以下4桁で指定 | 05862 |
| 29 | コンポジット・デルタの符号 | Sign for Composite Delta | 102 | 1 | X(01) | 「+」または「-」を指定 | + |
| 30 | インプライド・ボラティリティ | Implied Volatility as decimal fraction | 103 | 8 | 9(08) | 整数2桁＋小数点以下6桁で指定 | 00164727 |
| 31 | 清算値段(証拠金算定基準値段) | Settlement Price | 111 | 7 | 9(07) | | 0000415 |
| 32 | 清算値段(証拠金算定基準値段)の符号 | Sign for Settlement Price | 118 | 1 | X(01) | 「+」、「-」または「空白」を指定 備考8. 参照 | |

【備考】

- リスクアレイ値は、正が損失額を表し、負が利益を表します。
- リスクアレイ値は、その商品グループの証拠金通貨で設定されています。
- この商品グループに対するリスク乗数が1以上の場合、「リスクアレイ値 × 10²」を行う必要があります。(Zはこの同属商品のリスク乗数)
- 限日/限週コード(項目No.08,No.11)には、空白が設定されます。
- 限日/限週コード(No.11)には、当該銘柄がフレックス・オプションである場合には満期日が設定され、その他の場合には、空白が設定されます。
- 原資産コード(項目No.04)は、証拠金の計算には使用しません。
- プロダクトタイプコード(項目No.05)には、以下の内容が設定されます。
「FUT」: 先物(future)
「PHY」: 現物(physical)
「CMB」: コンビネーション(combination)
「OOF」: 先物オプション(option on future)
「OOP」: 現物オプション(option on physical)

SPANリスク・パラメーター・ファイル仕様書

タイプ82レコード 【リスクアレイ第2レコード】

| No. | 項目名 | Name of Item | 位置 From | 桁数 Length | 属性 Format | 内容 Description | 設定例(△は空白) Example(△ indicates blank) |
|-----|-----|--------------|------------|--------------|--------------|-------------------|---|
|-----|-----|--------------|------------|--------------|--------------|-------------------|---|

「OOC」:コンビネーションオプション(option on combination)

8. 空白の場合は、「+」であることを表します。

タイプBレコード 【アレイ計算パラメーターとデルタ・スケーリング係数】

| No. | 項目名 | Name of Item | 位置 From | 桁数 Length | 属性 Format | 内容 Description | 設定例(△は空白) Example(△ indicates blank) |
|-----|-----------------|-----------------------------------|------------|--------------|--------------|-----------------------------|---|
| 01 | レコードID | Record ID | 1 | 2 | X(02) | 「B」：タイプBレコード(固定) | B△ |
| 02 | 取引所略称 | Exchange Acronym | 3 | 3 | X(03) | 「OSE」：大阪取引所 | OSE |
| 03 | 商品コード | Commodity Code | 6 | 10 | X(10) | 「RPF及びAPFにおいて使用する商品コード」を参照。 | NK225EFL△△ |
| 04 | プロダクトタイプコード | Product Type Code | 16 | 3 | X(03) | 備考9. 参照 | OOP |
| 05 | 先物限月 | Futures Contract Month | 19 | 6 | 9(06) | タイプ3レコードの備考3参照 | 201703 |
| 06 | 先物限日/限週コード | Futures Contract Day or Week Code | 25 | 2 | X(02) | 備考5. 参照 | △△ |
| 07 | 予備 | Filler | 27 | 1 | X(01) | 空白 | △ |
| 08 | オプション限月 | Option Contract Month | 28 | 6 | 9(06) | タイプ3レコードの備考3参照 | 201703 |
| 09 | オプション限日/限週コード | Option Contract Day or Week Code | 34 | 2 | X(02) | 備考6. 参照 | 31 |
| 10 | 予備 | Filler | 36 | 1 | X(01) | 空白 | △ |
| 11 | ベースボラティリティ | Base Volatility | 37 | 8 | 9(2)V9(6) | 整数2桁＋小数点以下6桁で指定 | △0000000 |
| 12 | ボラティリティ・スキャンレンジ | Volatility Scan Range | 45 | 8 | 9(2)V9(6) | 整数2桁＋小数点以下6桁で指定 | △00901△△ |
| 13 | プライス・スキャンレンジ | Futures Price Scan Range | 53 | 5 | 9(05) | | △8100 |
| 14 | 極端な変動率 | Extreme Move Multiplier | 58 | 5 | 9(2)V9(3) | 整数2桁＋小数点以下3桁で指定 | △3000 |
| 15 | 極端に変動した時のカバー率 | Extreme Move Covered Fraction | 63 | 5 | 9(1)V9(4) | 整数1桁＋小数点以下4桁で指定 | 03000 |
| 16 | 金利 | Interest Rate | 68 | 5 | 9(1)V9(4) | 整数1桁＋小数点以下4桁で指定 | 00000 |
| 17 | 残存期間 | Time to Expiration (in years) | 73 | 7 | 9(1)V9(6) | 整数1桁＋小数点以下6桁で指定 | 0063014 |
| 18 | ルックアヘッドタイム | Lookahead Time (in year) | 80 | 6 | V9(06) | 小数点以下6桁で指定 | 002738 |
| 19 | デルタ・スケーリング係数 | Delta Scaling Factor | 86 | 6 | 9(2)V9(4) | 整数2桁＋小数点以下4桁で指定 | △10000 |
| 20 | 満期(決済)日 | Expiration (Settlement) Date | 92 | 8 | 9(08) | 西暦4桁＋月2桁＋日2桁の形式で指定 | 20170331 |
| 21 | 原資産商品コード | Underlying Commodity Code | 100 | 10 | X(10) | 「RPF及びAPFにおいて使用する商品コード」を参照。 | NK225△△△△△ |
| 22 | プライシングモデル | Pricing Model | 110 | 2 | X(02) | | M△ |
| 23 | クーポン・配当利回り | Coupon or Dividend Yield | 112 | 8 | 9(2)V9(6) | 整数2桁＋小数点以下6桁で指定 | 00000000 |
| 24 | 予備 | Filler | 120 | 13 | X(13) | 空白 | |

タイプBレコード 【アレイ計算パラメーターとデルタ・スケーリング係数】

【備考】

1. Bレコードは、先物取引またはオプション取引（プット/コール及び権利行使価格を除いて同じであるすべてのオプション）のデルタ・スケーリング係数と、リスクアレイ計算に使用したパラメーターを提供します。
2. デルタ・スケーリング係数を除いて、Bレコードに含まれるパラメーターは、SPANの証拠金計算には不要です。Bレコードを指定しない場合、その先物またはそのオプション取引のデルタ・スケーリング係数は、1.00となります。
3. タイプBレコードは、その商品グループのタイプ4レコードより後にセットされます。
4. プロダクトタイプコード(項目No.04)が「FUT」の場合、オプション限月(項目No.08)とオプション限日/限週コード(項目No.09)には、空白が設定されます。
5. 限日/限週コード(項目No.06)には、空白が設定されます。
6. 限日/限週コード(No.09)には、当該銘柄がフレックス・オプションである場合には満期日が設定され、その他の場合には、空白が設定されます。
7. プライス・スキャンレンジ(項目No.13)は、商品グループの証拠金通貨で指定し、「リスクアレイ値 $\times 10^Z$ 」を行う必要があります。(Zはこの同属商品のリスク乗数) リスク乗数は、タイプ2レコードに存在します。
8. 先物の満期(決済)日(項目No.20)は、最終清算値段が決定される日です。オプション取引の満期(決済)日は、その限月の権利行使日となります。
9. プロダクトタイプコード(項目No.04)には、以下の内容が設定されます。
 - 「FUT」: 先物(future)
 - 「PHY」: 現物(physical)
 - 「CMB」: コンビネーション(combination)
 - 「OOF」: 先物オプション(option on future)
 - 「OOP」: 現物オプション(option on physical)
 - 「OOC」: コンビネーションオプション(option on combination)

タイプCレコード 【ティア間の商品内スプレッド割増額】

| No. | 項目名 | Name of Item | 位置 From | 桁数 Length | 属性 Format | 内容 Description | 設定例(△は空白) Example(△ indicates blank) |
|-----|-------------------------|---|------------|--------------|--------------|-----------------------------|---|
| 01 | レコードID | Record ID | 1 | 2 | X(02) | 「C」：タイプCレコード(固定) | C△ |
| 02 | 商品グループコード | Combined Commodity Code | 3 | 6 | X(06) | 「RPF及びAPFにおいて使用する商品コード」を参照。 | NK225△ |
| 03 | 商品内スプレッド割増額の計算手順コード | Intra-commodity Spread Method Charge Code | 9 | 2 | X(02) | 「10」：テーブル制御方式(固定) | 10 |
| 04 | スプレッド優先順位 | Spreads priority (Spread Number) | 11 | 2 | 9(02) | | 01 |
| 05 | レグ数 | Number of Legs | 13 | 2 | 9(02) | | 02 |
| 06 | 1ネット・デルタ当たりの商品内スプレッド割増額 | Charge Rate | 15 | 7 | 9(07) | | 0000600 |
| 07 | レグ1のレグ番号 | Leg1 - Leg number | 22 | 2 | 9(02) | | 01 |
| 08 | レグ1のティア番号 | Leg1 - Tier number | 24 | 2 | 9(02) | | 01 |
| 09 | レグ1の商品内デルタ/スプレッド比率 | Leg1 - Delta Per Spread Ratio | 26 | 2 | 9(02) | | 01 |
| 10 | レグ1のマーケットサイド・インディケーター | Leg1 - Market Side | 28 | 1 | X(01) | 「A」または「B」を指定 | A |
| 11 | レグ2のレグ番号 | Leg2 - Leg number | 29 | 2 | 9(02) | | 02 |
| 12 | レグ2のティア番号 | Leg2 - Tier number | 31 | 2 | 9(02) | | 01 |
| 13 | レグ2の商品内デルタ/スプレッド比率 | Leg2 - Delta Per Spread Ratio | 33 | 2 | 9(02) | | 01 |
| 14 | レグ2のマーケットサイド・インディケーター | Leg2 - Market Side | 35 | 1 | X(01) | 「A」または「B」を指定 | B |
| 15 | レグ3のレグ番号 | Leg3 - Leg number | 36 | 2 | 9(02) | | |
| 16 | レグ3のティア番号 | Leg3 - Tier number | 38 | 2 | 9(02) | | |
| 17 | レグ3の商品内デルタ/スプレッド比率 | Leg3 - Delta Per Spread Ratio | 40 | 2 | 9(02) | | |
| 18 | レグ3のマーケットサイド・インディケーター | Leg3 - Market Side | 42 | 1 | X(01) | 「A」または「B」を指定 | |
| 19 | レグ4のレグ番号 | Leg4 - Leg number | 43 | 2 | 9(02) | | |
| 20 | レグ4のティア番号 | Leg4 - Tier number | 45 | 2 | 9(02) | | |
| 21 | レグ4の商品内デルタ/スプレッド比率 | Leg4 - Delta Per Spread Ratio | 47 | 2 | 9(02) | | |
| 22 | レグ4のマーケットサイド・インディケーター | Leg4 - Market Side | 49 | 1 | X(01) | 「A」または「B」を指定 | |
| 23 | レグ5のレグ番号 | Leg5 - Leg number | 50 | 2 | 9(02) | | |
| 24 | レグ5のティア番号 | Leg5 - Tier number | 52 | 2 | 9(02) | | |
| 25 | レグ5の商品内デルタ/スプレッド比率 | Leg5 - Delta Per Spread Ratio | 54 | 2 | 9(02) | | |
| 26 | レグ5のマーケットサイド・インディケーター | Leg5 - Market Side | 56 | 1 | X(01) | 「A」または「B」を指定 | |
| 27 | レグ6のレグ番号 | Leg6 - Leg number | 57 | 2 | 9(02) | | |
| 28 | レグ6のティア番号 | Leg6 - Tier number | 59 | 2 | 9(02) | | |
| 29 | レグ6の商品内デルタ/スプレッド比率 | Leg6 - Delta Per Spread Ratio | 61 | 2 | 9(02) | | |
| 30 | レグ6のマーケットサイド・インディケーター | Leg6 - Market Side | 63 | 1 | X(01) | 「A」または「B」を指定 | |
| 31 | レグ7のレグ番号 | Leg7 - Leg number | 64 | 2 | 9(02) | | |

タイプCレコード 【ティア間の商品内スプレッド割増額】

| No. | 項目名 | Name of Item | 位置 From | 桁数 Length | 属性 Format | 内容 Description | 設定例(△は空白) Example(△ indicates blank) |
|-----|-----------------------|-------------------------------|------------|--------------|--------------|-------------------|---|
| 32 | レグ7のティア番号 | Leg7 - Tier number | 66 | 2 | 9(02) | | |
| 33 | レグ7の商品内デルタ/スプレッド比率 | Leg7 - Delta Per Spread Ratio | 68 | 2 | 9(02) | | |
| 34 | レグ7のマーケットサイド・インディケーター | Leg7 - Market Side | 70 | 1 | X(01) | 「A」または「B」を指定 | |
| 35 | レグ8のレグ番号 | Leg8 - Leg number | 71 | 2 | 9(02) | | |
| 36 | レグ8のティア番号 | Leg8 - Tier number | 73 | 2 | 9(02) | | |
| 37 | レグ8の商品内デルタ/スプレッド比率 | Leg8 - Delta Per Spread Ratio | 75 | 2 | 9(02) | | |
| 38 | レグ8のマーケットサイド・インディケーター | Leg8 - Market Side | 77 | 1 | X(01) | 「A」または「B」を指定 | |
| 39 | 予備 | Filler | 78 | 55 | X(55) | 空白 | |

【備考】

- タイプCレコードは、商品グループのタイプ3レコード(商品内スプレッド割増額パラメーター)のサブレコードであり、通常はそのレコードの直後に設定します。各Cレコードは、該当商品グループの特定のティアの間の商品内スプレッドについてのデータを提供します。
- 1つのタイプCレコードは最大8個のレグをサポートします。レグを9個以上定義すると、最初のCレコードの直後に同じスプレッド優先順位を持つ別のCレコードが作成されます。

タイプEレコード 【商品内スプレッド割増額】

| No. | 項目名 | Name of Item | 位置 From | 桁数 Length | 属性 Format | 内容 Description | 設定例(△は空白) Example(△ indicates blank) |
|-----|-----------------------------|--|------------|--------------|--------------|-----------------------------|---|
| 01 | レコードID | Record ID | 1 | 2 | X(02) | 「E」：タイプEレコード(固定) | |
| 02 | 商品グループコード | Combined Commodity Code | 3 | 6 | X(06) | 「RPF及びAPFにおいて使用する商品コード」を参照。 | |
| 03 | スプレッド優先順位 | Spread Priority | 9 | 5 | 9(05) | | |
| 04 | 1ネット・デルタ当たりの 商品内スプレッド割増額 | Charge Rate | 14 | 7 | 9(07) | | |
| 05 | レグ1の限月 | Leg 1 Contract Month | 21 | 4 | 9(04) | タイプ3レコードの備考3参照 | |
| 06 | レグ1の残存期間 | Leg 1 Remaining Part of Contract Period | 25 | 3 | X(03) | | |
| 07 | レグ1の商品内デルタ/スプレッド比率 | Leg 1 Delta Per Spread Ratio | 28 | 6 | 9(2)V9(4) | 整数2桁＋小数点以下4桁で指定 | |
| 08 | レグ1のマーケットサイド・インディケータ | Leg 1 Market Side | 34 | 1 | X(01) | 「A」または「B」を指定 | |
| 09 | レグ2の限月 | Leg 2 Contract Month | 35 | 4 | 9(04) | タイプ3レコードの備考3参照 | |
| 10 | レグ2の残存期間 | Leg 2 Remaining Part of Contract Period | 39 | 3 | X(03) | | |
| 11 | レグ2の商品内デルタ/スプレッド比率 | Leg 2 Delta Per Spread Ratio | 42 | 6 | 9(2)V9(4) | 整数2桁＋小数点以下4桁で指定 | |
| 12 | レグ2のマーケットサイド・インディケータ | Leg 2 Market Side | 48 | 1 | X(01) | 「A」または「B」を指定 | |
| 13 | レグ3の限月 | Leg 3 Contract Month | 49 | 4 | 9(04) | タイプ3レコードの備考3参照 | |
| 14 | レグ3の残存期間 | Leg 3 Remaining Part of Contract Period | 53 | 3 | X(03) | | |
| 15 | レグ3の商品内デルタ/スプレッド比率 | Leg 3 Delta Per Spread Ratio | 56 | 6 | 9(2)V9(4) | 整数2桁＋小数点以下4桁で指定 | |
| 16 | レグ3のマーケットサイド・インディケータ | Leg 3 Market Side | 62 | 1 | X(01) | 「A」または「B」を指定 | |
| 17 | レグ4の限月 | Leg 4 Contract Month | 63 | 4 | 9(04) | タイプ3レコードの備考3参照 | |
| 18 | レグ4の残存期間 | Leg 4 Remaining Part of Contract Period | 67 | 3 | X(03) | | |
| 19 | レグ4の商品内デルタ/スプレッド比率 | Leg 4 Delta Per Spread Ratio | 70 | 6 | 9(2)V9(4) | 整数2桁＋小数点以下4桁で指定 | |
| 20 | レグ4のマーケットサイド・インディケータ | Leg 4 Market Side | 76 | 1 | X(01) | 「A」または「B」を指定 | |
| 21 | 予備 | Filler | 77 | 4 | X(04) | 空白 | |

【備考】

- 1つのタイプEレコードで最大4個のレグを設定することができます。もし、レグを5個以上設定する場合は、最初のタイプEレコードの直後に同じスプレッド優先順位を持つレコードが追加されます。

SPANリスク・パラメーター・ファイル仕様書

タイプPレコード 【価格変換パラメーター】

| No. | 項目名 | Name of Item | 位置 From | 桁数 Length | 属性 Format | 内容 Description | 設定例(△は空白) Example(△ indicates blank) |
|-----|------------------|--|------------|--------------|--------------|-----------------------------|---|
| 01 | レコードID | Record ID | 1 | 2 | X(02) | 「P」：タイプPレコード(固定) | P△ |
| 02 | 取引所略称 | Exchange Acronym | 3 | 3 | X(03) | 「OSE」：大阪取引所 | OSE |
| 03 | プロダクト(商品)コード | Product (Commodity) Code | 6 | 10 | X(10) | 「RPF及びAPFにおいて使用する商品コード」を参照。 | NK225W3△△△ |
| 04 | プロダクトタイプコード | Product Type Code | 16 | 3 | X(03) | 備考1. 参照 | OOP |
| 05 | プロダクト名 | Product Name | 19 | 15 | X(15) | | NK225W3△△△△△△△△ |
| 06 | 清算値段の小数点位置 | Settlement Price Decimal Locator | 34 | 3 | 9(03) | | 000 |
| 07 | 権利行使価格の小数点位置 | Strike Price Decimal Locator | 37 | 3 | 9(03) | | 000 |
| 08 | 清算値段の整列コード | Settlement Price Alignment Code | 40 | 1 | X(01) | | △ |
| 09 | 権利行使価格の整列コード | Strike Price Alignment Code | 41 | 1 | X(01) | | △ |
| 10 | 取引金額換算乗数 | Contract Value Factor (multiplier) | 42 | 14 | 9(7)V9(7) | 整数7桁＋小数点以下7桁で指定 | 00010000000000 |
| 11 | 標準キャビネットオプション価値 | Standard Cabinet Option Value | 56 | 8 | 9(6)V9(2) | 整数6桁＋小数点以下2桁で指定 | 00000000 |
| 12 | 銘柄毎のポジション | Quoted Position Quantity per Contract | 64 | 2 | 9(02) | | 01 |
| 13 | 清算(気配値)通貨ISOコード | Settlement (Price Quotation) Currency ISO Code | 66 | 3 | X(03) | | JPY |
| 14 | 清算(気配値)通貨1バイトコード | Settlement (Price Quotation) Currency One-byte Code | 69 | 1 | X(01) | | Y |
| 15 | 気配方式 | Price Quotation Method | 70 | 3 | X(03) | | STD |
| 16 | 予備 | Filler | 73 | 60 | X(60) | 空白 | |

【備考】

1. プロダクトタイプコード(項目No.04)には、以下の内容が設定されます。

「FUT」：先物(future)

「PHY」：現物(physical)

「CMB」：コンビネーション(combination)

「OOF」：先物オプション(option on future)

「OOP」：現物オプション(option on physical)

「OOC」：コンビネーションオプション(option on combination)

タイプSレコード 【ティアの設定】

| No. | 項目名 | Name of Item | 位置 From | 桁数 Length | 属性 Format | 内容 Description | 設定例(△は空白) Example(△ indicates blank) |
|-----|----------------------------------|---|------------|--------------|--------------|--|---|
| 01 | レコードID | Record ID | 1 | 2 | X(02) | 「S」：タイプSレコード(固定) | |
| 02 | 商品グループコード | Combined Commodity Code | 3 | 6 | X(06) | 「RPF及びAPFにおいて使用する商品コード」を参照。 | |
| 03 | スキャンリスク額、商品間スプレッド 割増額の計算手順コード | Scanning/Inter-commodity Spreading Method Code | 9 | 2 | X(02) | 「01」：ティアを使用しない 「10」：スキャンリスク額の計算にティアを使用するが、 商品間スプレッドの計算にティアを使用しない 「20」：スキャンリスク額の計算にティアを使用しないが、 商品間スプレッドの計算にティアを使用する | |
| 04 | ティア数 | Number of Tiers | 11 | 2 | 9(02) | | |
| 05 | ティア1のティア番号 | Tier1 - Tier number | 13 | 2 | 9(02) | | |
| 06 | ティア1の開始限月 | Tier1 - Starting Contract Month | 15 | 6 | 9(06) | タイプ3レコードの備考3参照 | |
| 07 | ティア1の終了限月 | Tier1 - Ending Contract Month | 21 | 6 | 9(06) | タイプ3レコードの備考3参照 | |
| 08 | ティア2のティア番号 | Tier2 - Tier number | 27 | 2 | 9(02) | | |
| 09 | ティア2の開始限月 | Tier2 - Starting Contract Month | 29 | 6 | 9(06) | タイプ3レコードの備考3参照 | |
| 10 | ティア2の終了限月 | Tier2 - Ending Contract Month | 35 | 6 | 9(06) | タイプ3レコードの備考3参照 | |
| 11 | ティア3のティア番号 | Tier3 - Tier number | 41 | 2 | 9(02) | | |
| 12 | ティア3の開始限月 | Tier3 - Starting Contract Month | 43 | 6 | 9(06) | タイプ3レコードの備考3参照 | |
| 13 | ティア3の終了限月 | Tier3 - Ending Contract Month | 49 | 6 | 9(06) | タイプ3レコードの備考3参照 | |
| 14 | ティア4のティア番号 | Tier4 - Tier number | 55 | 2 | 9(02) | | |
| 15 | ティア4の開始限月 | Tier4 - Starting Contract Month | 57 | 6 | 9(06) | タイプ3レコードの備考3参照 | |
| 16 | ティア4の終了限月 | Tier4 - Ending Contract Month | 63 | 6 | 9(06) | タイプ3レコードの備考3参照 | |
| 17 | ティア5のティア番号 | Tier5 - Tier number | 69 | 2 | 9(02) | | |
| 18 | ティア5の開始限月 | Tier5 - Starting Contract Month | 71 | 6 | 9(06) | タイプ3レコードの備考3参照 | |
| 19 | ティア5の終了限月 | Tier5 - Ending Contract Month | 77 | 6 | 9(06) | タイプ3レコードの備考3参照 | |
| 20 | 先物加重プライス・リスク計算方法 | Weighted Futures Price Risk Calculation Method | 83 | 1 | X(01) | | |
| 21 | 予備 | Filler | 84 | 39 | X(39) | 空白 | |

【備考】

1. タイプSレコードが存在しない場合、スキャンリスク額の計算は商品グループ単位で行ないます。
2. 計算手順コードが「01」の場合、ティアの領域(項目No.04～19)は無効となります。
3. 1つのタイプSレコードで最大5個のティアを設定することができます。もし、6個以上の設定をする場合は、最初のタイプSレコードの直後に追加されます。

SPANリスク・パラメーター・ファイル仕様書

タイプTレコード 【通貨換算レート】

| No. | 項目名 | Name of Item | 位置 From | 桁数 Length | 属性 Format | 内容 Description | 設定例(△は空白) Example(△ indicates blank) |
|-----|--------------|--|------------|--------------|--------------|-------------------|---|
| 01 | レコードID | Record ID | 1 | 2 | X(02) | 「T」: タイプTレコード(固定) | T△ |
| 02 | 換算元通貨ISOコード | Convert From Currency ISO Code | 3 | 3 | X(03) | | USD |
| 03 | 換算元通貨1バイトコード | Convert From Currency One-Byte Code | 6 | 1 | X(01) | | \$ |
| 04 | 換算先通貨ISOコード | Convert To Currency ISO Code | 7 | 3 | X(03) | | JPY |
| 05 | 換算先通貨1バイトコード | Convert To Currency One-Byte Code | 10 | 1 | X(01) | | Y |
| 06 | 換算レート | Conversion Multiplier | 11 | 10 | 9(4)V9(6) | 整数4桁＋小数点以下6桁で指定 | △△△00△△△△△ |
| 07 | 予備 | Filler | | | | 空白 | |

【備考】

1. タイプTレコードが存在する場合、SPANリスク・パラメーター・ファイル内でタイプOレコードの直後にセットします。