

SPANポートフォリオ・ファイル仕様書

株式会社日本証券クリアリング機構

2020年7月版
(2019年10月公表)

※各レコードの内容、設定例及び備考欄の記載は、OSE・TOCOM商品を想定した収録例となっております。大阪堂島商品取引所分については、作成者側でご確認ください。

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 ポートフォリオ・ファイル仕様書


#(変更歴) 版	日付	項目	項番	概要
2015年5月		Weeklyオプションの導入に伴う変更	1	・タイプ3レコード No.10(先物限月)、No.12(オプション限月)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定を記載
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	・タイプ3レコード No.7(商品コード)、No.10(先物限月)、No.12(オプション限月)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を変更
		フレックス・オプションの導入に伴う変更	2	・タイプ3レコード No.7(商品コード)、No.10(先物限月)、No.12(オプション限月)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。
	2017/11/22 改訂版	その他	1	・表紙 フレックス・オプション取引に関する記載を追加。
2018年6月	2018/3/31	フレックス限月取引の導入に伴う変更	1	・タイプ3レコード 備考欄にフレックス限月取引に係る限月設定を記載。
2019年7月	2019/10/2	商品デリバティブ取引の導入に伴う変更	1	・タイプ3レコード 設定上、TOCOM商品についても取引所略称として「OSE」を用いることを内容欄に記載

タイプ1レコード 【営業日付】

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	1	X(01)	「1」：タイプ1レコード(固定)	1
02	予備	Filler	2	2	X(02)	空白	△△
03	営業日付	Business Date	4	8	9(08)	西暦4桁＋月2桁＋日2桁の形式で指定	20000401
04	ファイルID	File Identifier	12	1	X(01)	「S」：通常日(固定) 「E」：緊急証拠金用	S
05	営業時刻	Business Time	13	4	9(04)	時2桁＋分2桁の形式で指定	1700
06	ファイル日付	File Creation Date	17	8	9(08)	西暦4桁＋月2桁＋日2桁の形式で指定	20000401
07	ファイル時刻	File Creation Time	25	4	9(04)	時2桁＋分2桁の形式で指定	1822
08	ファイルフォーマット	File Format	29	1	X(01)	「E」(固定)	E

タイプ2レコード 【ポートフォリオ】

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	1	X(01)	「2」：タイプ2レコード(固定)	2
02	清算機関コード	Clearing Member Firm	2	3	X(03)	任意の3文字(※No03のアカウントNoとの組み合わせで証拠金の算出対象主体を特定)	
03	アカウントNo	Account Number	5	20	X(20)	任意の20文字(※No02の清算機関コードとの組み合わせで証拠金の算出対象主体を特定)	
04	アカウントタイプ	Account Type	25	1	X(01)	「F」：会員 「M」：メンバー 「H」：ヘッジャー 「S」：スペキュレータ(顧客アカウント) 「0」：オムニバスアカウント(会員自身のアカウント)	S
05	委託タイプ	Segregation Type	26	5	X(05)	SPAN4で使用する。	△△△△△
06	親アカウントNo		31	20	X(20)	アカウントタイプ(項目No.04)が「S」の場合、「0」(会員自身のアカウントを設定する。「0」の場合は、空白。	
07	新規ポートフォリオフラグ	new Portfolio flag	51	1	X(01)	「Y」：新規ポートフォリオ 「N」：既存ポートフォリオ(固定)	N
08	レジャージャーバランス	Ledger Balance	52	12	9(10)V9(2)	整数10桁＋小数点以下2桁で指定。アカウントタイプ(項目No.04)が「F」の場合「0」が設定される。負の値の場合、1バイト目に「-」を設定します。	△△△△△△△△△△△△
09	計算上の損益額	Open Trade Equity	64	12	9(10)V9(2)	整数10桁＋小数点以下2桁で指定。アカウントタイプ(項目No.04)が「F」の場合「0」が設定される。負の値の場合、1バイト目に「-」を設定します。	△△△△△△△△△△△△
10	代用有価証券評価額	Securities on Deposit	76	12	9(10)V9(2)	整数10桁＋小数点以下2桁で指定。アカウントタイプ(項目No.04)が「F」の場合「0」が設定される。	△△△△△△△△△△△△
11	ユーザー割増適用フラグ	Apply User Scaleups Flag	88	1	X(01)	「Y」：ユーザー割増設定が「designated」アカウントへ適用するように設定されている場合、このアカウントにユーザー割増を適用する。 「N」：ユーザー割増しない。	△

の項目は使用しませんので、設定する必要はありません。

【備考】

1. 受入証拠金につきましては、SPANでは計算されません。
2. 証拠金の算出対象主体ごとにNo02の清算機関コードとNo03のアカウントNoの組み合わせを設定する必要があります。

タイプ3レコード 【ポジション】

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	1	X(01)	「3」：タイプ3レコード(固定)	3
02	清算機関コード	Clearing Member Firm	2	3	X(03)	任意の3文字（※No03のアカウントNoとの組み合わせで証拠金の算出対象主体を特定）	
03	アカウントNo	Acount Number	5	20	X(20)	任意の20文字（※No02の清算機関コードとの組み合わせで証拠金の算出対象主体を特定）	
04	取引所略称	Exchange Acronym	25	3	X(03)	「OSE」：大阪取引所、東京商品取引所(固定)	OSE
05	予備	Filler	28	2	X(02)	空白	△△
06	商品グループコード	Combined Commodity Code	30	6	X(06)	「RPF及びAPFにおいて使用する商品コード」を参照。	NK225△
07	商品コード	Commodity(Product) Code	36	10	X(10)	備考欄を参照 「RPF及びAPFにおいて使用する商品コード」を参照。	NK225F△△△△
08	商品タイプ	Contract Type	46	3	X(03)	「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)	FUT
09	プット／コール	Put/Call Code	49	1	X(01)	「P」：プット 「C」：コール 空白：先物の場合	△
10	先物限月	Futures Contract Period	50	8	9(08)	備考欄を参照 西暦4桁＋月2桁＋日2桁の形式で指定 なお、日2桁については空白を設定。	201703△△
11	予備	Filler	58	1	X(01)	空白	△

タイプ3レコード 【ポジション】

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)
12	オプション限月	Option Contract Period	59	8	9(8)	備考欄を参照 ・先物の場合、空白 ・オプションの場合、通常は満期日の西暦4桁+月2桁+空白2桁の形式で設定する。ただし、フレックス・オプションに限り、満期日の西暦4桁+月2桁+日2桁の形式で設定する。	201703△△
13	予備	Filler	67	1	X(01)	空白	△
14	権利行使価格	Strike Price	68	7	9(07)	先物の場合空白	△△△△△△△
15	ネット・ポジション符号	Sign for Net Positions	75	1	X(01)	正の場合空白 負の場合「-」を指定	△
16	ネット・ポジション	Net Positions	76	7	9(07)	ネットポジションに基づいて証拠金計算する場合に使用。 ロング・ポジション総数－ショート・ポジション総数	
17	ロング・ポジション総数	Total Long Positions	83	8	9(08)	買建玉。グロスポジションに基づいて証拠金計算する場合に使用する。	△△△△△△△△
18	ショート・ポジション総数	Total Short Positions	91	8	9(08)	売建玉。グロスポジションに基づいて証拠金計算する場合に使用する。	△△△△△△△△
19	商品内スプレッド買建玉	Intra-commodity Spreadable Long Positions	99	8	9(08)	商品内スプレッドを組むことができる買建玉	△△△△△△△△
20	商品内スプレッド売建玉	Intra-commodity Spreadable Short	107	8	9(08)	商品内スプレッドを組むことができる売建玉	△△△△△△△△
21	商品間スプレッド買建玉	Inter-commodity Spreadable Long Positions	115	8	9(08)	商品内スプレッドと商品間スプレッドを組むことができる買建玉	△△△△△△△△
22	商品間スプレッド売建玉	Inter-commodity Spreadable Short Positions	123	8	9(08)	商品内スプレッドと商品間スプレッドを組むことができる売建玉	△△△△△△△△

の項目は使用しませんので、設定する必要はありません。

【備考】

■ 国債証券先物オプションの場合

先物限月コードの設定は以下のとおりとする。

対象先物限月の西暦(4桁)+限月(2桁)を設定する。

【例】オプション取引:2017年2月限、対象先物限月:2017年3月限

2017年3月限 → 201703

オプション限月コードの設定は以下のとおりとする。

タイプ3レコード 【ポジション】

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)
-----	-----	--------------	------------	--------------	--------------	-------------------	---

限月の西暦(4桁)＋限月(2桁)を設定する。

【例】オプション取引:2017年2月限

2017年2月限 → 201702

■ Weeklyオプションの場合

商品コードの設定は当該オプション取引のSQ日の属する週に応じて、それぞれ「NK225W1」、「NK225W3」、「NK225W4」、「NK225W5」を設定する。

【例】

2017年3月17日に満期を迎える銘柄の場合、当該銘柄のSQ日は第3金曜であるため、「NK225W3」を設定

限月コードの設定は対象先物限月の西暦(4桁)＋限月※(2桁)を設定する。

【例】

2017年3月17日を満期日とする取引 → 201703

祝日を考慮しない日付で商品コード及び限月コードが設定される点に御留意ください。

【例】

2016年1月の場合、1月1日が1月第1週金曜日であるため、祝日が設定されていなければ、1月第1週のWeeklyオプションが設定されることとなりますが、祝日を考慮した結果、実際のSQ日は12月30日(水)となるようなケースにおいては商品コードは「NK225W1」、先物限月コードは「201601」が設定されます(商品コードは「NK225W5」、限月コードは「201512」とはなりません。)

■ その他の先物・オプションの場合(フレックス限月を除く)

限月コードの設定は対象先物限月の西暦(4桁)＋限月※(2桁)を設定する。

【例】

2017年3月10日を満期日とする取引 → 201703

■ フレックス限月取引の場合

先物限月コードの設定はフレックス限月の西暦(4桁)＋限月※(2桁)を設定し、オプション限月コードの設定はフレックス限月の満期日(8桁)を設定する。

【例】

2017年3月10日を満期日とする取引 → 先物限月コード:201703、オプション限月コード:20170310