

アドオンチャージ・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

2020年7月版
(2019年12月公表)

※本資料の全部又は一部を株式会社日本証券クリアリング機構に無断で複製又は転載することはできません。

アドオンチャージ・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
2018年2月	2017/3/31 公表版	-	-	初版
	2017/11/22 改訂版	その他	1	<ul style="list-style-type: none"> ・表紙にフレックス・オプション取引に関する記載を追加。 ・タイプ2レコードのレコード名に係る内容欄の記載・設定例を修正 ・タイプ3レコードの建玉調整係数レコード名に係る内容欄の記載を修正
2020年7月	2019/12/27	商品デリバティブ取引の導入に伴う変更	1	<ul style="list-style-type: none"> ・表紙 ・タイプ1 No.5(商品グループ群コード)における内容について、OSE・TOCOMの商品デリバティブに係る設定値情報を追加。 ・タイプ2 No.5(基準額コード)における内容について、OSE・TOCOMの商品デリバティブに係る設定値情報を追加。

タイプ0レコード 【日付ヘッダー】

No.	項目名	Name of Item	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	2	C	「0」：タイプ0レコード(固定)	0△
02	セパレータ	Separator	1	C	項目のセパレータとして、',' (0x2C) を設定する。	,
03	レコード名	Record Name	4	C	「DATE」	DATE
04	セパレータ	Separator	1	C	項目のセパレータとして、',' (0x2C) を設定する。	,
05	営業日付	Business Date	8	C	西暦4桁＋月2桁＋日2桁の形式で指定	20170215
06	改行コード	Separator	2	C	レコード項目のセパレータとして改行コード (0x0D0A) を設定する。	

タイプ1レコード 【プライス・スキャン・レンジレコード】

No.	項目名	Name of Item	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	2	C	「1」：タイプ1レコード(固定)	1△
02	セパレータ	Separator	1	C	項目のセパレータとして、',' (0x2C) を設定する。	,
03	レコード名	Record Name	3	C	「PSR」：プライス・スキャン・レンジ	PSR
04	セパレータ	Separator	1	C	項目のセパレータとして、',' (0x2C) を設定する。	,
05	商品グループ群コード	Commodity Group Code	3	C	「IDX」：指数系グループ群 「JGB」：国債系グループ群 「GLD」：金先物系グループ群 「PLT」：白金先物系グループ群 「ENG」：原油先物系グループ群	IDX
06	セパレータ	Separator	1	C	項目のセパレータとして、',' (0x2C) を設定する。	,
07	プライス・スキャンレンジ	Futures Price Scan Range	8	C	各商品グループ群における被換算対象銘柄のプライス・スキャン・レンジ	00810000
08	改行コード	Separator	2	C	レコード項目のセパレータとして改行コード (0x0D0A) を設定する。	

タイプ2レコード 【基準額レコード】

No.	項目名	Name of Item	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	2	C	「2」：タイプ2レコード(固定)	2△
02	セパレータ	Separator	1	C	項目のセパレータとして、',' (0x2C) を設定する。	,
03	レコード名	Record Name	8	C	「THRESHOL」：基準額	THRESHOL
04	セパレータ	Separator	1	C	項目のセパレータとして、',' (0x2C) を設定する。	,
05	基準額コード	Threshold Code	8	C	「IDXLIQ」：指数系グループ群に係る流動性基準判定基準数量 「IDXFCON」：指数系グループ群に係る先物取引における集中基準判定基準数量 「IXOCON」：指数系グループ群に係るOP取引における集中基準判定基準数量 「JGBLIQ」：国債系グループ群に係る流動性基準判定基準数量 「JGBFCON」：国債系グループ群に係る先物取引における集中基準判定基準数量 「JGBOCON」：国債系グループ群に係るOP取引における集中基準判定基準数量 「GLDLIQ」：金先物系グループ群に係る流動性基準判定基準数量 「GLDFCON」：金先物系グループ群に係る先物取引における集中基準判定基準数量 「GLDOCON」：金先物系グループ群に係るOP取引における集中基準判定基準数量 「PLTLIQ」：白金先物系グループ群に係る流動性基準判定基準数量 「PLTFCON」：白金先物グループ群に係る先物取引における集中基準判定基準数量 「PLTOCON」：白金先物グループ群に係るOP取引における集中基準判定基準数量 「ENGLIQ」：原油先物系グループ群に係る流動性基準判定基準数量 「ENGFCON」：原油先物系グループ群に係る先物取引における集中基準判定基準数量 「ENGOCON」：原油先物系グループ群に係るOP取引における集中基準判定基準数量	IDXLIQ△△
06	セパレータ	Separator	1	C	項目のセパレータとして、',' (0x2C) を設定する。	,
07	基準額	Threshold	8	C		00130026
08	改行コード	Separator	2	C	レコード項目のセパレータとして改行コード (0x0D0A) を設定する。	

タイプ3レコード 【建玉調整係数レコード】

No.	項目名	Name of Item	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	2	C	「3」：タイプ3レコード(固定)	3△
02	セパレータ	Separator	1	C	項目のセパレータとして、',' (0x2C) を設定する。	,
03	レコード名	Record Name	16	C	「ADJUSTMULTIPLIER」：建玉調整係数	ADJUSTMULTIPLIER
04	セパレータ	Separator	1	C	項目のセパレータとして、',' (0x2C) を設定する。	,
05	商品グループコード	Combined Commodity Code	6	C	「RPF及びAPFにおいて使用する商品コード」を参照。	NK225△
06	セパレータ	Separator	1	C	項目のセパレータとして、',' (0x2C) を設定する。	,
07	商品コード	Commodity(Product) Code	10	C	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	セパレータ	Separator	1	C	項目のセパレータとして、',' (0x2C) を設定する。	,
09	商品タイプ	Contract Type	3	C	「FUT」：先物(future) 「OOF」：先物オプション(option on future) 「OOP」：現物オプション(option on physical)	FUT
10	セパレータ	Separator	1	C	項目のセパレータとして、',' (0x2C) を設定する。	,
11	プット／コール	Put/Call Code	1	C	「P」：プット 「C」：コール 空白：先物の場合	△
12	セパレータ	Separator	1	C	項目のセパレータとして、',' (0x2C) を設定する。	,
13	先物限月	Futures Contract Period	8	C	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桁についてはフレックス・オプション以外の場合、空白を設定。	201703△△
14	セパレータ	Separator	1	C	項目のセパレータとして、',' (0x2C) を設定する。	,
15	オプション限月	Option Contract Period	8	C	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△△
16	セパレータ	Separator	1	C	項目のセパレータとして、',' (0x2C) を設定する。	,
17	権利行使価格	Strike Price	10	C	整数部7桁（7桁に満たない場合は左ゼロ埋め）＋小数点1桁＋小数部2桁を設定	0000150.50
18	セパレータ	Separator	1	C	項目のセパレータとして、',' (0x2C) を設定する。	,
19	銘柄コード	Instrument Code	9	C	各取引に係る銘柄コード（9桁）を設定	162030018
20	セパレータ	Separator	1	C	項目のセパレータとして、',' (0x2C) を設定する。	,
21	ベータ値	Beta Value	6	C	被換算対象銘柄の属する商品グループと銘柄の属する商品グループ間の当社の定めるベータ値を設定。 整数部2桁（2桁に満たない場合は左ゼロ埋め）＋小数点1桁＋小数部3桁を設定	00.913
22	セパレータ	Separator	1	C	項目のセパレータとして、',' (0x2C) を設定する。	,
23	デルタ値	Delta Value	7	C	銘柄に係る当社の定めるデルタ値を設定。 符号1桁＋整数部1桁＋小数点1桁＋小数部4桁を設定	-0.9123
24	セパレータ	Separator	1	C	項目のセパレータとして、',' (0x2C) を設定する。	,

タイプ3レコード 【建玉調整係数レコード】

No.	項目名	Name of Item	桁数 Length	属性 Format	内容 Description	設定例(△は空白) Example(△ indicates blank)
25	建玉調整係数	Adjustment Multiplier	13	C	銘柄の建玉を非換算銘柄の建玉に調整するための係数を設定する。 符号1桁＋整数部2桁（2桁に満たない場合は左ゼロ埋め）＋小数点1桁＋小数部9桁を設定	-00.999999999
26	改行コード	Separator	2	C	レコード項目のセパレータとして改行コード（0x0D0A）を設定する。	

【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。

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