

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

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、実ファイルの収録内容をご確認ください。

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 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 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レコードの設定例について、軽微な変更を実施。

#(変更歴) 版	日付	項目	項番	概要
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	・各レコードの設定例について、軽微な変更を実施。
2020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	<ul style="list-style-type: none"> ・表紙 ・タイプ0、1、2、6、81、82、B、プレコード 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、OSE・TOCOMの商品デリバティブに係る設定値情報を追加。

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、東京商品取引所	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」：スベキュレーター	
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)	「OSE」：大阪取引所、東京商品取引所	OSE
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、東京商品取引所	OS
05	予備	Filler	10	123	X(123)	空白	

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、東京商品取引所	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	202703
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)		△△△△△△

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)
項目No.03が「I1」の場合							
04	現渡商品コード	Spot commodity (Product) Code	11	10	X(10)	項目No.03が「I1」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「I1」の場合のみ使用	△△△△△△
06	予備	Filler	28	35	X(35)	項目No.03が「I1」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(スペキュレーター用)	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。

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ループ群 「JGB」：国債系グループ群 「PME」：OSE貴金属系グループ群 「RUB」：OSEゴム系グループ群 「AGR」：OSE農産物系グループ群 「ENG」：原油先物系グループ群	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、有価証券オプショングループ群 「JGB」：国債系グループ群 「PME」：OSE貴金属系グループ群 「RUB」：OSEゴム系グループ群 「AGR」：OSE農産物系グループ群 「ENG」：原油先物系グループ群	IDX
03	スプレッド優先順位	Spread Priority	6	4	9(04)		0004
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、東京商品取引所	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、東京商品取引所	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	

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)
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)		
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、東京商品取引所	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)		1925000
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】

1. 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。
2. 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。
3. 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)
4. 限日/限週コード(項目No.08)には、空白が設定されます。
5. 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。
6. 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、東京商品取引所	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)		1925000
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、東京商品取引所	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。

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、東京商品取引所	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)		002
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。