



大阪取引所及び東京商品取引所における 次期デリバティブ売買システム（J-GATE3.0） の稼働に伴うSPAN・IM追加チャージ対応概要

株式会社 日本証券クリアリング機構
2020年12月

更新履歴

| 更新日 | ページ | 概要 |
|------------|-----|------|
| 2020/12/24 | - | • 初版 |

SPAN対応概要

- J-GATE3.0の稼働に伴うSPANリスク・パラメーター・ファイル(RPF)の対応概要は下表のとおりです。
- 大阪取引所(OSE)及び東京商品取引所(TOCOM)における新商品の上市、既存商品の上市廃止に伴う変更となります。新商品に対応するコードの詳細等については、参考資料1「SPANリスク・パラメーター・ファイル仕様書」、参考資料2「SPANポートフォリオ・ファイル仕様書」、参考資料4「RPF及びAPFにおいて使用する商品コード」及び参考資料5「RPFサンプルデータ」をご参照いただき、取扱いの開始に向けた所要の対応をお願いいたします。
- なお、ファイル掲載時刻や掲載場所等については現行からの変更はございません。

| # | 対応 | 概要 | | | | | | | | | | | | |
|-----------------------|-----------------------------|--|-------|------------|--|----------------|----------------|-------------------|-----------------------|-----------------|------------------|--|------------------|-------------------|
| 1 | 指数先物取引におけるフレックス限月取引の導入に伴う対応 | <ul style="list-style-type: none"> ● OSEにおいて、以下の指数先物取引におけるフレックス限月取引が導入されることに伴い、RPFに当該取引に係るレコードが追加されます。 <ul style="list-style-type: none"> 1. 日経平均株価(Large取引) 2. 東証株価指数(Large取引) 3. JPX日経インデックス400 4. 東証銀行業株価指数 5. 東証REIT指数 6. 日経平均トータルリターン・インデックス ● 現行のフレックスオプション取引と同様、フレックス先物取引に係る81レコード及び82レコードはRPF（ファイナル）に収録されます。（アーリーとファイナルの銘柄の差異は、RNプライム先物及びフレックス先物・オプション銘柄に係る81レコード及び82レコードの収録有無となります。） | | | | | | | | | | | | |
| 2 | CME原油等指数先物取引の導入に伴う対応 | <ul style="list-style-type: none"> ● OSEにおいて、CME原油等指数先物取引が導入されることに伴い、RPFに当該取引に係るレコードが追加されます。 | | | | | | | | | | | | |
| 3 | 既存商品の上市廃止に伴う対応 | <ul style="list-style-type: none"> ● 以下の既存商品が各取引所において上市廃止となり、RPFから当該商品に係るレコードが削除されます。 <table border="0"> <tr> <td><OSE></td> <td><TOCOM>(※)</td> <td></td> </tr> <tr> <td>1. TOPIX配当指数先物</td> <td>1. バージガソリンスワップ</td> <td>4. プラッツローリー灯油スワップ</td> </tr> <tr> <td>2. TOPIX Core30配当指数先物</td> <td>2. ローリーガソリンスワップ</td> <td>5. プラッツバージ軽油スワップ</td> </tr> <tr> <td></td> <td>3. プラッツバージ灯油スワップ</td> <td>6. プラッツローリー軽油スワップ</td> </tr> </table> | <OSE> | <TOCOM>(※) | | 1. TOPIX配当指数先物 | 1. バージガソリンスワップ | 4. プラッツローリー灯油スワップ | 2. TOPIX Core30配当指数先物 | 2. ローリーガソリンスワップ | 5. プラッツバージ軽油スワップ | | 3. プラッツバージ灯油スワップ | 6. プラッツローリー軽油スワップ |
| <OSE> | <TOCOM>(※) | | | | | | | | | | | | | |
| 1. TOPIX配当指数先物 | 1. バージガソリンスワップ | 4. プラッツローリー灯油スワップ | | | | | | | | | | | | |
| 2. TOPIX Core30配当指数先物 | 2. ローリーガソリンスワップ | 5. プラッツバージ軽油スワップ | | | | | | | | | | | | |
| | 3. プラッツバージ灯油スワップ | 6. プラッツローリー軽油スワップ | | | | | | | | | | | | |

※TOCOMの石油スワップ6商品の上市廃止については2021年4月1日付となることとがTOCOMより公表されておりますが、J-GATE 3.0稼働までの間、当該6商品の情報はSPAN RPFに収録されますのでご注意ください。

IM追加チャージ対応概要

- J-GATE3.0の稼働に伴うアドオン・チャージ・パラメーターファイル(APF)の対応概要は下表のとおりとなります。
- 大阪取引所(OSE)における新商品の上市に伴う対応となります。新商品に対応するコード等の詳細については、参考資料3「アドオンチャージ・パラメーター・ファイル仕様書」、参考資料4「RPF及びAPFにおいて使用する商品コード」及び参考資料6「APFサンプルデータ」をご参照いただき、取扱いの開始に向けた所要の対応をお願いします。
- なお、ファイル掲載時刻や掲載場所等については現行からの変更はございません。

| # | 対応 | 概要 |
|---|-----------------------------|--|
| 1 | 指数先物取引におけるフレックス限月取引の導入に伴う対応 | <ul style="list-style-type: none">● OSEにおいて、指数先物取引を対象にフレックス限月取引が導入されることに伴い、APFに以下の指数先物取引に係るレコードが追加されます。<ol style="list-style-type: none">1. 日経平均株価(Large取引)2. 東証株価指数(Large取引) |

※OSEに上市する新商品のうち、上記の表に記載されている以外の指数先物取引のフレックス限月取引及びCME原油等指数先物取引については、追加IMチャージの対象としないことを予定しております。