



# 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

2021年6月更新版

## 更新履歴

更新日	ページ	概要
2020/12/24	-	<ul style="list-style-type: none"><li>初版</li></ul>
2021/6/30	2ページ	<ul style="list-style-type: none"><li>軽微な修正</li></ul>
2021/6/30	3ページ目の後に 新規ページを挿入	<ul style="list-style-type: none"><li>長期国債先物オプションに係る権利行使価格の刻みが見直されることの対応</li><li>ゴム（RSS3）先物、ゴム（TSR20）先物及びプラッツドバイ原油 に係る限月数が見直されることの対応</li></ul>
2021/6/30	5ページ	<ul style="list-style-type: none"><li>プラッツドバイ原油 に係る限月数が見直されることの対応</li></ul>

# 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場、既存商品の上場廃止等に伴う変更となります。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"> <li>● 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。 <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 日経平均株価(Large取引)</li> <li>2. 東証株価指数(Large取引)</li> <li>3. JPX日経インデックス400</li> <li>4. 東証銀行業株価指数</li> <li>5. 東証REIT指数</li> <li>6. 日経平均トータルリターン・インデックス</li> </ol> </li> <li>● 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。）</li> </ul>
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"> <li>● 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。</li> </ul>
3	既存商品の上場廃止に伴う対応	<ul style="list-style-type: none"> <li>● 以下の既存商品が各取引所において上場廃止となり、RPFから当該商品に係るレコードが削除されます。 <div> <div> &lt;OSE&gt; <ol style="list-style-type: none"> <li>1. TOPIX配当指数</li> <li>2. TOPIX Core30配当指数</li> </ol> </div> <div> &lt;TOCOM&gt;(※) <ol style="list-style-type: none"> <li>1. バージガソリンスワップ</li> <li>2. ローリーガソリンスワップ</li> <li>3. プラッツバージ灯油スワップ</li> <li>4. プラッツローリー灯油スワップ</li> <li>5. プラッツバージ軽油スワップ</li> <li>6. プラッツローリー軽油スワップ</li> </ol> </div> </div> </li> </ul>

※TOCOMの石油スワップ6商品の上場廃止については2021年4月1日付となることが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。

## SPAN対応概要（続き）

#	対応	概要
4	長期国債先物オプションに係る権利行使価格の刻みが見直されることの対応	<ul style="list-style-type: none"><li>• OSEにおいて、長期国債先物オプションに係る権利行使価格の刻みが見直されること（50銭単位→25銭単位）に伴い、以下のとおり、RPFにおいて、長期国債先物オプションに係るタイププレコード、タイプ81レコード及びタイプ82レコードの収録内容が変わります。<ul style="list-style-type: none"><li>✓ タイププレコード： 「権利行使価格の小数点位置」は「002」となります（現行は「001」）。</li><li>✓ タイプ81レコード及びタイプ82レコード： 例）権利行使価格153.5円の場合 「オプション権利行使価格」は「0015350」となります（現行は「0001535」）。 例）権利行使価格153.25円の場合 「オプション権利行使価格」は「0015325」となります。</li></ul></li></ul>
5	ゴム（RSS3）先物、ゴム（TSR20）先物及びプラツドバイ原油 に係る限月数が見直されることの対応	<ul style="list-style-type: none"><li>• 商品の限月数について、OSEのゴム（RSS3）先物及びゴム（TSR20）先物が12限月制（現在は6限月制）、TOCOMのプラツドバイ原油 が15限月制（現在は6限月制）となることに伴い、RPFに拡大される限月に係る情報が追加されます。</li></ul>

# 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**上場等**に伴う対応となります。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"><li>● 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。<ul style="list-style-type: none"><li>1. 日経平均株価(Large取引)</li><li>2. 東証株価指数(Large取引)</li></ul></li></ul>
2	<b>ブラッドバイ原油</b> に係る限月数が <b>見直されること</b> の対応	<ul style="list-style-type: none"><li>● <b>商品の限月数について、TOCOMのブラッドバイ原油 が15限月制（現在は6限月制）となることに伴い、APFに拡大される限月に係る情報が追加されます。</b></li></ul>

※OSEに上場する新商品のうち、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。