



超長期国債先物取引単位変更、LNG先物上場及び 電力先物限月延長等に伴うSPAN対応概要

-2022年2月8日

株式会社 日本証券クリアリング機構

SPAN対応概要

- 2022年4月4日に予定している超長期国債先物取引の取引単位変更、LNG先物取引の開始及び電力先物取引の取引対象限月の延長（15限月制から24限月制に変更）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。
- 対応するコードの詳細等については、参考資料1「RPF及びAPFにおいて使用する商品コード」、参考資料2「RPFサンプルデータ」及び参考資料3「SPANパラメーターサンプル」をご参照いただき、適用の開始に向けた所要の対応をお願いいたします。
- 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。
- なお、2022年4月25日付で大阪取引所よる金ミニ先物取引及び白金ミニ先物取引の呼値の単位の見直しが予定されておりますが、これにかかるRPFの変更はございません。

#	対応	概要
1	超長期国債先物取引の取引単位の変更に伴う対応	<ul style="list-style-type: none">● 大阪取引所において、既存の超長期国債先物取引の取引単位が変更されますが、SPANコード含め移行前後での変更はありません。
2	LNG先物取引の新規上場に伴う対応	<ul style="list-style-type: none">● 東京商品取引所において、LNG先物取引が新規上場されることに伴い、RPFに当該取引に係るレコードを追加します。
3	電力先物取引の限月延長に伴う対応	<ul style="list-style-type: none">● 東京商品取引所において、既存の電力先物取引の取引対象限月数が15限月から24限月に延長されることに伴い、RPFにおいては延長される限月に対するタイプ81/82/Bレコードに限月・銘柄情報を収録するほか、直近3限月以外の限月についても、タイプ4レコードに納会月割増額を設定する場合があります。