



デリバティブ売買システム（J-GATE3.0）の 2023年5月案件に伴うSPAN・IM追加 チャージ対応概要

Exchange & beyond

株式会社 日本証券クリアリング機構

2022年9月2日

#	変更日	変更箇所	変更概要
1	2022/9/2	-	初版

1. SPAN・IM追加チャージ対応概要一覧

- 本資料は、大阪取引所（OSE）におけるJ-GATE3.0で予定している2023年5月案件※に係るSPAN・IM追加チャージ対応についてご説明するものです。なお、今後対応が追加となる場合があります。

#	案件	対応概要	詳細
1	日経225マイクロ先物の上場	<ul style="list-style-type: none">SPANリスク・パラメーター・ファイル（RPF）における対象レコードの追加アドオンチャージ・パラメーター・ファイル（APF）における対象レコードの追加	P.3、P.6
2	日経225ミニオプションの開始 (日経225weeklyオプションの商品性等の変更)	<ul style="list-style-type: none">SPANリスク・パラメーター・ファイル（RPF）における対象レコードの追加アドオンチャージ・パラメーター・ファイル（APF）における対象レコードの追加	P.4、P.6
3	日経225オプションの取引制度の変更 (限月拡充・権利行使価格設定方法の見直し)	<ul style="list-style-type: none">SPANリスク・パラメーター・ファイル（RPF）における対象レコードの追加アドオンチャージ・パラメーター・ファイル（APF）における対象レコードの追加	P.5、P.6

※各案件の詳細については、OSEから公表されている制度要綱をご参照ください。

<https://www.jpx.co.jp/rules-participants/public-comment/detail/d8/20220617-01.html>

1-3. 日経225オプションの取引制度の変更

- 日経225オプションの限月取引の設定方法の見直し（27限月取引制への変更）に伴い、タイプ81、82、Bレコードに拡充される限月に係るレコードが収録されます。
- なお、同時に予定されている権利行使価格の設定方法の見直しについては、通常の新規・追加設定時と同様に、タイプ81、82レコードに見直しによって追加された銘柄に係るレコードが収録されます。

【レコード収録例】

B OSENK225	PHY000000		0000000		200003500		002738	10000	
B OSENK225E	00P202304	202304	0000000	00904	1260	20000350000000000750684002738	1000020230414NK225	M	00000000
B OSENK225E	00P202305	202305	0000000	00904	1260	20000350000000000827397002738	1000020230512NK225	M	00000000
B OSENK225E	00P202306	202306	0000000	00904	1260	2000035000000000904109002738	1000020230609NK225	M	00000000
B OSENK225E	00P202307	202307	0000000	00904	1260	2000035000000001000000002738	1000020230714NK225	M	00000000
B OSENK225E	00P202309	202309	0000000	00904	1260	2000035000000001153424002738	1000020230908NK225	M	00000000
B OSENK225E	00P202906	202906	0000000	00904	1260	2000035000000006906849002738	1000020290608NK225	M	00000000
B OSENK225E	00P202912	202912	0000000	00904	1260	2000035000000007424657002738	1000020291214NK225	M	00000000
B OSENK225E	00P203006	203006	0000000	00904	1260	2000035000000007923287002738	1000020300614NK225	M	00000000
810SENK225E	NK225	00PP202304	202304	307500000641-00287+00362-00686+00942-00119-00101-01075+01252-					
820SENK225E	NK225	00PP202304	202304	307500000527-00148+01451+01570-00937-00589+00786-08146-001786960004905					
810SENK225E	NK225	00PC202305	202305	265000000777-00849+01039-00606+00527-01064+01312-00337+00289-					
820SENK225E	NK225	00PC202305	202305	265000001248+01597-00044+00068-01396+00596-00409+04929+002068770001735					
810SENK225E	NK225	00PP202305	202305	265000000843-00784+00693-00952+01005-00587+00555-01094+01178-					
820SENK225E	NK225	00PP202305	202305	265000000359+00428-01213+01368-00096+00245+00479-04868-002068770002030					
810SENK225E	NK225	00PC202306	202306	125000000147-00074+00543-00335-00257+00485+00940-00744-00660+					
820SENK225E	NK225	00PC202306	202306	125000000896+01338-01154-01064+01306+00850-00856+09602+004220600013715					
810SENK225E	NK225	00PP202306	202306	450000000098-00010+00299+00422+00494-00401-00696+00833+00892-					
820SENK225E	NK225	00PP202306	202306	450000000813-01091+01245+01291-01224-00861+00861-09753-002112760018835					
810SENK225E	NK225	00PC202307	202307	150000000242-00137+00641-00272-00155+00547+01040-00682-00550+					
820SENK225E	NK225	00PC202307	202307	150000000956+01439-01092-00946+01366+00851-00847+09405+003724830011300					
810SENK225E	NK225	00PP202307	202307	150000000240-00140+00227-00141+00254-00138+00214-00143+00270-					
820SENK225E	NK225	00PP202307	202307	150000000136+00202-00144+00286-00134+00014+00016-00392-003724830000175					
810SENK225E	NK225	00PC202309	202309	212500000738-00591+01057-00222+00391-00975+01380-00153-00038-					
820SENK225E	NK225	00PC202309	202309	212500001362+01709-00533-00310+01745+00736-00738+07929+002591030005710					

2. アドオン・チャージ・パラメーターファイルの変更

- 日経225マイクロ先物の上場に伴い、タイプ3レコードに日経225マイクロ先物に関するレコードを追加します。
- 日経225weeklyオプションの商品性等の変更に伴い、タイプ3レコードにおいて、「NK225W1、NK225W3、NK225W4、NK225W5」の銘柄コード（9桁コード）の下2桁部分が「20」から「26」に変更となり、また、取引乗数の変更に伴い建玉調整係数は、現行の約1/10となりますのでご注意ください。
- タイプ3レコードに第2週を満期日とする日経225ミニオプション「NK225W2」に関するレコードを追加します。
- 日経225オプションの取引制度の変更に伴い、タイプ3レコードに拡充対象限月及び権利行使価格に関するレコードを追加します。

【レコード収録例】

※オプションの銘柄コード（9桁コード）については、取引開始時期等によって前半の7桁の設定値が変わることから、以下の例では銘柄コードの前半7桁の設定値はダミー値を設定しております（本番相当の値とは異なります。）のでご注意ください。

3	,	ADJUSTMULTIPLIER	,	NK225	,	NK225F	,	FUT	,	203006	,		,	0000000.00	,	165060018	,	01.000	,	+1.0000	,	+01.000000000
3	,	ADJUSTMULTIPLIER	,	NK225	,	NK225MCF	,	FUT	,	202208	,		,	0000000.00	,	167080023	,	01.000	,	+1.0000	,	+00.010000000
3	,	ADJUSTMULTIPLIER	,	NK225	,	NK225MCF	,	FUT	,	202209	,		,	0000000.00	,	167090023	,	01.000	,	+1.0000	,	+00.010000000
3	,	ADJUSTMULTIPLIER	,	NK225	,	NK225MCF	,	FUT	,	202210	,		,	0000000.00	,	167100023	,	01.000	,	+1.0000	,	+00.010000000
3	,	ADJUSTMULTIPLIER	,	NK225	,	NK225MCF	,	FUT	,	202212	,		,	0000000.00	,	167120023	,	01.000	,	+1.0000	,	+00.010000000
3	,	ADJUSTMULTIPLIER	,	NK225	,	NK225MF	,	FUT	,	202208	,		,	0000000.00	,	167080019	,	01.000	,	+1.0000	,	+00.100000000
3	,	ADJUSTMULTIPLIER	,	NK225	,	NK225E	,	00P, P	,	202304	,	202304	,	0030750.00	,	138040718	,	01.000	,	-0.8146	,	-00.814600000
3	,	ADJUSTMULTIPLIER	,	NK225	,	NK225E	,	00P, C	,	202305	,	202305	,	0026500.00	,	148056518	,	01.000	,	+0.4929	,	+00.492900000
3	,	ADJUSTMULTIPLIER	,	NK225	,	NK225E	,	00P, P	,	202305	,	202305	,	0026500.00	,	138056518	,	01.000	,	-0.4868	,	-00.486800000
3	,	ADJUSTMULTIPLIER	,	NK225	,	NK225E	,	00P, C	,	202306	,	202306	,	0012500.00	,	198062518	,	01.000	,	+0.9602	,	+00.960200000
3	,	ADJUSTMULTIPLIER	,	NK225	,	NK225E	,	00P, P	,	202306	,	202306	,	0045000.00	,	188185018	,	01.000	,	-0.9753	,	-00.975300000
3	,	ADJUSTMULTIPLIER	,	NK225	,	NK225E	,	00P, C	,	202307	,	202307	,	0015000.00	,	198075018	,	01.000	,	+0.9405	,	+00.940500000
3	,	ADJUSTMULTIPLIER	,	NK225	,	NK225E	,	00P, P	,	202307	,	202307	,	0015000.00	,	188075018	,	01.000	,	-0.0392	,	-00.039200000
3	,	ADJUSTMULTIPLIER	,	NK225	,	NK225W1	,	00P, P	,	202208	,	202208	,	0029750.00	,	137639726	,	01.000	,	-0.9998	,	-00.099900000
3	,	ADJUSTMULTIPLIER	,	NK225	,	NK225W2	,	00P, C	,	202208	,	202208	,	0026500.00	,	147646526	,	01.000	,	+0.5320	,	+00.053200000
3	,	ADJUSTMULTIPLIER	,	NK225	,	NK225W2	,	00P, P	,	202209	,	202209	,	0026500.00	,	137656526	,	01.000	,	-0.4689	,	-00.046890000
3	,	ADJUSTMULTIPLIER	,	NK225	,	NK225W2	,	00P, C	,	202210	,	202210	,	0026500.00	,	147666526	,	01.000	,	+0.4990	,	+00.049900000
3	,	ADJUSTMULTIPLIER	,	NK225	,	NK225W3	,	00P, C	,	202207	,	202207	,	0022750.00	,	147602726	,	01.000	,	+1.0000	,	+00.100000000
3	,	ADJUSTMULTIPLIER	,	NK225	,	NK225W4	,	00P, P	,	202207	,	202207	,	0030000.00	,	137610026	,	01.000	,	-1.0000	,	-00.100000000
3	,	ADJUSTMULTIPLIER	,	NK225	,	NK225W5	,	00P, C	,	202207	,	202207	,	0022875.00	,	147622826	,	01.000	,	+0.9657	,	+00.096600000