

VaR証拠金計算ソフトウェア 接続仕様書別紙



2024年6月適用予定
2.0版
株式会社 日本証券クリアリング機構

※本資料の全部又は一部を株式会社日本証券クリアリング機構に無断で複製又は転載することはできません。

変更履歴

項番	変更日付	バージョン	セクション	変更内容
1	2022/6/24	ドラフト		
2	2022/11/1	1.0	1-2. VPFフォーマット詳細	「1(HSRRATIO)」から「1(HSRATIO)」に変更
3			3-2. APFフォーマット詳細	Level1用建玉調整係数、Level2用建玉調整係数、Level3用建玉調整係数、Level4用建玉調整係数、Level5用建玉調整係数の内容：「正の小数」から「小数」に変更
4			3-2. APFフォーマット詳細	Level1用建玉調整係数の項目名（和名）：「Lvel1用建玉調整係数」から「Level1用建玉調整係数」に変更 Level2--5も同様
5			4-1. ポジションファイル(csv) フォーマット概要、 4-3. ポジションデータ(json)フォーマット概要	数量が0の銘柄しか存在しないサイロの証拠金計算結果が出ない旨を追記
6			4-2. ポジションファイル(csv) フォーマット詳細	NetPositionに「0」の入力がある場合、NakedLongQuantity、NakedShortQuantityが優先される
7			4-3. ポジションデータ(json)フォーマット概要、 5-3. 証拠金計算結果(json)フォーマット概要	JSONスキーマの提供について追記
8			5-2. 証拠金計算結果ファイル(csv) フォーマット詳細	堂島取引所商品のサイロ名を変更
9	2023/3/17	1.1	1-2. VPFフォーマット詳細	Number of Paramの属性を修正
10			2-2. BPFフォーマット詳細 3-2. APFフォーマット詳細 4-2. ポジションファイル(csv) フォーマット詳細	Underlying Period Codeに対象先物限月コードが入る場合の条件を修正
11			4-1. ポジションファイル(csv) フォーマット概要 4-3. ポジションデータ(json)フォーマット概要	許容文字は本紙に記載して参照するように変更
12			2-2. BPFフォーマット詳細 3-2. APFフォーマット詳細 4-2. ポジションファイル(csv) フォーマット詳細	商品名の変更 日経225Weeklyオプション→日経225ミニオプション
13	2023/10/31	1.2	2-1. BPFフォーマット概要	・BPFの配信時におけるファイル圧縮について記載 ・RNプライム指数先物の取引休止後の扱いを記載
14			2-2. BPFフォーマット詳細 4-2. ポジションファイル(csv) フォーマット詳細	電力先物（週間物）の限月コードが「YYYYMMW」形式であることを追記
15	2024/1/30	2.0	1-2. VPFフォーマット詳細	レコードタイプ0Iに「階層Level」と「集計グループ」の項目を追加
16			4-2. ポジションファイル(csv) フォーマット詳細	データ部(Position)の以下2項目について、入力可能文字を半角英数字のみから、半角英数字記号(スペース含む)に変更 ・オムニバス顧客ID ・取引参加者コード&アカウントコード
17			4-2. ポジションファイル(csv) フォーマット詳細	positionの以下3項目について、適用条件を詳細化 ・ネットポジション数 ・グロス用ロングポジション数 ・グロス用ショートポジション数
18			4-3. ポジションデータ(json)フォーマット概要	OpenAPIの記載を追記
19			4-4. ポジションデータ(json)フォーマット詳細	positionの以下2項目について、入力可能文字を半角英数字のみから、半角英数字記号(スペース含む)に変更 ・オムニバス顧客ID ・取引参加者コード&アカウントコード

目次

変更履歴

目次

1. VPFフォーマット

- 1-1. VPFフォーマット概要
- 1-2. VPFフォーマット詳細

2. BPFフォーマット

- 2-1. BPFフォーマット概要
- 2-2. BPFフォーマット詳細

3. APFフォーマット

- 3-1. APFフォーマット概要
- 3-2. APFフォーマット詳細

4. ポジションデータフォーマット

- 4-1. ポジションデータファイル(csv)フォーマット概要
- 4-2. ポジションデータファイル(csv)フォーマット詳細
- 4-3. ポジションデータ(json)フォーマット概要
- 4-4. ポジションデータ(json)フォーマット詳細

5. 証拠金計算結果フォーマット

- 5-1. 証拠金計算結果ファイル(csv)フォーマット概要
- 5-2. 証拠金計算結果ファイル(csv)フォーマット詳細
- 5-3. 証拠金計算結果(json)フォーマット概要
- 5-4. 証拠金計算結果(json)フォーマット詳細

1. VPFフォーマット

1-1. VPFフォーマット概要

1. ファイル概要

- ・ファイル名は以下のとおりです。

VaRParameter_yyyymmdd_hhmm.csv

※ファイル名に付される“yyymmdd”には、ファイルが出力された日時が設定されます。

※ファイル名に付される“hhmm”には、証拠金種別に応じて以下のとおり数値が設定されます。

証拠金種別	設定される数値
日中取引証拠金	1100
緊急取引証拠金	1300
EOD取引証拠金	1600

2. ファイル形式

- ・データ形式はCSV形式です。
- ・区切り文字はカンマです。
- ・ヘッダは含まれません。
- ・行頭が「#」の行はコメント行です。「#」に続いて項目名が記載されます。
- ・文字コードについては以下のとおりです。

エンコーディング： UTF-8 BOMなし

改行コード： CRLF

3. レコード構成

- ・本ファイルは複数タイプのレコードで構成されており、レコード行頭の数字がどのタイプのレコードであるかを示しています。
- ・すべてのタイプのレコードを並べ、同一ファイル内に出力します。
- ・タイプの種類については下表のとおりで、タイプ毎にレイアウト仕様が異なります。
- ・レイアウト仕様及び項目の詳細は『1-2. VPFフォーマット詳細』に記載しています。

レコードタイプ	記載内容	記載内容詳細
タイプ0レコード	VAR	信頼区間などのVaR算出に関わる設定
タイプ1レコード	HSRATIO	HS-VaRのAggregation Groupオフセットパラメータを表す
タイプ2レコード	ASRATIO	AS-VaRのAggregation Groupオフセットパラメータを表す

1-2. VPFフォーマット詳細

No	レコードタイプ	項目名（和名）	項目名（英名）	属性	内容	設定例
1	0(VAR)	レコードID	Record ID	string	どのタイプのレコードかを示す	0
2	0(VAR)	レコード名	Record Name	string	タイプ別レコードの説明	VAR
3	0(VAR)	階層Level	Level	string	Aggregation Groupが所属する階層を表す	L02
4	0(VAR)	集計グループ	Aggregation Group	string	Aggregation Groupの名前	ENG_FU
5	0(VAR)	信頼区間	Confidence Level	double	HS-VaR算出時に利用する信頼区間(正の小数)(%表記) 信頼区間が99.75%の場合、99.75と記載	99.75
6	0(VAR)	ストレスシナリオ数	Stress Scenario Number	int	VaR算出時に使用されるストレスシナリオの数	4
7	1(HSRATIO)	レコードID	Record ID	string	どのタイプのレコードかを示す	1
8	1(HSRATIO)	レコード名	Record Name	string	タイプ別レコードの説明 「HSRATIO」：HS-VaR	HSRATIO
9	1(HSRATIO)	階層Level	Level	string	Aggregation Groupが所属する階層を表す	L02
10	1(HSRATIO)	集計グループ	Aggregation Group	string	Aggregation Groupの名前	ENG_FU
11	1(HSRATIO)	親集計グループ	Parent Aggregation Group	string	Aggregation Groupの親のAggregation Group	ENG
12	1(HSRATIO)	タイプ	Type	string	「OFFSET_LIMIT」：子を持つAggregation Group オフセット制限式「MAX(Y-(Y-X)a, X, bY)」のa,bパラメータを持つ 「GROUP」：子を持たないAggregation Group	OFFSET_LIMIT
13	1(HSRATIO)	パラメータ数	Number of Param	string	Aggregation Groupが持つパラメータ数 OFFSET_LIMITの場合：2 GROUPの場合：0	2
14	1(HSRATIO)	パラメータ名1	Param Name 01	string		a
15	1(HSRATIO)	パラメータ値1	Param Value 01	double	0以上1以下の小数	0.6
16	1(HSRATIO)	パラメータ名2	Param Name 02	string		b
17	1(HSRATIO)	パラメータ値2	Param Value 02	double	0以上1以下の小数	0.4
18	2(ASRATIO)	レコードID	Record ID	string	どのタイプのレコードかを示す	2
19	2(ASRATIO)	レコード名	Record Name	string	タイプ別レコードの説明 「ASRATIO」：AS-VaR	ASRATIO
20	2(ASRATIO)	階層Level	Level	string	Aggregation Groupが所属する階層を表す	L02
21	2(ASRATIO)	集計グループ	Aggregation Group	string	Aggregation Groupの名前	ENG_FU
22	2(ASRATIO)	親集計グループ	Parent Aggregation Group	string	Aggregation Groupの親のAggregation Group	ENG
23	2(ASRATIO)	タイプ	Type	string	「OFFSET_LIMIT」：子を持つAggregation Group オフセット制限式「MAX(Y-(Y-X)a, X, bY)」のa,bパラメータを持つ 「GROUP」：子を持たないAggregation Group	OFFSET_LIMIT
24	2(ASRATIO)	パラメータ数	Number of Param	int	Aggregation Groupが持つパラメータ数 OFFSET_LIMITの場合：2 GROUPの場合：0	2
25	2(ASRATIO)	パラメータ名1	Param Name 01	string		a
26	2(ASRATIO)	パラメータ値1	Param Value 01	double	0以上1以下の小数	0.6
27	2(ASRATIO)	パラメータ名2	Param Name 02	string		b
28	2(ASRATIO)	パラメータ値2	Param Value 02	double	0以上1以下の小数	0.4

2. BPFフォーマット

2-1. BPFフォーマット概要

1. ファイル概要

- ・BPFは6個のCSV形式ファイルとして生成され、それぞれのファイルにおいて収録する商品の種類が異なります。
- ・出力されるファイルのファイル名およびファイル内容は以下の表のとおりです。

ファイル名	ファイル内容	備考
BPF_JGB_yyyymmdd_hhmm.csv	国債先物・OP 計算用ファイル	
BPF_IDX_yyyymmdd_hhmm.csv	指数先物・OP 計算用ファイル	フレックス銘柄(先物・OP) 及びRNプライム指数先物を除く
BPF_SSO_yyyymmdd_hhmm.csv	有価証券OP 計算用ファイル	フレックスOP銘柄を除く
BPF_COM_yyyymmdd_hhmm.csv	商品先物・OP 計算用ファイル	OSE又はTOCOMに上場する商品先物・OP銘柄を収録
BPF_SPE_yyyymmdd_hhmm.csv	特定銘柄計算用ファイル	フレックス銘柄(先物・OP) 及びRNプライム指数先物を収録
BPF_ODEX_yyyymmdd_hhmm.csv	ODEX先物計算用ファイル	ODEXに上場する先物・OP銘柄を収録

※ファイル名に付される“yyymmdd”には、ファイルが出力された日付が設定されます。

※ファイル名に付される“hhmm”には、証拠金種別に応じて以下のとおり数値が設定されます。

※RNプライム指数先物について、取引休止後も当分の間、銘柄情報が収録されます。

証拠金種別	設定される数値
日中取引証拠金	1100
緊急取引証拠金	1300
EOD取引証拠金	1600
翌日用	1800

2. ファイル形式

- ・データ形式はCSV形式です。
- ・区切り文字はカンマです。
- ・ヘッダは含まれません。
- ・行頭が「#」の行はコメント行です。「#」に続いて項目名が記載されます。
- ・文字コードについては以下のとおりです。

エンコーディング： UTF-8 BOMなし

改行コード： CRLF
- ・ファイル単位でZIP化し、配信します。

3. レコード構成

- ・本ファイルは複数タイプのレコードで構成されており、レコード行頭の数字がどのタイプのレコードであることを示しています。
- ・すべてのタイプのレコードを並べ、同一ファイル内に出力します。
- ・タイプの種類については下表のとおりで、タイプ毎にレイアウト仕様が異なります。
- ・レイアウト仕様及び項目の詳細は『2-2. BPFフォーマット詳細』に記載しています。

レコードタイプ	記載内容	記載内容詳細
タイプ0レコード	DATE	ファイル基準日を表す
タイプ1レコード	INSTRUMENT	対象の銘柄の証拠金計算方式を表す(HS-VaR or AS-VaR)
タイプ2レコード	PRICE	銘柄ごとの清算値段等を表す
タイプ3レコード	HSPL	HS-VaR用の銘柄ごとのUnitPnLを表す
タイプ4レコード	BPL	AS-VaR用のAggregation GroupごとのBPLを表す
タイプ5レコード	ADJUSTMULTIPLIER	AS-VaR用の銘柄ごとのAdjustment Multiplierを表す
タイプ6レコード	SFR	AS-VaR用のプロダクトグループごとのSFRを表す
タイプ7レコード	ASPL	AS-VaR用の銘柄ごとのUnitPnLを表す

2-2. BPFフォーマット詳細

No	レコードタイプ	項目名 (和名)	項目名 (英名)	属性	内容	設定例
1	0(DATE)	レコードID	Record ID	string	どのタイプのレコードかを示す	0
2	0(DATE)	レコード名	Record Name	string	タイプ別レコードの説明	DATE
3	0(DATE)	日付	Date	string	西暦4桁+月2桁+日2桁のYYYYMMDD形式を設定する	20210128
4	0(DATE)	ファイルタイプ	File Type	string	ファイルの配信タイミングを表す 「S」：EOD計算時(Settlement Price) 「I」：日中取引証拠金計算時(Price at intraday margin) 「E」：緊急取引証拠金計算時(Price at emergency margin) 「N」：翌日向け(for Next Day)	S
5	1(INSTRUMENT)	レコードID	Record ID	string	どのタイプのレコードかを示す	1
6	1(INSTRUMENT)	レコード名	Record Name	string	タイプ別レコードの説明	INSTRUMENT
7	1(INSTRUMENT)	銘柄コード	Instrument Code	string	先物・オプション取引識別コード(9桁コード)	136609020
8	1(INSTRUMENT)	商品グループコード	Product Group Code	string	「BPF及びAPFにおいて使用する商品コード」を参照	NK225
9	1(INSTRUMENT)	商品コード	Product Code	string	「BPF及びAPFにおいて使用する商品コード」を参照	NK225E
10	1(INSTRUMENT)	商品タイプ	Contract Type	string	「FUT」：先物(future) 「OOF」：先物オプション(option on future) 「OOP」：現物オプション(option on physical)	OOP
11	1(INSTRUMENT)	プット/コール	Put/Call Type	string	「P」：プット 「C」：コール 先物の場合入力しない	C
12	1(INSTRUMENT)	限月コード	Contract Period Code	string	先物・OPの限月コード (YYYYMM。フレックス先物・OPの場合はYYYYMMDD、日経225ミニオプション及び電力先物 (週間物) の場合はYYYYMMW。)を入力する。	202012
13	1(INSTRUMENT)	原資産限月コード	Underlying Period Code	string	OPの限月コード (YYYYMM。フレックスOPの場合はYYYYMMDD、日経225ミニオプションの場合はYYYYMMW。国債先物OPまたは金先物OPの場合は対象先物限月コード。)を入力する。 先物の場合入力しない	202012
14	1(INSTRUMENT)	権利行使価格	Strike Price	string	オプション権利行使価格 (小数点第4位まで)を入力する。 先物の場合入力しない	22000.0000
15	1(INSTRUMENT)	取引単位	Contract Size	string	対象銘柄の取引換算乗数	1000
16	1(INSTRUMENT)	集計グループ	Aggregation Group	string	集計単位を表す 設定例： 「IDX」：指数系グループ群 「JGB」：国債系グループ群 「ENG_EL」：エネルギー系電力先物グループ群 など	IDX
17	1(INSTRUMENT)	計算方式フラグ	Calculation Method Flag	string	「H」：HS-VaR 「A」：AS-VaR	H
18	2(PRICE)	レコードID	Record ID	string	どのタイプのレコードかを示す	2
19	2(PRICE)	レコード名	Record Name	string	タイプ別レコードの説明	PRICE
20	2(PRICE)	銘柄コード	Instrument Code	string	先物・オプション取引識別コード(9桁コード)	999999999
21	2(PRICE)	価格	Price	double	価格を表す (整数の場合や小数の場合がある)	150.12
22	3(HSPL)	レコードID	Record ID	string	どのタイプのレコードかを示す	3
23	3(HSPL)	レコード名	Record Name	string	タイプ別レコードの説明 「HSPL」：HS-VaR	HSPL
24	3(HSPL)	銘柄コード	Instrument Code	string	先物・オプション取引識別コード(9桁コード)	999999999
25	3(HSPL)	シナリオID	Scenario ID	string	Unit PnLのシナリオIDを表す	20210610
26	3(HSPL)	シナリオ種類	Scenario Type	string	「H」：ヒストリカルシナリオ 「S」：ストレスシナリオ	H
27	3(HSPL)	シナリオ損益	Unit PnL	long	単位数量あたりのシナリオ損益を表す(整数)	150
28	4(BPL)	レコードID	Record ID	string	どのタイプのレコードかを示す	4
29	4(BPL)	レコード名	Record Name	string	タイプ別レコードの説明	BPL
30	4(BPL)	階層Level	Level	string	Aggregation Groupが所属する階層を表す	L01
31	4(BPL)	集計グループ	Aggregation Group	string	集計単位を表す 設定例： 「IDX」：指数系グループ群 「JGB」：国債系グループ群 など	IDX
32	4(BPL)	BasePL	BPL	long	Aggregation Groupの代表銘柄のBasePLを表す(0以上の整数)	99999
33	5(ADJUSTMULTIPLIER)	レコードID	Record ID	string	どのタイプのレコードかを示す	5
34	5(ADJUSTMULTIPLIER)	レコード名	Record Name	string	タイプ別レコードの説明	ADJUSTMULTIPLIER
35	5(ADJUSTMULTIPLIER)	銘柄コード	Instrument Code	string	先物・オプション取引識別コード(9桁コード)	999999999
36	5(ADJUSTMULTIPLIER)	Level1集計グループ	Level1 Aggregation Group	string	Level1階層のAggregation Groupを表す	ENG
37	5(ADJUSTMULTIPLIER)	Level1用建玉調整係数	Level1 Adjustment Multiplier	double	Level1階層の銘柄の建玉を代表銘柄の建玉に調整するための係数を表す(正の小数)	0.5
38	5(ADJUSTMULTIPLIER)	Level2集計グループ	Level2 Aggregation Group	string	Level2階層のAggregation Groupを表す	ENG_EL
39	5(ADJUSTMULTIPLIER)	Level2用建玉調整係数	Level2 Adjustment Multiplier	double	Level2階層の銘柄の建玉を代表銘柄の建玉に調整するための係数を表す(正の小数)	0.5
40	5(ADJUSTMULTIPLIER)	Level3集計グループ	Level3 Aggregation Group	string	Level3階層のAggregation Groupを表す	ENG_EL_TE
41	5(ADJUSTMULTIPLIER)	Level3用建玉調整係数	Level3 Adjustment Multiplier	double	Level3階層の銘柄の建玉を代表銘柄の建玉に調整するための係数を表す(正の小数)	1
42	5(ADJUSTMULTIPLIER)	Level4集計グループ	Level4 Aggregation Group	string	Level4階層のAggregation Groupを表す	ENG_EL_TE_TEBL
43	5(ADJUSTMULTIPLIER)	Level4用建玉調整係数	Level4 Adjustment Multiplier	double	Level4階層の銘柄の建玉を代表銘柄の建玉に調整するための係数を表す(正の小数)	1
44	5(ADJUSTMULTIPLIER)	Level5集計グループ	Level5 Aggregation Group	string	予備項目	
45	5(ADJUSTMULTIPLIER)	Level5用建玉調整係数	Level5 Adjustment Multiplier	double	予備項目	
46	6(SFR)	レコードID	Record ID	string	どのタイプのレコードかを示す	6
47	6(SFR)	レコード名	Record Name	string	タイプ別レコードの説明	SFR
48	6(SFR)	商品グループコード	Product Group Code	string	商品グループを示すコードを表す	TWPL
49	6(SFR)	スプレッド変動リスク	Spread Fluctuation Risk	long	商品グループのスプレッド変動リスクを表す(0以上の整数)	9999
50	7(ASPL)	レコードID	Record ID	string	どのタイプのレコードかを示す	7
51	7(ASPL)	レコード名	Record Name	string	タイプ別レコードの説明 「ASPL」：AS-VaR	ASPL
52	7(ASPL)	銘柄コード	Instrument Code	string	先物・オプション取引識別コード(9桁コード)	999999999
53	7(ASPL)	シナリオID	Scenario ID	string	Unit PnLのシナリオIDを表す	#01
54	7(ASPL)	シナリオ損益	Unit PnL	long	単位数量あたりのシナリオ損益を表す (整数)	11314
55	7(ASPL)	シナリオデルタ	Scenario Delta	double	シナリオデルタを表す(小数)	0.8

3. APFフォーマット

3-1. APFフォーマット概要

1. ファイル概要

- ・ファイル名は以下のとおりです。
APF_yyyymmdd_hhmm.csv
- ※ファイル名に付される“yyymmdd”には、ファイルが出力された日付が設定されます。
- ※ファイル名に付される“hhmm”には、証拠金種別に応じて以下のとおり数値が設定されます。

証拠金種別	設定される数値
日中取引証拠金	1100
緊急取引証拠金	1300
EOD取引証拠金	1600

2. ファイル形式

- ・データ形式はCSV形式です。
- ・区切り文字はカンマです。
- ・ヘッダは含まれません。
- ・行頭が「#」の行はコメント行です。「#」に続いて項目名が記載されます。
- ・文字コードについては以下のとおりです。
エンコーディング：UTF-8 BOMなし
改行コード：CRLF

3. レコード構成

- ・本ファイルは複数タイプのレコードで構成されており、レコード行頭の数字がどのタイプのレコードであるかを示しています。
- ・すべてのタイプのレコードを並べ、同一ファイル内に出力します。
- ・タイプの種類については下表のとおりで、タイプ毎にレイアウト仕様が異なります。
- ・レイアウト仕様及び項目の詳細は『3-2. APFフォーマット詳細』に記載しています。

レコードタイプ	記載内容	記載内容詳細
タイプ0レコード	Date	ファイル基準日を表す
タイプ1レコード	BPL	Aggregation GroupごとのBPL情報を表す
タイプ2レコード	Threshold	Aggregation Groupごとに先物集中、OP集中、流動性の基準数量を表す
タイプ3レコード	Ratio	Aggregation Groupのオフセットパラメータを表す
タイプ4レコード	AdjustmentMultiplier	各銘柄がどのAggregation Groupに所属するか、所属するAggregation Groupに対するAdjustmentMultiplierを表す

3-2. APFフォーマット詳細

No	レコードタイプ	項目名 (和名)	項目名 (英名)	属性	内容	設定例
1	0(Date)	レコードID	Record ID	string	どのタイプのレコードかを示す	0
2	0(Date)	レコード名	Record Name	string	タイプ別レコードの説明	DATE
3	0(Date)	日付	Date	string	西暦4桁+月2桁+日2桁のYYYYMMDD形式を設定する	20210128
4	1(BPL)	レコードID	Record ID	string	どのタイプのレコードかを示す	1
5	1(BPL)	レコード名	Record Name	string	タイプ別レコードの説明	BPL
6	1(BPL)	階層Level	Level	string	Aggregation Groupが所属する階層を表す	L03
7	1(BPL)	集計グループ	Aggregation Group	string	集計単位を表す 設定例： 「IDX」：指数系グループ群 「JGB」：国債系グループ群 など	ENG_EL_TE_TEPL
8	1(BPL)	BasePL	BPL	long	Aggregation Groupの代表銘柄のBasePLを表す(0以上の整数)	6000
9	2(Threshold)	レコードID	Record ID	string	どのタイプのレコードかを示す	2
10	2(Threshold)	レコード名	Record Name	string	タイプ別レコードの説明	THRESHOL
11	2(Threshold)	階層Level	Level	string	Aggregation Groupが所属する階層を表す	L02
12	2(Threshold)	集計グループ	Aggregation Group	string	集計単位を表す 設定例： 「IDX」：指数系グループ群 「JGB」：国債系グループ群 など	ENG_EL_TE_TEPL
13	2(Threshold)	基準額コード	Threshold Code	string	「LIQ」：流動性 「FCON」：先物集中 「OCON」：OP集中	LIQ
14	2(Threshold)	基準額	Threshold	long	基準数量（1日で処分できる数量）×保有期間が設定される	31000
15	2(Threshold)	システム値	System Value	string	システム内部で利用される値	10
16	3(Ratio)	レコードID	Record ID	string		3
17	3(Ratio)	レコード名	Record Name	string	タイプ別レコードの説明	RATIO
18	3(Ratio)	階層Level	Level	string	Aggregation Groupが所属する階層を表す	L02
19	3(Ratio)	集計グループ	Aggregation Group	string	Aggregation Groupの名前	ENG_FU
20	3(Ratio)	親集計グループ	Parent Aggregation Group	string	Aggregation Groupの親のAggregation Group	ENG
21	3(Ratio)	タイプ	Type	string	「OFFSET_LIMIT」：子を持つAggregation Group オフセット制限式「MAX(Y-(Y-X)a, X, bY)」のa,bパラメータを持つ 「GROUP」：子を持たないAggregation Group	OFFSET_LIMIT
22	3(Ratio)	パラメータ数	Number of Param	int	Aggregation Groupが持つパラメータ数 OFFSET_LIMITの場合：2 GROUPの場合：0	2
23	3(Ratio)	パラメータ名1	Param Name 01	string		a
24	3(Ratio)	パラメータ値1	Param Value 01	double	0以上1以下の小数	0.6
25	3(Ratio)	パラメータ名2	Param Name 02	string		b
26	3(Ratio)	パラメータ値2	Param Value 02	double	0以上1以下の小数	0.4
27	4(AdjustmentMultiplier)	レコードID	Record ID	string	どのタイプのレコードかを示す	4
28	4(AdjustmentMultiplier)	レコード名	Record Name	string	タイプ別レコードの説明 「ADJUSTMULTIPLIER」：建玉調整係数	ADJUSTMULTIPLIER
29	4(AdjustmentMultiplier)	商品グループコード	Product Group Code	string	「BPF及びAPFにおいて使用する商品コード」を参照	TEBL
30	4(AdjustmentMultiplier)	商品コード	Product Code	string	「BPF及びAPFにおいて使用する商品コード」を参照	TEBLF
31	4(AdjustmentMultiplier)	商品タイプ	Contract Type	string	「FUT」：先物(future) 「OOF」：先物オプション(option on future) 「OOP」：現物オプション(option on physical)	FUT
32	4(AdjustmentMultiplier)	プット/コール	Put/Call Type	string	「P」：プット 「C」：コール 先物の場合入力しない	
33	4(AdjustmentMultiplier)	限月コード	Contract Period Code	string	先物・OPの限月コード（YYYYMM。フレックス先物・OPの場合はYYYYMMDD、日経225ミニオプションの場合はYYYYMMW。）を入力する。	202112
34	4(AdjustmentMultiplier)	原資産限月コード	Underlying Period Code	string	OPの限月コード（YYYYMM。フレックスOPの場合はYYYYMMDD、日経225ミニオプションの場合はYYYYMMW。国債先物OPまたは金先物OPの場合は対象先物限月コード。）を入力する。 先物の場合入力しない	
35	4(AdjustmentMultiplier)	権利行使価格	Strike Price	string	オプション権利行使価格（小数点第4位まで）を入力する。 先物の場合入力しない	
36	4(AdjustmentMultiplier)	銘柄コード	Instrument Code	string	先物・オプション取引識別コード(9桁コード)	1661200B3
37	4(AdjustmentMultiplier)	Level1集計グループ	Level1 Aggregation Group	string	Level1階層のAggregation Groupを表す	ENG
38	4(AdjustmentMultiplier)	Level1用建玉調整係数	Level1 Adjustment Multiplier	double	Level1階層の銘柄の建玉を代表銘柄の建玉に調整するための係数を表す(小数)	0.85
39	4(AdjustmentMultiplier)	Level2集計グループ	Level2 Aggregation Group	string	Level2階層のAggregation Groupを表す	ENG_EL
40	4(AdjustmentMultiplier)	Level2用建玉調整係数	Level2 Adjustment Multiplier	double	Level2階層の銘柄の建玉を代表銘柄の建玉に調整するための係数を表す(小数)	0.9
41	4(AdjustmentMultiplier)	Level3集計グループ	Level3 Aggregation Group	string	Level3階層のAggregation Groupを表す	ENG_EL_TE
42	4(AdjustmentMultiplier)	Level3用建玉調整係数	Level3 Adjustment Multiplier	double	Level3階層の銘柄の建玉を代表銘柄の建玉に調整するための係数を表す(小数)	1
43	4(AdjustmentMultiplier)	Level4集計グループ	Level4 Aggregation Group	string	Level4階層のAggregation Groupを表す	ENG_EL_TE_TEBL
44	4(AdjustmentMultiplier)	Level4用建玉調整係数	Level4 Adjustment Multiplier	double	Level4階層の銘柄の建玉を代表銘柄の建玉に調整するための係数を表す(小数)	1
45	4(AdjustmentMultiplier)	Level5集計グループ	Level5 Aggregation Group	string	Level5階層のAggregation Groupを表す	
46	4(AdjustmentMultiplier)	Level5用建玉調整係数	Level5 Adjustment Multiplier	double	Level5階層の銘柄の建玉を代表銘柄の建玉に調整するための係数を表す(小数)	

4. ポジションデータフォーマット

4-1. ポジションデータファイル(csv)フォーマット概要

1. ファイル概要

- ・ファイル名は任意です。

2. ファイル形式

- ・本ファイルはヘッダ部とデータ部で構成されます。
- ・データ形式はCSV形式です。
- ・区切り文字はカンマです。
- ・ヘッダ部とデータ部のそれぞれの1行目は、カラム名を示すレコードとします。
- ・文字コードについては以下のとおりです。

エンコーディング： UTF-8 BOMなし

改行コード： CRLF
- ・ファイル最終行の末尾にも改行が必要です。

3. レコード構成

- ・データ部の1レコードが、アカウント情報に対する銘柄のポジションを表します。
- ・アカウント情報のキーは「清算参加者コード」、「取引参加者コード&アカウントコード」(オムニバス口座の場合はそれに加えて「オムニバス顧客ID」)です。
- ・銘柄情報のキーは「銘柄コード」、それが空欄の場合は「商品コード」、「商品タイプ」、「限月コード」、「プット/コール」、「権利行使価格」、「原資産限月コード」です。

- ・レイアウト仕様及び項目の詳細は『4-2. ポジションデータファイル(csv)フォーマット詳細』に記載しています。

4. 注意事項

- ・ネットポジションとグロスポジションの両方を1レコードにまとめることはできません。
もしまとめた場合はそのアカウントのその銘柄については、ネットポジションのみが証拠金計算の対象になり、グロスポジション数は0とみなされます。
- ・同一のアカウント情報、銘柄情報を指定したネットポジションのレコードとグロスポジションのレコードがファイル内に混在する場合、そのアカウントのその銘柄についてはそれら全レコードのネットポジション数の合算のみが証拠金計算の対象になり、グロス用ロングポジション数、グロス用ショートポジション数は0とみなされます。
- ・よって、ひとつのアカウントが同一銘柄のネットポジションとグロスポジションの両方を持つ場合は、別のアカウント情報を与えそれぞれのレコードを作成することを推奨します。
- ・アカウントごと、NetPosition、NakedLongQuantity、NakedShortQuantityのすべてが空もしくは0である銘柄しか存在しないサイロについては、証拠金計算結果が出力されません。
- ・ポジションデータファイルにおいて許容可能な文字は本紙追記をご参照ください。
ただし、フォーマット詳細の内容欄においてフォーマットの指定がある項目については、当該項目の説明にしたがって入力してください。

4-2. ポジションデータファイル(csv)フォーマット詳細

カテゴリ	No	項目名 (和名)	項目名 (英名)	Mandatory/Optional	Conditional条件	最大桁数	属性	内容	(例1)	(例2)
ヘッダー部 (Info)	1	リクエストID	RequestID	Optional	-	100	string	入力不要。必要に応じ、ユーザが任意で指定できるID等の入力エリアとして利用可能。		AA1111
	2	バージョン	Version	Optional	-	10	string	入力不要。必要に応じ、利用しているソフトウェアのバージョン等の入力エリアとして利用可能。		1.0
	3	送信時刻	SentTime	Optional	-	24	string	入力不要。必要に応じ、送信時刻等の入力エリアとして利用可能。 YYYY-MM-DDTHH:MM:SS.SSSZ		2021-12-08T17:43:09.422Z
	4	日付	BusinessDate	Mandatory	-	10	string	証拠金計算の基準日を「YYYY-MM-DD」形式で入力	2021-12-08	2021-12-08
	5	サイクルコード	CycleCode	Optional	-	5	string	入力不要。必要に応じ、証拠金計算のタイミング (ITD,EMG,EOD) 等の入力エリアとして利用可能。	EOD	EOD
	6	処理番号	RunNumber	Optional	-	3	string	入力不要。必要に応じ、処理通番等の入力エリアとして利用可能。		3
	7	時刻	Time	Optional	-	8	string	入力不要。必要に応じ、JSCCパラメータファイルが作成された時刻等を「HH:MM:SS」形式で入力可能。		17:43:09
データ部 (Position)	8	オムニバス顧客ID	id	Conditional Mandatory	オムニバスがある場合、入力必須	100	string	顧客を識別する任意のIDを設定するソフトウェア使用者により自由に設定可 半角英数字のみ入力可能	A1	A1
	9	通貨	Currency	Mandatory	-	3	string	清算対象の通貨を表す JPYのみを指定可能	JPY	JPY
	10	カスタマーアカウントタイプ	CustomerAccountType	Optional	-	15	string	入力不要。必要に応じ、アカウントタイプ (MEMBER、HEDGER) 等の入力エリアとして利用可能		HEDGE
	11	オムニバス種別	OmnibusIndicator	Optional	-	3	string	入力不要。必要に応じ、オムニバス口座が否か (YES、NO) 等の入力エリアとして利用可能		YES
	12	親ポートフォリオID	ParentPortfolioID	Optional	-	100	string	入力不要。必要に応じ、メモ、備考として利用可能		
	13	メモ	Memo	Optional	-	100	string	入力不要。必要に応じ、メモ、備考として利用可能		
	14	清算参加者コード	ClearingFirmID	Mandatory	-	100	string	清算参加者コード (5桁コード) を入力する 参加者以外のユーザにおける利用時は、ライブラリ使用者により自由に設定可 半角英数字のみ入力可能	99999	99999
	15	取引参加者コード & アカウントコード	AccountID	Mandatory	-	100	string	取引参加者コード (5桁コード) と清算システムにおける口座名を繋げた値を入力 (参加者コード99999で口座名がCLIENTの場合、 「99999CLIENT」を入力) 参加者以外のユーザにおける利用時は、ライブラリ使用者により自由に設定可 半角英数字のみ入力可能	99999CLIENT	99999CLIENT
	16	アカウント名	AccountName	Optional	-	100	string	入力不要。必要に応じ、口座属性等の入力エリアとして利用可能		DomesticClientAccount
	17	オリジンタイプ	OriginType	Optional	-	10	string	入力不要。必要に応じ、口座属性等の入力エリア (CUSTOMER,HOUSE) 等の入力エリアとして利用可能		CUSTOMER
	18	ファンド区別タイプ	FundSegregationType	Optional	-	10	string	入力不要。必要に応じ、メモ、備考として利用可能		
	19	カスタマーアカウントタイプ2	CustomerAccountType2	Optional	-	15	string	入力不要。必要に応じ、メモ、備考として利用可能		
	20	ネットポジション数	NetPosition	Conditional Mandatory	ネットポジションの場合、入力必須	10	long(can be negative)	ネットポジションで計算する場合はそのポジション数 (ロング・ポジション数量－ショート・ポジション数量) を入力する。 ただし、「0」を入力した場合はグロスポジションとしての計算とみなし、No.21、22のポジション数量を適用して計算する。	1	1
	21	グロス用ロングポジション数	NakedLongQuantity	Conditional Mandatory	グロスポジションのロングがある場合、入力必須	10	long(cannot be negative)	ネットポジションの場合は入力不要。 参加者側のJSCCに対するポジション申告が未了の状況で、当該口座における証拠金所要額の総額を合致させたい場合 (清算システム上、グロス計算される未申告分の証拠金計算結果を考慮したい場合)、当該未申告のロングポジション数を入力する。 No.20に「0」以外の入力がある場合、No.20を優先する No.20に「0」を入力または空欄の場合、本項目が適用される。 No.20に「0」以外の整数を入力した場合、本項目は適用されない。		
	22	グロス用ショートポジション数	NakedShortQuantity	Conditional Mandatory	グロスポジションのショートがある場合、入力必須	10	long(cannot be negative)	ネットポジションの場合は入力不要。 参加者側のJSCCに対するポジション申告が未了の状況で、当該口座における証拠金所要額の総額を合致させたい場合 (清算システム上、グロス計算される未申告分の証拠金計算結果を考慮したい場合)、当該未申告のショートポジション数を入力する。 No.20に「0」以外の入力がある場合、No.20を優先する No.20に「0」を入力または空欄の場合、本項目が適用される。 No.20に「0」以外の整数を入力した場合、本項目は適用されない。		
	23	清算機関ID	ClearingOrganizationId	Optional	-	5	string	入力不要。必要に応じ、清算機関コード (JSCC) 等の入力エリアとして利用可能。		JSCC
	24	取引所ID	ExchangeId	Optional	-	5	string	入力不要。必要に応じ、取引所コード (OSE、TOCOM、ODEX) 等の入力エリアとして利用可能。		OSE
	25	商品コード	ProductCode	Conditional Mandatory	No.25～30またはNo.31のどちらかを入力必須	10	string	No.31を入力しない場合、入力必要。No.31に入力がある場合、No.31を優先する。 「BPF及びAPFにおいて使用する商品コード」を参照。		
	26	商品タイプ	ProductType	Conditional Mandatory		3	string	No.31を入力しない場合、入力必要。No.31に入力がある場合、No.31を優先する。 入力する場合、該当する以下の内容を入力する。 「FUT」：先物(future) 「OOF」：先物オプション(option on future) 「OOP」：現物オプション(option on physical)		
	27	限月コード	ContractPeriodCode	Conditional Mandatory		8	string	No.31を入力しない場合、入力必要。No.31に入力がある場合、No.31を優先する。 入力する場合、先物・OPの限月コード (YYYYMM。フレックス先物・OPの場合はYYYYMMDD、日経225ミニオプション及び電力先物 (週間物) の場合はYYYYMMMW。)を入力する。		
	28	プット/コール	PutCallIndicator	Conditional Mandatory		1	string	No.31を入力しない場合、入力必要。No.31に入力がある場合、No.31を優先する。 入力する場合、該当する以下の内容を入力する。 「P」：プット 「C」：コール 先物の場合入力しない。		
	29	権利行使価格	Strike	Conditional Mandatory		10	string	No.31を入力しない場合、入力必要。No.31に入力がある場合、No.31を優先する。 入力する場合、オプション権利行使価格 (小数点第4位まで) を入力する。 先物の場合入力しない。		
	30	原資産限月コード	UnderlyingPeriodCode	Conditional Mandatory		8	string	No.31を入力しない場合、入力必要。No.31に入力がある場合、No.31を優先する。 入力する場合、OPの限月コード (YYYYMM。フレックスOPの場合はYYYYMMDD、日経225ミニオプションの場合はYYYYMMMW。国債先物OPまたは金先物OPの場合は対象先物限月コード。)を入力する。 先物の場合入力しない。		
	31	銘柄コード	JSCCInstrumentCode	Conditional Mandatory		9	string	先物・オプション取引識別コード(9桁コード)を入力する。 No.25～No.30を入力しない場合、入力必要。No.25～No.30及びNo.31の両方が入力されていた場合、No.31を優先する。	169120019	169120019

※No.8以降のデータ部に関し、Optional項目に入力する場合、口座情報や銘柄情報間で整合的な情報を入力してください。整合的ではない情報が入力されている場合、入力内容がアウトプットファイルに反映されない場合や、想定と異なる証拠金所要額計算結果が出力される場合があります。

不適当な例

例1、
No.31に「169120019」（OSEに上場する日経225mini先物2024年12月限）を入力している状態で、No.24に「OSE」を入力しているレコードと「TOCOM」を入力しているレコードが混在する状態

例2、
No.15に「99999CLIENT」（参加者コード99999のCLIENT口座）を入力している状態で、No.11に「YES」を入力しているレコードと「NO」を入力しているレコードが混在する状態

4-3. ポジションデータ(json)フォーマット概要

1. データ形式

- ・データ形式はJSON形式です。
- ・文字コードについては以下のとおりです。
エンコーディング： UTF-8 BOMなし

2. データ構成

- ・アカウントごと、銘柄ごとのポジション情報をひとつのオブジェクトとし、その配列を入力します。
- ・アカウント情報のキーは「清算参加者コード」、「取引参加者コード&アカウントコード」(オムニバス口座の場合はそれに加えて「オムニバス顧客ID」)です。
- ・銘柄情報のキーは「銘柄コード」、それが空欄の場合は「商品コード」、「商品タイプ」、「限月コード」、「プット/コール」、「権利行使価格」、「原資産限月コード」です。
- ・レイアウト仕様及び項目の詳細は『4-4. ポジションデータ(json)フォーマット詳細』に記載しています。
- ・JSONスキーマ(vma-jsonschema.json)をバリデーションにご活用ください。
- ・**OpenAPIドキュメント(vma_openapi.json)をフォーマットの確認にご活用ください。**

3. 注意事項

- ・ネットポジションとグロスポジションの両方を1オブジェクトにまとめることはできません。
もしまとめた場合、そのアカウントのその銘柄については、ネットポジションのみが証拠金計算の対象になり、グロスポジション数は0とみなされます。
- ・同一のアカウント情報、銘柄情報を指定したネットポジションのオブジェクトとグロスポジションのオブジェクトが配列内に混在する場合、そのアカウントのその銘柄についてはそれら全データのネットポジション数の合算のみが証拠金計算の対象になり、グロス用ロングポジション数、グロス用ショートポジション数は0とみなされます。
- ・よって、ひとつのアカウントが同一銘柄のネットポジションとグロスポジションの両方を持つ場合は、別のアカウント情報を与えそれぞれのオブジェクトを入力することを推奨します。
- ・アカウントごと、NetPosition、NakedLongQuantity、NakedShortQuantityのすべてが空もしくは0である銘柄しか存在しないサイロについては、証拠金計算結果が出力されません。
- ・ポジションデータファイルにおいて許容可能な文字は本紙追記をご参照ください。
ただし、フォーマット詳細の内容欄においてフォーマットの指定がある項目については、当該項目の説明にしたがって入力してください。

4-4. ポジションデータ(json)フォーマット詳細

No	項目	項目名称	Mandatory/Optional	Conditional条件	最大桁数	属性	入力チェック	(例1)	(例2)
1	positionData					object			
2	calcInfo					object			
3		RequestID	リクエストID	Optional	-	100	string		AA1111
4		Version	バージョン	Optional	-	10	string		1
5		SentTime	送信時刻	Optional	-	24	string		2021-12-08T17:43:09.422Z
6		BusinessDate	日付	Mandatory	-	10	string	証拠金計算の基準日を「YYYY-MM-DD」形式で入力	2021-12-08
7		CycleCode	サイクルコード	Optional	-	5	string	EOD	EOD
8		RunNumber	処理番号	Optional	-	3	string		0:00:00
9		Time	時刻	Optional	-	8	string		17:43:09
10	position					array			
11		id	オムニバス顧客ID	Conditional Mandatory	オムニバスがある場合、入力必須	100	string	半角英数字のみ入力可能	A1
12		Currency	通貨	Mandatory	-	3	string	JPYのみを指定可能	JPY
13		CustomerAccountType	カスタマーアカウントタイプ	Optional	-	15	string		HEDGE
14		OmnibusIndicator	オムニバス種別	Optional	-	3	string		YES
15		ParentPortfolioID	親ポートフォリオID	Optional	-	100	string		
16		Memo	メモ	Optional	-	100	string		
17		ClearingFirmID	清算参加者コード	Mandatory	-	100	string	半角英数字のみ入力可能	99999
18		AccountID	取引参加者コード & アカウントコード	Mandatory	-	100	string	半角英数字のみ入力可能	99999CLIENT
19		AccountName	アカウント名	Optional	-	100	string		DomesticClientAccount
20		OriginType	オリジンタイプ	Optional	-	10	string		CUSTOMER
21		FundSegregationType	ファンド区別タイプ	Optional	-	10	string		
22		CustomerAccountType2	カスタマーアカウントタイプ2	Optional	-	15	string		
23		NetPosition	ネットポジション数	Conditional Mandatory	ネットポジションの場合、入力必須	10	long(can be negative)	1	1
24		NakedLongQuantity	グロス用ロングポジション数	Conditional Mandatory	グロスポジションのロングがある場合、入力必須	10	long(cannot be negative)		
25		NakedShortQuantity	グロス用ショートポジション数	Conditional Mandatory	グロスポジションのショートがある場合、入力必須	10	long(cannot be negative)		
26		ClearingOrganizationId	清算機関ID	Optional	-	5	string		JSCC
27		ExchangeID	取引所ID	Optional	-	5	string		OSE
28		ProductCode	商品コード	Conditional Mandatory	No.28～33またはNo.34のどちらかを入力必須	10	string		
29		ProductType	商品タイプ	Conditional Mandatory		3	string		
30		ContractPeriodCode	限月コード	Conditional Mandatory		8	string		
31		PutCallIndicator	プット/コール	Conditional Mandatory		1	string		
32		Strike	権利行使価格	Conditional Mandatory		20	string		
33		UnderlyingPeriodCode	原資産限月コード	Conditional Mandatory		8	string		
34		JSCCInstrumentCode	銘柄コード	Conditional Mandatory		9	string	169120019	169120019

※No.11以降のデータ部に関し、Optional項目に入力する場合、口座情報や銘柄情報間で整合的な情報を入力してください。整合的ではない情報が入力されている場合、入力内容がアウトプットに反映されない場合や、想定と異なる証拠金所要額計算結果が出力される場合があります。

不適當な例

例 1.
No.34に「169120019」（OSEに上場する日経225mini先物2024年12月限）を入力している状態で、No.27に「OSE」を入力しているレコードと「TOCOM」を入力しているレコードが混在する状態

例 2.
No.18に「99999CLIENT」（参加者コード99999のCLIENT口座）を入力している状態で、No.14に「YES」を入力しているレコードと「NO」を入力しているレコードが混在する状態

5. 証拠金計算結果フォーマット
5-1. 証拠金計算結果ファイル(csv)フォーマット概要

1. ファイル概要

- ・デフォルトのファイル名称は以下のとおりです。
MarginResult_yyyymmddhhmmss_uid.csv
- ※”yyyymmddhhmmss”には、ファイルが出力された日時が設定されます。”uid”には4桁のIDがランダムに付与されます。
- ・ユーザにてファイル名の指定も可能です。
- ・短い間(1秒以内)に複数ファイルを出力する場合、ファイル名が重複する可能性があります。
ファイル名の重複を確実に避けたい場合は、ユーザにてファイル名の指定をしてください。

2. ファイル形式

- ・本ファイルはヘッダ部とデータ部で構成されます。
- ・データ形式はCSV形式です。
- ・区切り文字はカンマです。
- ・ヘッダ部とデータ部のそれぞれについて、カラム名を示すレコードが1行出力されます。
- ・文字コードについては以下のとおりです。
エンコーディング：UTF-8 BOMなし
改行コード：CRLF

3. レコード構成

- ・証拠金計算結果は複数のレコードにより構成されます。
- ・レコードは、VaR証拠金算出ソフトウェアの入力ファイル(ポジションデータ)における「清算参加者コード」、「取引参加者コード&アカウントコード」(オムニバス口座の場合はそれに加えて「オムニバス顧客ID」)及びサイロをキーとして構成され、それぞれのレコードについて証拠金計算結果が表示されます。
- ・レイアウト仕様及び項目の詳細は『5-2. 証拠金計算結果ファイル(csv)フォーマット詳細』に記載しています。

5-2. 証拠金計算結果ファイル(csv)フォーマット詳細

カテゴリ	No	項目名（和名）	項目名（英名）	最大桁数	属性	内容	(例1)	(例2)
ヘッダー部（Info）	1	リクエストID	RequestID	100	string	ポジションファイルにおいてユーザが入力した場合、当該入力内容を出力する。		AA1111
	2	バージョン	Version	10	string	ポジションファイルにおいてユーザが入力した場合、当該入力内容を出力する。		1.0
	3	送信時刻	SentTime	24	string	ポジションファイルにおいてユーザが入力した場合、当該入力内容を出力する。		2021-12-08T17:43:09.422Z
	4	日付	BusinessDate	10	string	証拠金計算の基準日を表す YYYY-MM-DD	2021-12-08	2021-12-08
	5	サイクルコード	CycleCode	5	string	ポジションファイルにおいてユーザが入力した場合、当該入力内容を出力する。	EOD	EOD
	6	処理番号	RunNumber	3	string	ポジションファイルにおいてユーザが入力した場合、当該入力内容を出力する。		3
	7	時刻	Time	8	string	ポジションファイルにおいてユーザが入力した場合、当該入力内容を出力する。		17:43:09
データ部（Margin）	8	オムニバス顧客ID	id	100	string	ポジションファイルにおいてユーザが入力した場合、当該入力内容を出力する。	A1	A1
	9	通貨	Currency	3	string	清算対象の通貨を表す	JPY	JPY
	10	カスタマーアカウントタイプ	CustomerAccountType	15	string	ポジションファイルにおいてユーザが入力した場合、当該入力内容を出力する。		HEDGE
	11	オムニバス種別	OmnibusIndicator	3	string	ポジションファイルにおいてユーザが入力した場合、当該入力内容を出力する。		YES
	12	親ポートフォリオID	ParentPortfolioID	100	string	ポジションファイルにおいてユーザが入力した場合、当該入力内容を出力する。		
	13	メモ	Memo	100	string	ポジションファイルにおいてユーザが入力した場合、当該入力内容を出力する。		
	14	清算参加者コード	ClearingFirmID	100	string	清算参加者コードを表す 参加者以外のユーザにおける利用時は、ライブラリ使用者により自由に設定された値	99999	99999
	15	取引参加者コード&アカウントコード	AccountID	100	string	取引参加者コード（5桁コード）と清算システムにおける口座名を繋げた値を表す 参加者以外のユーザにおける利用時は、ライブラリ使用者により自由に設定された値	99999CLIENT	99999CLIENT
	16	アカウント名	AccountName	100	string	ポジションファイルにおいてユーザが入力した場合、当該入力内容を出力する。		DomesticClientAccount
	17	オリジンタイプ	OriginType	10	string	ポジションファイルにおいてユーザが入力した場合、当該入力内容を出力する。		CUSTOMER
	18	ファンド区別タイプ	FundSegregationType	10	string	ポジションファイルにおいてユーザが入力した場合、当該入力内容を出力する。		
	19	カスタマーアカウントタイプ2	CustomerAccountType2	15	string	ポジションファイルにおいてユーザが入力した場合、当該入力内容を出力する。		
	20	サイロ	Silo	5	string	「JGB」：国債先物等清算資格 「IDX」：指数先物等清算資格 「PME」：貴金属先物等清算資格 「RUB」：ゴム先物等清算資格 「AGR」：農産物先物等清算資格 「PTL」：OSE原油先物等清算資格 「ENG」：エネルギー先物等清算資格 「ODE」：堂島農産物先物等清算資格	IDX	IDX
	21	VaR証拠金額	VaRMargin	15	long	VaR方式により計算した証拠金額を表す 0以上の整数	648132680	648132680
	22	証拠金割増額	Add_onCharge	15	long	リスク量(建玉の保有水準)に応じた証拠金の割増額を表す (LCRM) ただし、Gross対象ポジションに対する割増額は、0が設定される 0以上の整数	6326641	6326641
	23	証拠金所要額	MarginRequirement	15	long	VaR証拠金と証拠金割増額の合計額を表す 0以上の整数	654459321	654459321
	24	（参考）VaR証拠金額[符号付]	Ref_VaRMarginWithSign	15	long	VaR方式により計算した証拠金額（負であっても0に切り上げない。）を表す 整数（0や負も含む）	660785962	660785962
	25	（参考）ネット・オプション価値	Ref_NetOptionValue	15	long	買いオプションの価値の総額から、売りオプションの価値の総額を差し引いた値 整数（0や負も含む）	-654459321	-654459321
	26	VaRリスク額	VaRRisk	15	long	VaR証拠金額[符号付]にネット・オプション価値を加算した値を表す 整数（0や負も含む）	6326641	6326641

5-3. 証拠金計算結果(json)フォーマット概要

1. データ形式

- ・データ形式はJSON形式です。
- ・文字コードについては以下のとおりです。
エンコーディング： UTF-8 BOMなし

2. データ構成

- ・証拠金計算結果は複数のオブジェクトにより構成され、それらの配列として出力されます。
- ・オブジェクトは、VaR証拠金算出ソフトウェアの入力ファイル(ポジションデータ)における「清算参加者コード」、「取引参加者コード&アカウントコード」(オムニバス口座の場合はそれに加えて「オムニバス顧客ID」)及びサイロをキーとして構成され、それぞれのオブジェクトについて証拠金計算結果が表示されます。
- ・レイアウト仕様及び項目の詳細は『5-4. 証拠金計算結果(json)フォーマット詳細』に記載しています。
- ・JSONスキーマをバリデーションにご活用ください。

5-4. 証拠金計算結果(json)フォーマット詳細

No	項目	項目名称	最大桁数	属性	(例 1)	(例 2)
1	retData			object		
2	calcInfo			object		
3	RequestID	リクエストID	100	string		AA1111
4	Version	バージョン	10	string		1
5	SentTime	送信時刻	24	string		2021-12-08T17:43:09.422Z
6	BusinessDate	日付	10	string	2021-12-08	2021-12-08
7	CycleCode	サイクルコード	5	string	EOD	EOD
8	RunNumber	処理番号	3	string		0:00:00
9	Time	時刻	8	string		17:43:09
10	margin			array		
11	id	オムニバス顧客ID	100	string	A1	A1
12	Currency	通貨	3	string	JPY	JPY
13	CustomerAccountType	カスタマーアカウントタイプ	15	string		HEDGE
14	OmnibusIndicator	オムニバス種別	3	string		YES
15	ParentPortfolioID	親ポートフォリオID	100	string		
16	Memo	メモ	100	string		
17	ClearingFirmID	清算参加者コード	100	string	99999	99999
18	AccountID	取引参加者コード & アカウントコード	100	string	99999CLIENT	99999CLIENT
19	AccountName	アカウント名	100	string		DomesticClientAccount
20	OriginType	オリジンタイプ	10	string		CUSTOMER
21	FundSegregationType	ファンド区別タイプ	10	string		
22	CustomerAccountType2	カスタマーアカウントタイプ2	15	string		
23	Silo	サイロ	5	string	IDX	IDX
24	VaRMargin	VaR証拠金額	15	long	648132680	648132680
25	Add_onCharge	証拠金割増額	15	long	6326641	6326641
26	MarginRequirement	証拠金所要額	15	long	654459321	654459321
27	Ref_VaRMarginWithSign	(参考) VaR証拠金額[符号付]	15	long	660785962	660785962
28	Ref_NetOptionValue	(参考) ネット・オプション価値	15	long	-654459321	-654459321
29	VaRRisk	VaR リスク額	15	long	6326641	6326641

※リクエストIDなどの各項目については、ポジションデータにおいてユーザが入力した場合、当該入力内容を入力します。