

[参考訳]

OPENGAMMA

ユーザガイド

JSCC VaR証拠金 Web 試算ツール

JPX-OpenGamma共同事業

2024年3月

JSCCは、2023年11月6日予定のVaR証拠金稼働に際し参加者や投資家に対し上場デリバティブのVaR証拠金計算を行うウェブベースのツールを提供するべく、証拠金データ複製の独立した専門業者であるOpenGammaとパートナーシップを組みました。

プラットフォームアクセス

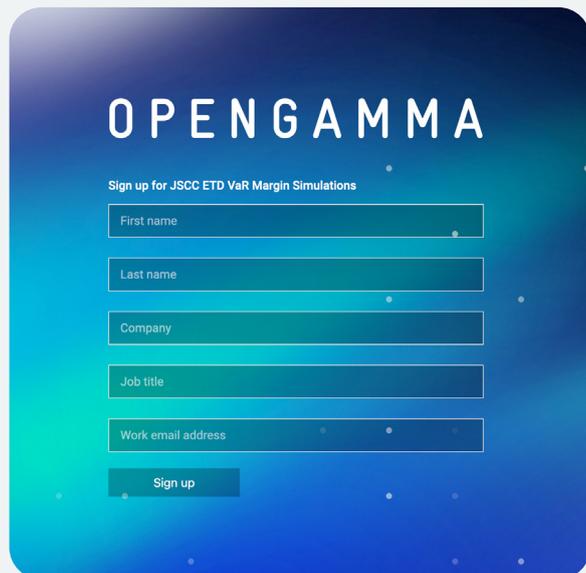
登録方法

- 過去に公開したSPANとVaRの証拠金比較用の試算環境でサインアップ済みの方(メールアドレス)はサインアップ不要ですので、後述のツールへのアクセスに進んでください。

- 今回初めてご利用される方は以下のURLからのユーザ登録を行ってください。

<https://login.opengamma.com/jscs-sign-up>

- ユーザ情報を入力してアクセスを開始します。(未登録のemailドメインの場合は設定に数日かかります。)

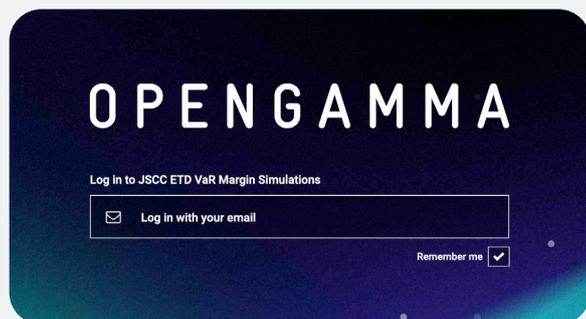


The screenshot shows the sign-up page for JSCC ETD VaR Margin Simulations. The page features the OpenGamma logo at the top, followed by the text "Sign up for JSCC ETD VaR Margin Simulations". Below this, there are five input fields: "First name", "Last name", "Company", "Job title", and "Work email address". A "Sign up" button is located at the bottom right of the form.

ツールへのアクセス

- JSCCのHPのリンク、または<https://j28.analytics.opengamma.com>からログイン画面を開いてください

- 認証(magic link方式)のために登録email アドレスを入力します。



The screenshot shows the login page for JSCC ETD VaR Margin Simulations. The page features the OpenGamma logo at the top, followed by the text "Log In to JSCC ETD VaR Margin Simulations". Below this, there is a single input field with an envelope icon and the text "Log in with your email". A "Remember me" checkbox is located at the bottom right of the form.

機能

● UI概要 (スクリーンショット上)

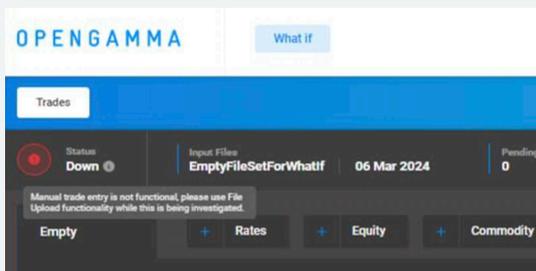
● UI概要 (スクリーンショット上)

- Status

- サービスステータスの表示(「Live状態においては試算が可能です」)

- Live - 正常に動作している状態

- Down - 何らかの異常が起きている状態。右側にある灰色のiマークにカーソルを合わせると、詳細が表示されます。



- Market Data マーケットデータ

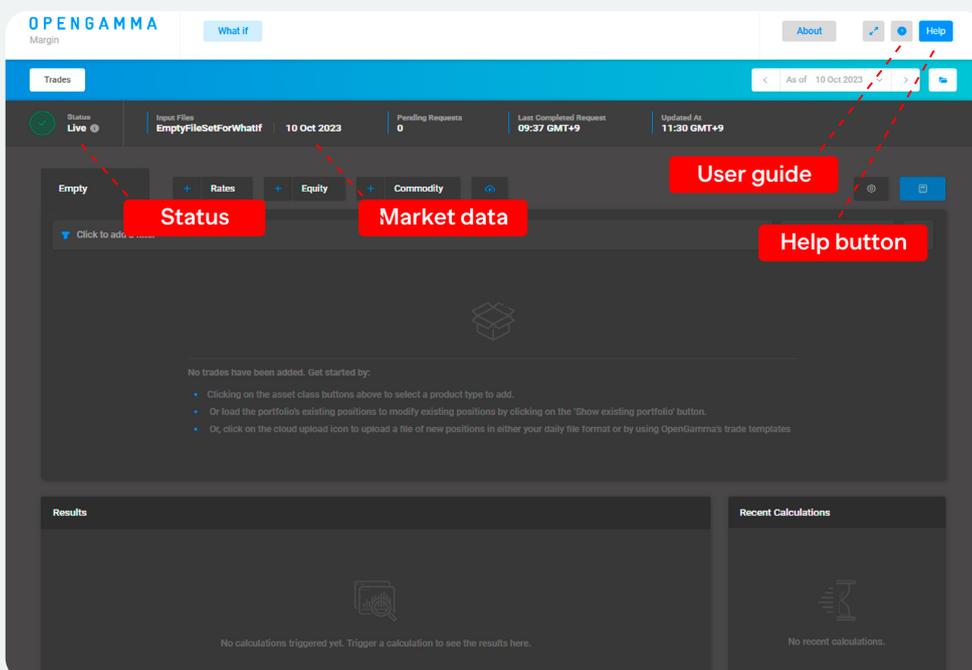
- 試算対象の日付(変更できません)

- User Guide ユーザガイド

- 画面右肩の「?」アイコンをクリックすると、ユーザガイドをダウンロードできます。

- Help Button ヘルプボタン

- 画面右肩の「Help」アイコンをクリックすると、サポートチームへのお問い合わせ画面が表示されます。



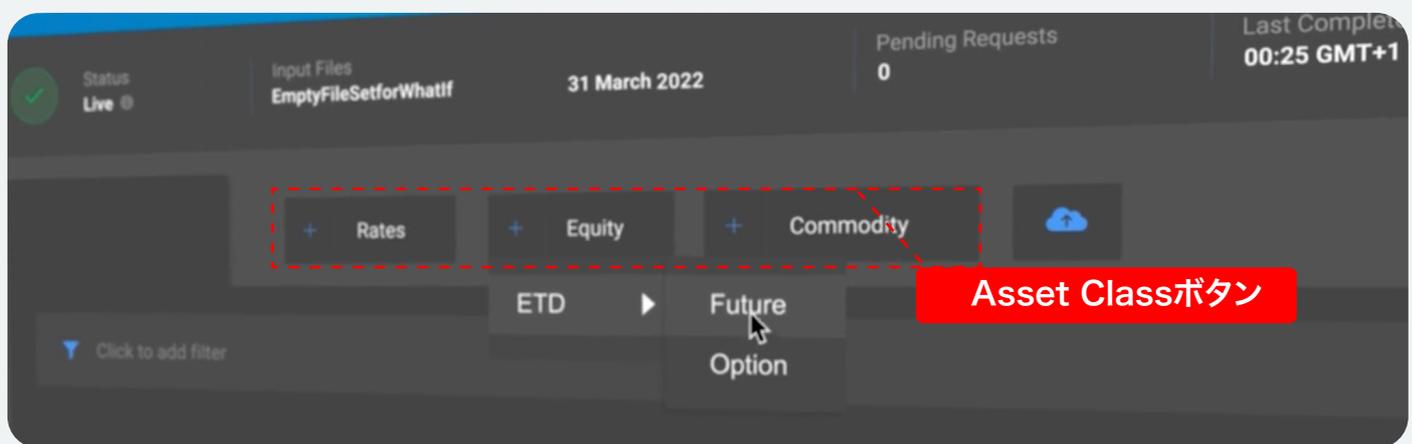
- 証拠金の試算方法

注：ツールがサポートするのは単一口座の試算のみです。

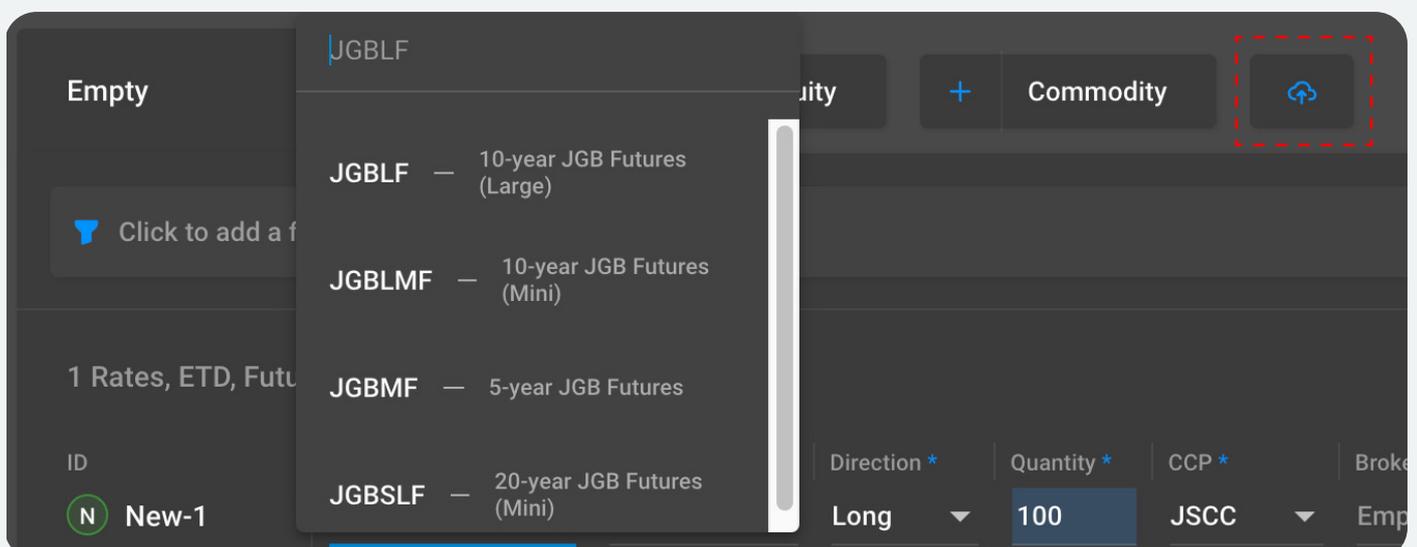
Asset classesボタンからポジション情報を手入力又はポジションCSVファイルをアップロードすることで試算対象ポジションを入力できます。

1. 手入力によるポジションの設定

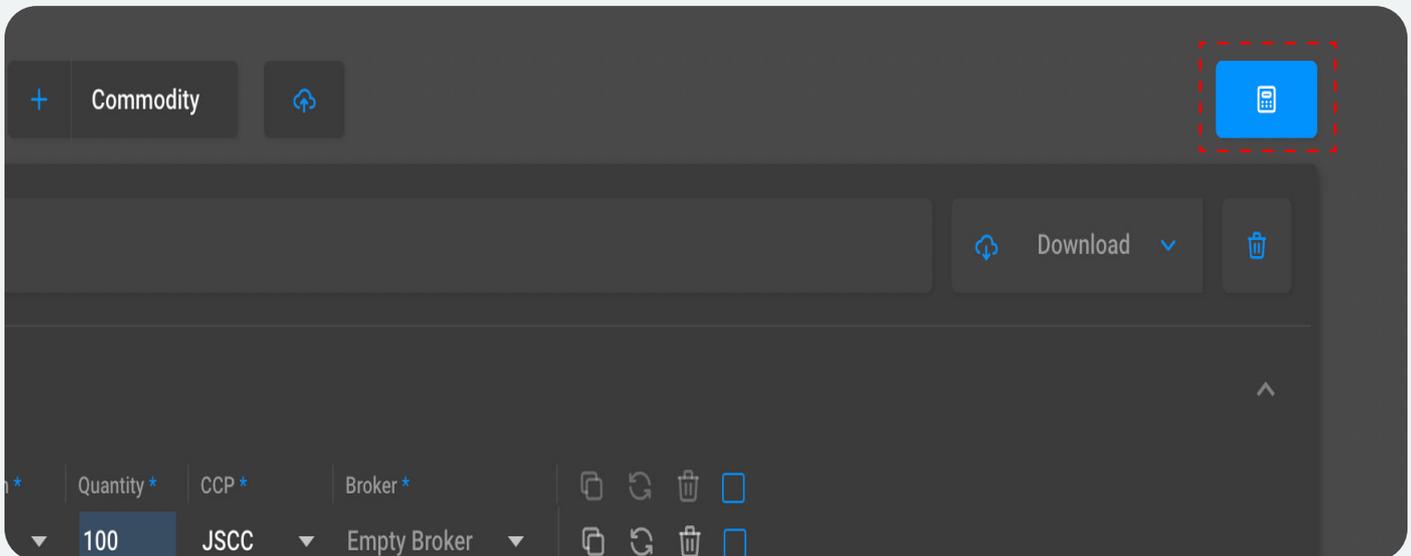
- Asset Class ボタンを押下すると表示されるドロップダウンから銘柄を選択します



- 対象銘柄
 - JSCCが清算する全上場先物・オプション
- 銘柄の説明
 - 商品コードまたは銘柄説明内容での検索が可能です



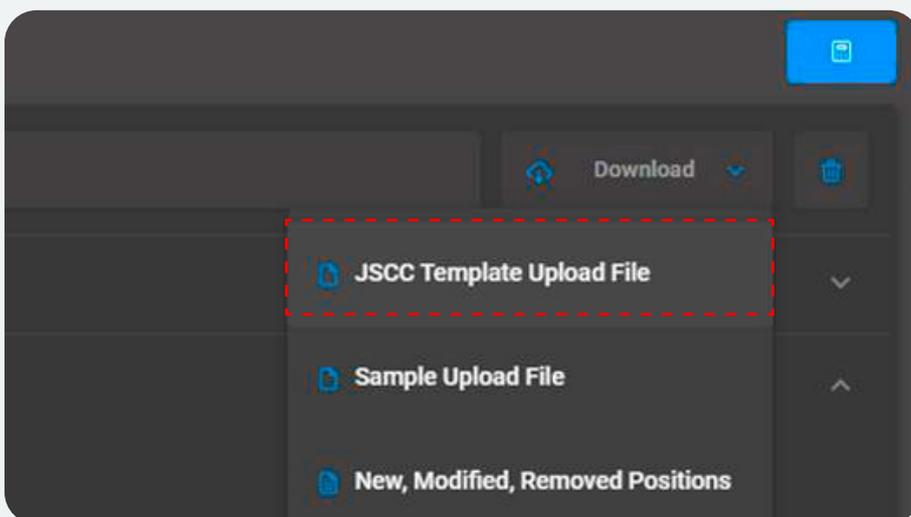
- 銘柄の限月、方向(売り・買い)及び建玉数量のフィールドをすべて入力する必要があります
- 複数銘柄を保有する場合には、上述の手順を繰り返し実施し、必要な銘柄情報の登録が終わりましたら、右上の計算アイコン を押下します



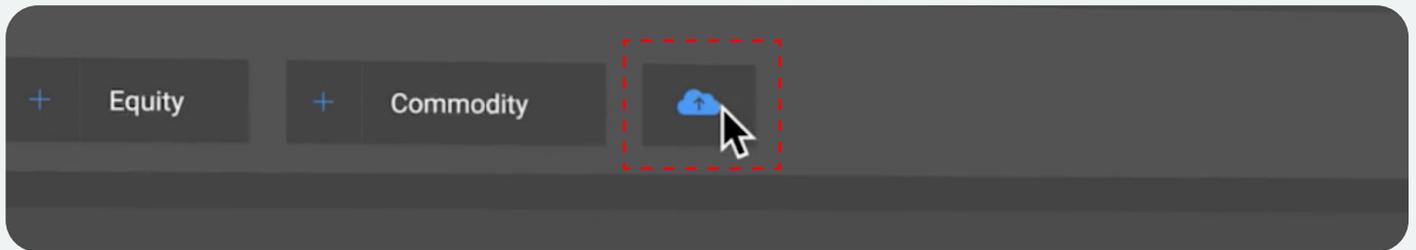
- 計算結果がResult パネルに表示されます。

2. csvファイルでポートフォリオをアップロード

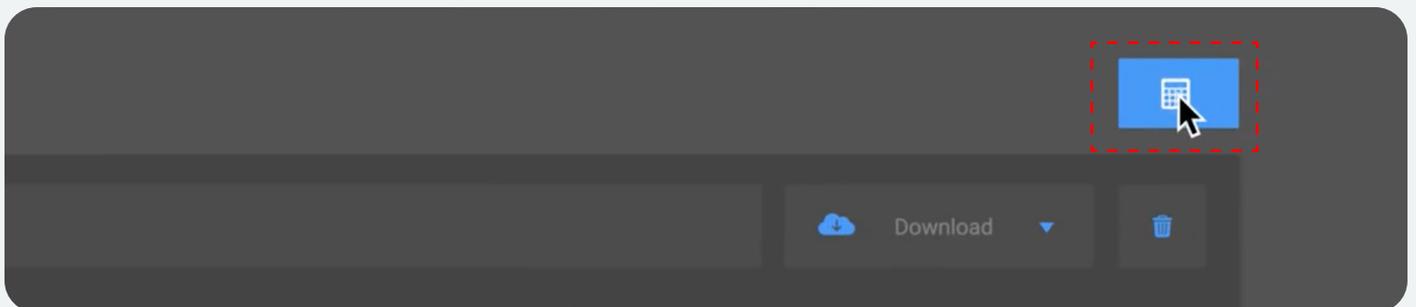
- アップロードに用いるテンプレートを取得するため、Download からファイル(JSCC Template Upload) をダウンロードします



- 試算対象のポジションをcsv ファイルに入力します。不要な行を削除し、また必要に応じて編集を行います(詳細なアップロードファイルの仕様は巻末に掲載しております)
- ポジションファイルに保存するデータは8,000行を超えないようにしてください。
- アップロード用のアイコンをクリックし、先ほど作成したポジションファイルをアップロードします



- アップロードしたポジションがUI上に表示されます
- 計算アイコンを押下します



- 別のポジションファイルをアップロードするには、最初にごみ箱アイコンをクリックし、「Clear all trade entries?」に対して「Yes」をクリックします



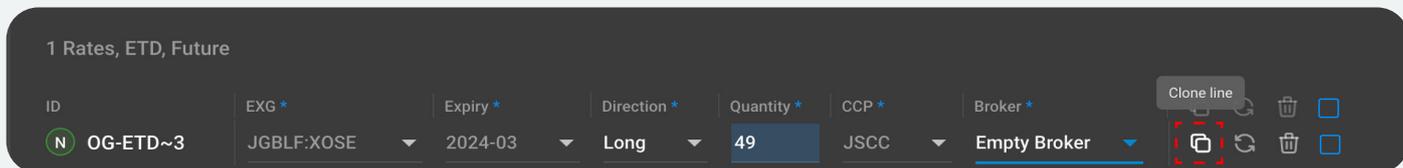
3. 計算結果

- CCP Breakdown(Results パネル下部に表示)
 - JSCCの左側の">"をクリックすると、証拠金の内訳が表示されます。
 - 雲のアイコンをクリックすると、csvファイルでダウンロードすることもできます。

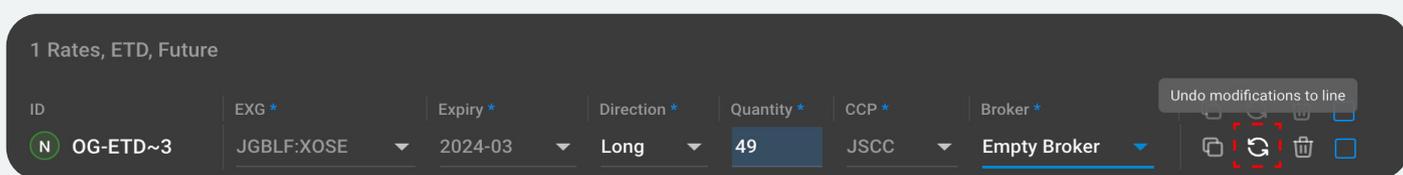
CCP	Before	After	Incremental
▼ JSCC	¥0.00	¥109,181,670,021.00	¥109,181,670,021.00
▼ Broker	¥0.00	¥109,181,670,021.00	¥109,181,670,021.00
▼ V&B Desk	¥0.00	¥0.00	¥0.00

ポジション入力に関する追加機能

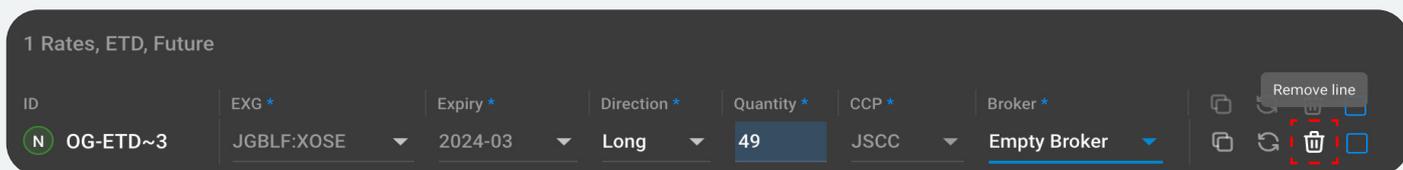
- 「Clone Line」から、入力済みポジションの行ごとでのコピーが可能です



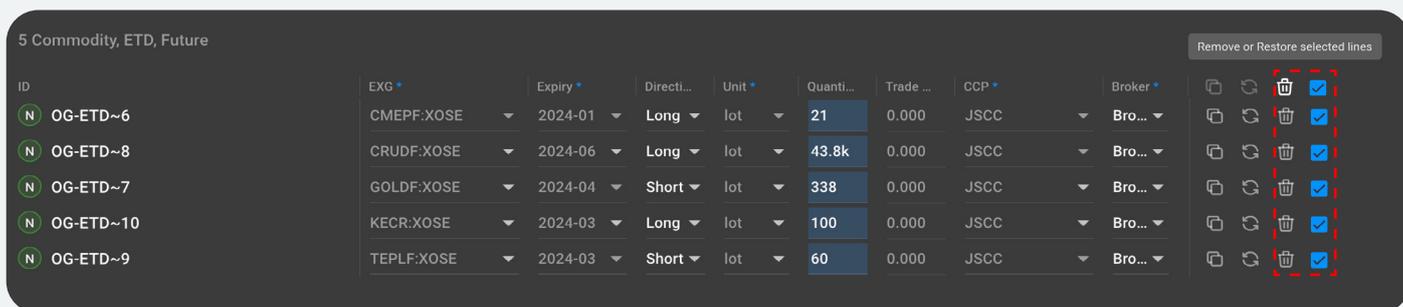
- 「Undo」から、行に対して行った操作の取り消しが可能です



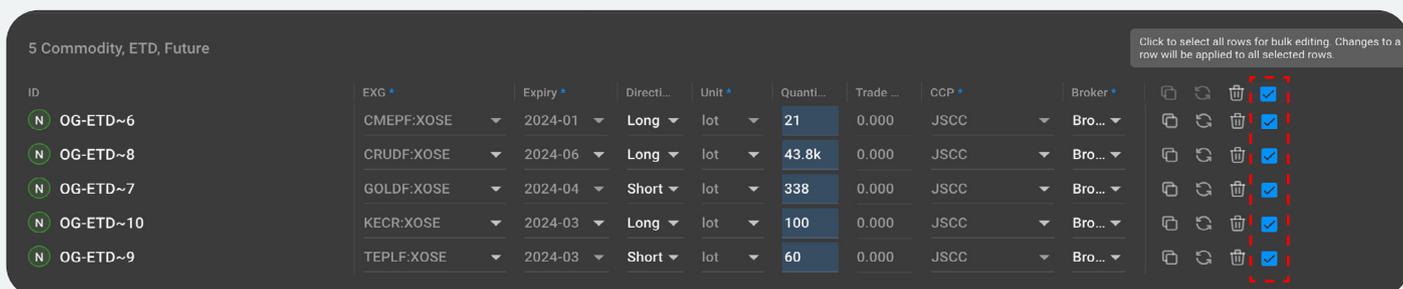
- 「Removal Line」から、選択した行ごとの削除が可能です



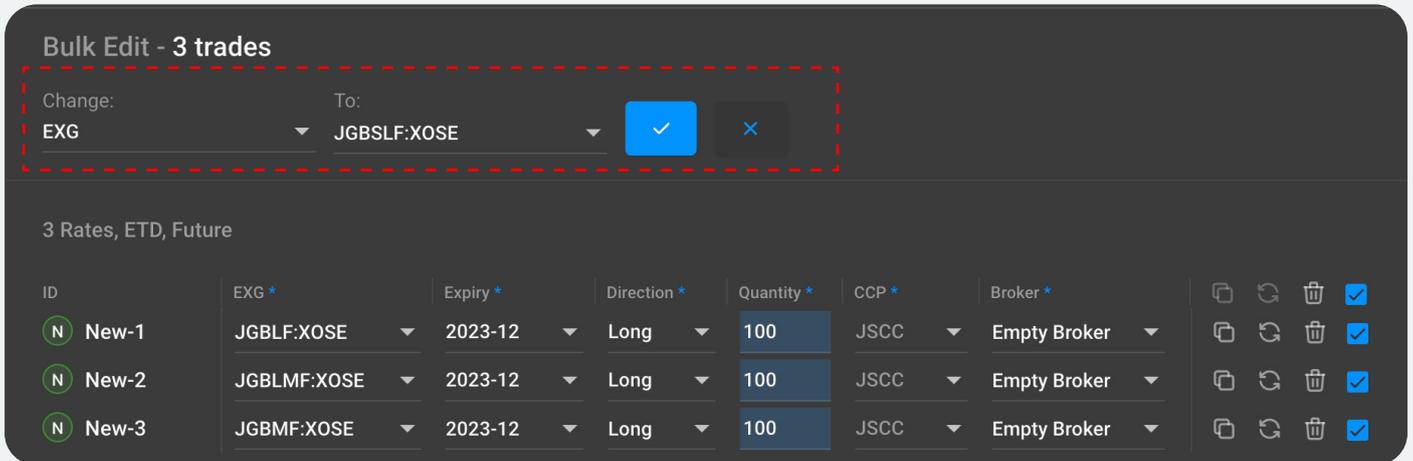
- 選択した行を、一括削除することが可能です。



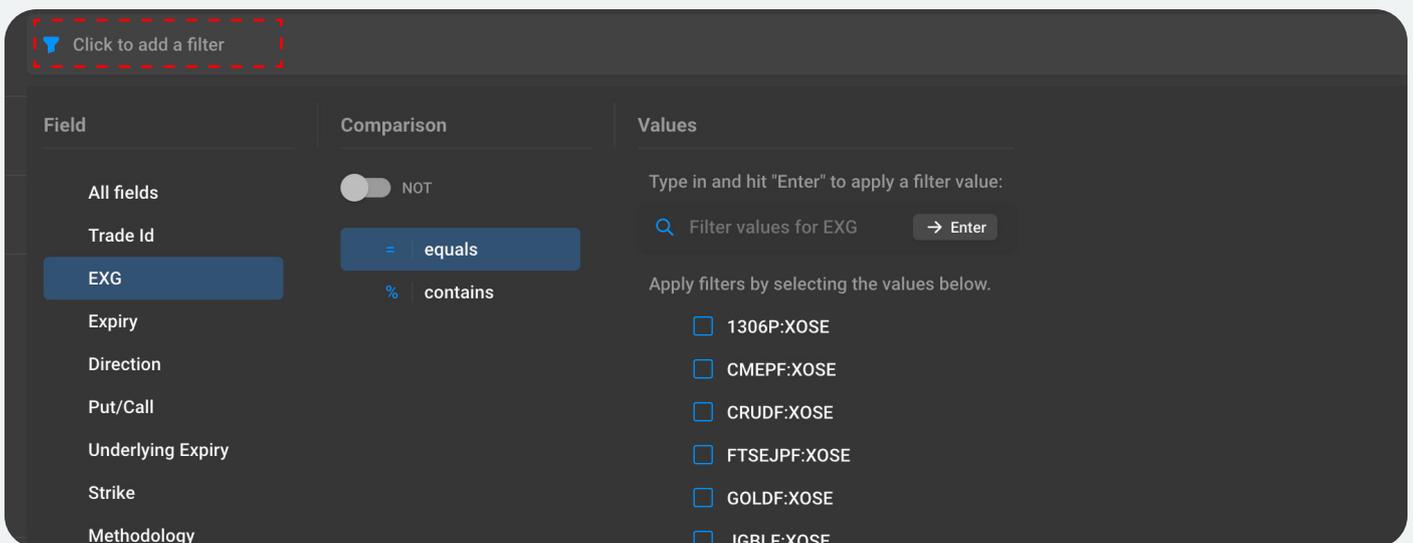
- 選択した行にチェックを入れることで「Bulk Edit」パネルが表示されます



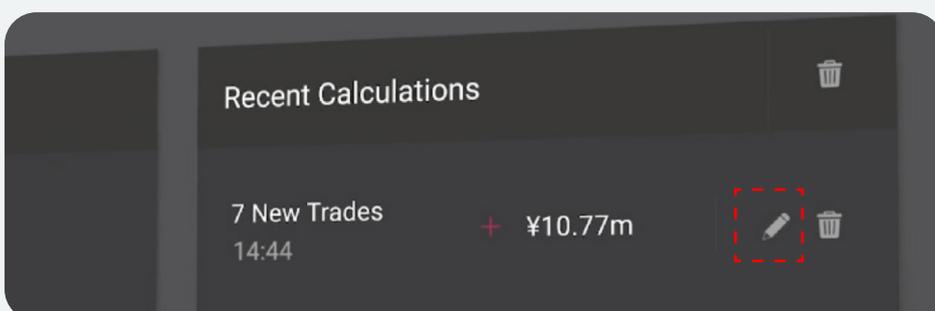
- Bulk Editパネルの「Change」で選択した内容をチェックを入れた行に対し、一括で変更することが可能



- フィルター機能を使うと、指定したフィールド(限月、満期など)の条件が合致する行のみを表示することが可能です



- Recent Calculationsパネル
 - 直近のログインセッションの間に行った試算結果を確認することが可能です
 - 各試算結果は「Rename Calculation」から名前を付けることが可能です



ポジションファイル仕様書

ポジションファイルは以下のようなCSVファイルフォーマットで表されます。

Clearing Member	Trading Participant	Account	Type	Product Group	Product Code	Product Type	Option Type	ContractMonth (Future)	ContractMonth (Option)	Strike Price	Short Quantity	Long Quantity
n/a	n/a	n/a	n/a	NK225	NK225E	OOP	Put	202812	202812	28000	0	50
n/a	n/a	n/a	n/a	NK225	NK225F	FUT		202503			54700	0

フィールドの定義は以下の通りです。

ヘッダフィールド名	フィールドの説明
Clearing Member	"n/a"を使用(いずれのデータも使用されません)
Trading Participant	
Account	
Type	
Product Group	商品グループ。例: JGBL, NK225, TOPIX
Product Code	商品コード。例 JGBLF, NK225F, TOPIXE
Product Type	FUT、OOP、またはOOF
Option Type	Put、Call、または先物の場合は空白
Contract Month (Future)	[ContractPeriodCode] 限月コードYYYYMM(先物・オプション)、YYYYMMDD(フレックス先物・フレックスオプション)、YYYYMMW(日経225 Weekly オプション)
Contract Month (Option)	[UnderlyingPeriodCode]先物については空白 オプション限月コードYYYYMM (フレックスオプションはYYYYMMDD、日経225 Weekly オプションはYYYYMMW、JGB先物オプションは先物限月コード)
Strike Price	オプション権利行使価格。先物の場合は入力なし
Short Quantity	売数量
Long Quantity	買数量

Web試算環境についての補足情報

OpenGammaについて

- OpenGammaは証拠金分析・管理のサービスを提供している会社です
- ご興味のある方はinfo@opengamma.com へご連絡ください

情報セキュリティ

- システム上で試算結果の保存は行われません
- SOC II, E&Y 認証データセキュリティ基準に準拠しています

サービスの提供体制

- 24時間、週7日間ご利用になれます
- ウェブページを閉じればログオフします

テクニカルサポート

- 最新版のウェブブラウザが使用可能ですが、Google Chrome の使用を推奨しています
- OpenGamma のサポートを受けるには画面右肩のヘルプボタンをご利用ください。(英語のみ)
- 本環境へのアクセス権、ユーザー登録の削除をご希望の場合は、OpenGammaへご連絡ください

入力したemailアドレスに届いたmagic linkからWEB試算環境へアクセスできない場合は以下をご確認ください。

1. 迷惑メールに分類され、linkがブロックされていませんか？

- linkを押下する前に、当該メールを「迷惑メールではない」と設定してください。
- メールのプロバイダーによっては、迷惑メールと認識されているメールのlinkは機能しなくなります。

2. 最新のログインメールを使っていますか？

- 新しいログインメールが送信されると、それまでに送られたログインメールのlinkは無効になります。

3. ブラウザのキャッシュが残っていませんか？

- ブラウザに保存されているクッキーの影響で、linkからのアクセスが失敗する場合があります。
- その場合、ブラウザのキャッシュをクリアし、再度ログイン画面へemailアドレスを入力するところから、やり直してください。

4. ログインリンクの期限が切れていませんか？

- Linkの有効期限は15分です。
- これを超過している場合、再度ログイン画面へemailアドレスを入力するところから、やり直してください。
- ログインメール受信後、誤って古いメールのlinkを使用しないよう注意してください。

これらの手順で解決しない場合はセキュリティソフトが原因である可能性が高いと考えられます。