

AS-VaRパラメーターファイル仕様書

株式会社日本証券クリアリング機構

2023年3月版

AS-VaRパラメーターファイル仕様書

#(変更歴) 版	日付	項目	項番	概要
	2023/3/17		-	・初版
	2023/4/6		-	・4-2. 証拠金変動率ファイルフォーマット詳細 項目名の軽微な修正

1. ファイル概要

- ・先物・オプション取引のうち、AS-VaR方式により取引証拠金を計算する商品に関する証拠金パラメーター情報を収録します。
※金標準先物取引など、同じ商品グループ内に複数の取引単位を持つ商品が設定されている場合には、原則として、取引単位の大きい商品を基準としたパラメーターを収録します。
- ・ファイル名は以下のとおりです。
AS-VaR_Parameters_YYYYMMDD.csv
※ファイル名に付される“YYYYMMDD”には、ファイルが出力された日時が設定されます。

2. ファイル掲載場所、掲載時刻

- ・JSCCウェブサイト(以下のURL)に掲載します。
<https://www.jpix.co.jp/jscs/datafeed/derivatives/reference/>
- ・原則として毎週最終営業日にパラメーターの見直しを行い、毎週最終営業日の17:00ごろに掲載します。
※新規商品の上場前営業日など、通常より掲載に時間を要する場合がございますが、あらかじめご了承ください。
- ・相場の状況等によりパラメーターの全部又は一部を臨時に見直すこととした場合には、事前に通知のうえ、当日の18:00ごろに見直し結果を掲載します。

3. 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。
- ・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

4. レコード構成、ファイルフォーマット詳細

- ・レイアウト仕様及び項目の詳細は『4-2. AS-VaRパラメーターファイルフォーマット詳細』に記載しています。

免責事項:
株式会社日本証券クリアリング機構(以下「当社」という。)はファイルの作成には万全を期していますが、作成したファイル正確性や完全性を保証するものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、一切の責任を負いません。
また、当社は、本ファイルから得た情報を利用したことにより発生した損害等の一切について責任を負いません。

4-2. AS-VaRパラメーターファイルフォーマット詳細

No	項目名(和名)	項目名(英名)	最大桁数	属性	内容	設定例
1	適用開始日	Effective Date	10	string	適用開始日を「YYYY-MM-DD」形式で入力	2021-12-08
2	取引所コード	Exchange	10	string	上場取引所を表す 「OSE」: 大阪取引所 「TOCOM」: 東京商品取引所 「ODEX」: 堂島取引所	OSE
3	商品グループ群	Combined Commodity Group	15	string	商品グループ群コード。 「BPF及びAPFにおいて使用する商品コード」を参照。	PME
4	商品グループ	Combined Commodity	15	string	商品グループコード。 「BPF及びAPFにおいて使用する商品コード」を参照。	GOLD
5	価格変動リスク	BPL	-	double	価格変動リスク情報を収録する。	240000
6	ボラティリティ変動リスク	VFR	-	double	ボラティリティ変動リスク情報を収録する。 例. 1%の場合、0.01として収録する。	0.0407
7	スプレッド変動リスク	SFR	-	double	スプレッド変動リスク情報を収録する。	9000
8	金利変動リスク	RFR	-	double	金利変動リスク情報を収録する。 例. 1%の場合、0.01として収録する。	0
9	取引乗数	Product Group Contract Size	-	double	対象商品グループの取引乗数情報を収録する。ただし、同じ商品グループ内に複数の取引単位を持つ商品が設定されている場合には、原則として、取引単位の大きい商品を基準としたパラメーターを収録する。	1000
10	第1階層集計グループ	Level1 Aggregation Group	-	string	第1階層のAggregation Groupを表す	PME
11	第1階層商品間建玉調整係数	Level1 Correlation-Price Multiplier	-	double	第1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	1
12	第2階層集計グループ	Level2 Aggregation Group	-	string	第2階層のAggregation Groupを表す	
13	第2階層商品間建玉調整係数	Level2 Correlation-Price Multiplier	-	double	第2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	
14	第3階層集計グループ	Level3 Aggregation Group	-	string	第3階層のAggregation Groupを表す	
15	第3階層商品間建玉調整係数	Level3 Correlation-Price Multiplier	-	double	第3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	
16	第4階層集計グループ	Level4 Aggregation Group	-	string	第4階層のAggregation Groupを表す	
17	第4階層商品間建玉調整係数	Level4 Correlation-Price Multiplier	-	double	第4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	
18	第5階層集計グループ	Level5 Aggregation Group	-	string	予備項目	
19	第5階層商品間建玉調整係数	Level5 Correlation-Price Multiplier	-	double	予備項目	