

# (参考)証拠金変動率ファイル仕様書

株式会社日本証券クリアリング機構

2023年3月版

証拠金変化率ファイル仕様書

#(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

- ・先物限月取引が設定されている商品グループについて、所定の期間・信頼区間においてどの程度証拠金の変動が見込まれるか、参考情報として提供します。
  - ※HS-VaR方式及びAS-VaR方式の両商品含めて収録します。
  - ※日経平均先物取引など、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に変動率を算出します。
  - ※新規上場商品など、サンプル数が少ない商品については変動率が急変するなどの場合がありますので、特にご留意ください。
  - ※日経平均トータルリターン・インデックス先物取引など、通常限月取引の設定がない商品グループについては収録の対象外となります。
  - ※有価証券オプション取引など、オプション取引のみ設定される商品グループについては収録の対象外となります。
  - ※先物取引に係る証拠金の変動率情報を収録しておりますので、オプション取引に係る証拠金の変動率についてはご確認いただけません。
- ・ファイル名は以下のとおりです。
  - IM\_Fluctuation\_yyyymmdd.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。

## 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.jpx.co.jp/jscc/datafeed/derivatives/reference/>
- ・原則、毎月の月初第1営業日の夕方(19:00頃まで)に掲載します。

## 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. 証拠金変動率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. 証拠金変動率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	適用時点	As of	10	string	適用の基準日を「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。	IDX
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。	NK225
5	備考	Remarks	100	string	電力先物の場合、季節情報を収録する。 「Spring」: 4月～6月期 「Summer」: 7月～9月期 「Autumn」: 10月～12月期 「Winter」: 1月～3月期	
6	参照期間開始日	Observation period from	10	string	変動率情報の計測期間の開始日を「YYYY-MM-DD」形式で入力	2021-12-08
7	参照期間終了日	Observation period to	10	string	変動率情報の計測期間の終了日を「YYYY-MM-DD」形式で入力	2021-12-08
8	相対限月番号	Relative Contract Series	100	int	対象商品の相対限月番号を示す(例. 1の場合、直近限月。6の場合、第6限月)。 ただし、電力先物の場合は内容欄に記載の季節における相対限月番号を示す(例. Summerで2の場合、8月)。	1
9	変動率区間	Interval	100	string	n日間(取引日ベース)における変動率情報を示す。 「1D」: 1日間 「2D」: 2日間 「5D」: 5日間 「10D」: 10日間	1D
10	信頼区間	Confidence Level	-	double	信頼区間別に表示。 「0.68」: 68% 「0.95」: 95% 「0.99」: 99% 「1」: 100%	0.99
11	売り	Short	-	double	売り方向の証拠金の変動率。10%なら0.1として収録する。	0.0954
12	買い	Long	-	double	買い方向の証拠金の変動率。10%なら0.1として収録する。	0.095

※設定例の場合、日経225先物取引(ラージ)の直近限月取引について、99%の信頼区間における1日間の証拠金額の変動が、売り側は9.54%、買い側は9.5%の範囲に収まっていることを示す。