

# 銘柄別VaR証拠金額ファイル仕様書

株式会社日本証券クリアリング機構

2022年11月版

銘柄別 VaR 証拠金額ファイル仕様書

#(変更歴) 版	日付	項目	項番	概要
	2022/6/24		-	・初版
2022年11月	2022/11/1	3. ファイル形式	-	・ヘッダ行に関する記載を修正しました。

### 1. ファイル概要

- ・日中取引終了時(EOD)に設定されている各銘柄について、1枚売建て又は買建てた場合のVaR証拠金額情報を収録します。  
※VaR証拠金額は、その日のEODのパラメーターファイル(VPF、BPF)を用いて計算した金額となります。

### 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。  
※URLについては後報
- ・毎営業日16:15ごろに掲載します(※ 掲載時刻はBPFの作成状況に応じて日々前後します)。

### 3. ファイル形式

- ・ファイル名は以下のとおりです。  
All-Instruments-VaR\_yyyyymmdd\_1600.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付が設定されます。
- ・データ形式はCSV形式です。
- ・区切り文字はカンマです。
- ・ヘッダ行はダブルクォーテーション区切りです。
- ・文字コードについては以下の通りです。  
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・仕様

No.	項目名	Name of Item	属性 Format	内容 Description	設定例 Example
01	銘柄コード	Instrument Code	string	銘柄を表す新証券コード(9桁コード)	187130018
02	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
03	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
04	商品タイプ	Product Type	string	「Future」: 先物 「Option」: オプション	Option
05	プット/コール	Put/Call	string	「-」: 先物 「Put」: プット 「Call」: コール	Call
06	限月	Contract Month	string	先物については先物限月、オプション(先物オプションも含む。)についてはオプション限月を、以下の形式で収録する。  YYYYMM : フレックス先物・OP、日経225Weeklyオプション以外 YYYYMMDD : フレックス先物・OP YYYYMMW : 日経225Weeklyオプション	202201
07	権利行使価格	Strike Price	string	オプション権利行使価格を入力する。 先物の場合「-」	22000
08	売り1枚証拠金	Margin for 1 Short	Double	売り1枚あたり証拠金	1000
09	買い1枚証拠金	Margin for 1 Long	Double	買い1枚あたり証拠金	0