



# J-GATE

**オルタナティブデータ提供サービス  
J-GATE ITCH ヒストリカル CSV データ  
仕様書**

第 1.0 版

2021 年 9 月

株式会社 JPX総研

当社は本書に含まれる情報の利用に伴って発生した不利益や問題について、誰に対しても何ら責任を負うものではありません。

また、本書の内容は予告なく変更される場合があります。

## 第 1.0 版への変更履歴

項番	変更した日	変更した箇所 (章)	変更内容	備考
1	2021/9/21	-	初版発行	-

## 目次

<b>1</b>	<b>この仕様書について</b>	<b>1</b>
1.1	はじめに	1
<b>2</b>	<b>サービス内容</b>	<b>2</b>
2.1	データ概要	2
<b>3</b>	<b>データセット詳細</b>	<b>2</b>
3.1	ファイル仕様	2
3.1.1	各マルチキャストグループの収録ファイル	3
3.2	カラム一覧	3
3.2.1	ITCH 接続仕様解説書との差分一覧	4
3.3	データ取得における留意点	5

# 1 この仕様書について

## 1.1 はじめに

本書はオルタナティブデータ提供サービスのデータセットの一つである“J-GATE ITCH ヒストリカル CSV データ”の仕様書であり、主として当該データサービスの利用者がデータセットを扱う上で必要となる情報をまとめた資料である。

本書は再配布禁止である。

## 2 サービス内容

### 2.1 データ概要

J-GATE ITCH ヒストリカル CSV データは、J-GATE2.0 システムが稼働していた 2016 年 7 月 19 日～2021 年 9 月 16 日までの期間において ITCH データフィードから配信された相場情報を記録した CSV ファイルである。ただし、OSE 商品先物オプションは、2020 年 7 月 27 日～2021 年 9 月 16 日までの期間において ITCH データフィードから配信された相場情報を記録した CSV ファイルである。ヒストリカルデータのみ取り扱いとなるため、スポットデータサービスによるオンデマンドでの利用のみ可能とする。

## 3 データセット詳細

### 3.1 ファイル仕様

ファイル名	形式	文字コード	改行コード	区切り文字	ヘッダ有無
srnd-itch_yyyymmdd_A.csv	CSV	UTF-8-	LF	, (カンマ)	*1
srnd-itch_yyyymmdd_B.csv	CSV	UTF-8-	LF	, (カンマ)	*1
srnd-itch_yyyymmdd_C.csv	CSV	UTF-8-	LF	, (カンマ)	*1
srnd-itch_yyyymmdd_D.csv	CSV	UTF-8-	LF	, (カンマ)	*1
srnd-itch_yyyymmdd_E.csv	CSV	UTF-8-	LF	, (カンマ)	*1

ファイル名の yyyymmdd は、営業日日付がセットされる。営業日とは「J-GATE における営業日」を示し、J-GATE のオンライン開始（当日 6 時のシステム起動時）からオンライン終了（翌日のナイトセッション取引終了）までをいう。当該時間帯に受信した情報を 1 ファイルに収録する。

マルチキャストグループ単位で個別のファイルで提供する。各ファイルが収録するマルチキャストグループについては、3.1.1 各マルチキャストグループの収録ファイルを参照すること。

\*1 ファイルの先頭と末尾に、それぞれ下記のテキストが記載される。

## # ファイル先頭

```
java -cp '/opt/omex/ose/ose/df/cur/bin/*' genium.trading.itch.client.ItchReader binaryfile:///var/data/jpx/ap/store/itch/binary/RC-[1-5].VRD
connectionOpened
onStartOfSession
```

## # ファイル末尾

```
onEndOfSession
connectionLost
```

### 3.1.1 各マルチキャストグループの収録ファイル

マルチキャストグループ	ファイル名	商品
MCG001	srnd-itch_yyyymmdd_A.csv	日経 225 オプション、日経 225 オプション(Weekly)
MCG002	srnd-itch_yyyymmdd_B.csv	有価証券オプション
MCG003	srnd-itch_yyyymmdd_C.csv	JGB 商品
MCG004	srnd-itch_yyyymmdd_D.csv	日経 225 先物、TOPIX 先物、JPX 日経インデックス 400 先物、OSE 商品先物、その他先物、TOPIX オプション、JPX 日経インデックス 400 オプション、OSE 商品先物オプション
MCG005	srnd-itch_yyyymmdd_E.csv	日経 225 ミニ
MCG006	提供対象外	TOCOM 商品先物

## 3.2 カラム一覧

各 ITCH メッセージのデータ項目に従うため、大阪取引所が別途配布する「J-GATE ITCH 接続仕様解説書」を参照すること。

ただし当該仕様書に記載されているデータ項目と本サービスで提供する CSV ファイルの項目に一部差異が存在するため、それらに関しては 3.2.1 ITCH 接続仕様解説書との差分一覧を参照すること。

### 3.2.1 ITCH 接続仕様解説書との差分一覧

項番	メッセージ種別	レコード内容差異	
		ITCH 接続仕様解説書	ITCH ヒストリカル CSV ファイル
1	T (秒タグ)	差異なし	差異なし
2	R (銘柄情報基本タグ)	Timestamp - Nanoseconds: 秒数未満の値 (ミリ秒～ナノ秒まで) のみが入る	Timestamp - Nanoseconds: 日付、時間 (時～ナノ秒) 及びそれを UNIX 時間で表した値が入る 例) 2015-09-01T20:54:19.269189015(1441140859269189015)
3		Symbol: 銘柄名称が左詰め右スペースで設定される	Symbol: 右スペースは Trim されて配信される
4		Long Name: 左詰め右スペースで設定される	Long Name: 右スペースは Trim されて配信される
5	M (銘柄情報基本タグ コンビネーション取引銘柄)	Timestamp - Nanoseconds: 秒数以降、ナノ秒のみが入る	Timestamp - Nanoseconds: 日付、時間 (時～ナノ秒) 及びそれを UNIX 時間で表した値が入る 例) 2015-09-01T20:54:19.269189015(1441140859269189015)
6		Leg Side: 「B」もしくは「C」が入る	Leg Side: 「66」もしくは「67」が入る (「66」が「B」、「67」が「C」を示す)
7	L (呼値単位情報タグ)	Timestamp - Nanoseconds: 秒数以降、ナノ秒のみが入る	Timestamp - Nanoseconds: 日付、時間 (時～ナノ秒) 及びそれを UNIX 時間で表した値が入る 例) 2015-09-01T20:54:19.269189015(1441140859269189015)
8		Order book ID: 銘柄 ID が入る	Order book ID: 銘柄名称 + 銘柄 ID が入る 例) CAL_NK225_1606_16000(7406068)
9	S (システムイベント情報タグ)	Timestamp - Nanoseconds: 秒数以降、ナノ秒のみが入る	Timestamp - Nanoseconds: 日付、時間 (時～ナノ秒) 及びそれを UNIX 時間で表した値が入る 例) 2015-09-01T20:54:19.269189015(1441140859269189015)
10	O (取引ステータス情報タグ)	Timestamp - Nanoseconds: 秒数以降、ナノ秒のみが入る	Timestamp - Nanoseconds: 日付、時間 (時～ナノ秒) 及びそれを UNIX 時間で表した値が入る 例) 2015-09-01T20:54:19.269189015(1441140859269189015)
11		Order book ID: 銘柄 ID が入る	Order book ID: 銘柄名称 + 銘柄 ID が入る 例) CAL_NK225_1606_16000(7406068)
12		State Name: ステータス情報が左詰め右スペースで設定される	State Name: 右スペースは Trim されて配信される
13	A (新規注文タグ)	Timestamp - Nanoseconds: 秒数以降、ナノ秒のみが入る	Timestamp - Nanoseconds: 日付、時間 (時～ナノ秒) 及びそれを UNIX 時間で表した値が入る 例) 2015-09-01T20:54:19.269189015(1441140859269189015)
14		Order book ID: 銘柄 ID が入る	Order book ID: 銘柄名称 + 銘柄 ID が入る 例) CAL_NK225_1606_16000(7406068)



15		Order Id: 16 進法で入る	Order Id: 10 進法で入る
16	E (約定通知タグ)	Timestamp - Nanoseconds: 秒数以降、ナノ秒のみが入る	Timestamp - Nanoseconds: 日付、時間 (時~ナノ秒) 及びそれを UNIX 時間で表した値が入る 例) 2015-09-01T20:54:19.269189015(1441140859269189015)
17		Order book ID: 銘柄 ID が入る	Order book ID: 銘柄名称+銘柄 ID が入る 例) CAL_NK225_1606_16000(7406068)
18		Order Id: 16 進法で入る	Order Id: 10 進法で入る
19	C (価格情報付約定通知タグ)	Timestamp - Nanoseconds: 秒数以降、ナノ秒のみが入る	Timestamp - Nanoseconds: 日付、時間 (時~ナノ秒) 及びそれを UNIX 時間で表した値が入る 例) 2015-09-01T20:54:19.269189015(1441140859269189015)
20		Order book ID: 銘柄 ID が入る	Order book ID: 銘柄名称+銘柄 ID が入る 例) CAL_NK225_1606_16000(7406068)
21		Order Id: 16 進法で入る	Order Id: 10 進法で入る
22	D (削除注文タグ)	Timestamp - Nanoseconds: 秒数以降、ナノ秒のみが入る	Timestamp - Nanoseconds: 日付、時間 (時~ナノ秒) 及びそれを UNIX 時間で表した値が入る 例) 2015-09-01T20:54:19.269189015(1441140859269189015)
23		Order book ID: 銘柄 ID が入る	Order book ID: 銘柄名称+銘柄 ID が入る 例) CAL_NK225_1606_16000(7406068)
24		Order Id: 16 進法で入る	Order Id: 10 進法で入る
25	P (建値通知タグ)	Timestamp - Nanoseconds: 秒数以降、ナノ秒のみが入る	Timestamp - Nanoseconds: 日付、時間 (時~ナノ秒) 及びそれを UNIX 時間で表した値が入る 例) 2015-09-01T20:54:19.269189015(1441140859269189015)
26		Order book ID: 銘柄 ID が入る	Order book ID: 銘柄名称+銘柄 ID が入る 例) CAL_NK225_1606_16000(7406068)
27	Z (EP タグ)	Timestamp - Nanoseconds: 秒数以降、ナノ秒のみが入る	Timestamp - Nanoseconds: 日付、時間 (時~ナノ秒) 及びそれを UNIX 時間で表した値が入る 例) 2015-09-01T20:54:19.269189015(1441140859269189015)
28		Order book ID: 銘柄 ID が入る	Order book ID: 銘柄名称+銘柄 ID が入る 例) CAL_NK225_1606_16000(7406068)

### 3.3 データ取得における留意点

各ファイルにおける収録順序については、必ずしも発生順に収録されない。システムの都合により、以下の収録内容になる場合がある。

- ・9:59:59 に発生したレコードより、10:00:00 に発生したレコードが先に収録。
- ・場中に発生したレコードが、最終レコードに収録。