

SPANリスク・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

株式会社大阪証券取引所

平成 12年 3月作成

平成 20年 4月改訂

SPAN及びPC-SPANは、CME (Chicago Mercantile Exchange) に登録された商標です。この資料における使用は許諾されていますが、CMEは、いかなる者もしくは団体によるSPANの利用について、一切の責任を負いません。なお、当資料の記載内容については、CMEが公表する内容が優先し、これらは予告なしに変更することがありますので、ご注意ください。

SPANリスク・パラメーター・ファイル仕様書

タイプ0レコード 【取引所グループヘッダー】

項目名	英語名称	位置	桁数	属性	内容	設定例(は空白)	
01	レコードID	Record ID	1	2	X(02)	「0」：タイプ0レコード(固定)	0
02	取引所グループ略称	Exchange Complex Acronym	3	6	X(06)	「TSE」：東京証券取引所、「OSE」：大阪証券取引所	OSE
03	営業日付	Business Date	9	8	9(08)	西暦4桁+月2桁+日2桁の形式で指定	20000401
04	ファイル種別	Settlement or Intraday Flag	17	1	X(01)	「S」：取引終了後 「I」：日中(緊急証拠金の時)	S
05	ファイルID	File Identifier	18	2	X(02)	「E」：アーリーファイル 「FC」：確定ファイル	FC
06	営業日時刻	Business Time	20	4	9(04)	時2桁+分2桁の形式で指定	1700
07	ファイル作成日	File Creation Date	24	8	9(08)	西暦4桁+月2桁+日2桁の形式で指定	20000401
08	ファイル作成時刻	File Creation Time	32	4	9(04)	時2桁+分2桁の形式で指定	1822
09	ファイルフォーマット	File Format	36	2	X(02)	「U2」：エクスパンドフォーマット(固定)	U2
10	クロス/ネット証拠金インディケータ	Gross/Net-margining Indicator	38	1	X(01)	「G」：クロス 「N」：ネット	N
11	オプション価値制限フラグ	Overall Limit Option Value Flag	39	1	X(01)	「Y」：採用 「N」：不採用	N
12	予備	Filler	40	11	X(11)	空白	
13	クリアリング/顧客コード	Clearing or Customer Code	51	1	X(01)	「A」：クリアリング 「C」または空白：顧客	
14	予備	Filler	52	1	X(01)	空白	
15	クリアリング/顧客の略称	Clearing or Customer Acronym	53	5	X(05)	「CUST」：顧客 「CLR」または空白：クリアリング	
16	予備	Filler	58	1	X(01)	空白	
17	アカウントタイプコード	Account Type Code	59	1	X(01)	清算会社/顧客コード(項目 13)が「A」(清算会社)の場合 「N」または空白：ノーマル 「M」：メンバー 清算会社/顧客コード(項目 13)が「C」(顧客)の場合 「H」または空白：ヘッジャー 「M」：メンバー 「S」：スペキュレーター	
18	予備	Filler	60	1	X(01)	空白	
19	アカウントタイプの略称	Account Type Acronym	61	5	X(05)	清算会社/顧客コード(項目 13)が「A」(清算会社)の場合 「NRML」または空白：ノーマル 「MBR」：メンバー 清算会社/顧客コード(項目 13)が「C」(顧客)の場合 「HEDGE」または空白：ヘッジャー 「MBR」：メンバー 「SPEC」：スペキュレーター	
20	予備	Filler	66	1	X(01)	空白	

SPANリスク・パラメーター・ファイル仕様書

21	証拠金クラスコード	Performance Bond Class Code	67	1	X(01)	「1」または空白：メイン 「2」 ：予備	
22	予備	Filler	68	1	X(01)	空白	
23	証拠金クラスの略称	Performance Bond Class Acronym	69	5	X(05)	「CORE」または空白：メイン 「RESRV」 ：予備	
24	予備	Filler	74	1	X(01)	空白	
25	当初・維持証拠金コード	Maintenance or Initial Code	75	1	X(01)	「M」または空白：維持証拠金 「I」 ：当初証拠金	
26	予備	Filler	76	1	X(01)	空白	
27	当初・維持証拠金の略称	Maintenance or Initial Acronym	77	5	X(05)	「MAINT」または空白：維持証拠金 「INITI」 ：当初証拠金	
28	予備	Filler	82	51	X(51)	空白	

【備考】

1. クリアリングノ顧客コード(項目No13)以降のフィールドが空白かNULLの場合、またはレコードの最終の空白が切り捨てられて存在しない場合、上記の通りにデフォルト設定を採用する必要があります。

SPANリスク・パラメーター・ファイル仕様書

タイプ1レコード 【取引所ヘッダー】

項目名	英語名称	位置	桁数	属性	内容	設定例(は空白)
01 レコードID	Record ID	1	2	X(02)	「1」：タイプ1レコード(固定)	1
02 取引所略称	Exchange Acronym	3	3	X(03)	「TSE」：東京証券取引所、「OSE」：大阪証券取引所	OSE
03 予備	Filler	6	2	X(02)	空白	
04 取引所コード	Exchange Code	8	2	X(02)	「TS」：東京証券取引所、「OS」：大阪証券取引所	OS
05 予備	Filler	10	123	X(123)	空白	

タイプ2レコード 【第1商品グループレコード】

項目名	英語名称	位置	桁数	属性	内容	設定例(は空白)
01 レコードID	Record ID	1	2	X(02)	「2」：タイプ2レコード(固定)	2
02 取引所略称	Exchange Acronym	3	3	X(03)	「TSE」：東京証券取引所、「OSE」：大阪証券取引所	OSE
03 予備	Filler	6	1	X(01)	空白	
04 商品グループコード	Combined Commodity Code	7	6	X(06)		NK225
05 リスク乗数	Risk Exponent	13	1	9(01)	備考1.参照	1
06 証拠金通貨ISOコード	Performance Bond Currency ISO Code	14	3	X(03)	「JPY」：日本円(固定)	JPY
07 証拠金通貨コード	Performance Bond Currency Code	17	1	X(01)	「Y」：円(固定)	Y
08 オプション証拠金スタイル	Option Margin Style	18	1	X(01)	「P」または空白：プレミアム方式 「F」：先物方式	P
09 オプション価値制限(ネット・オプション価値の上限)フラグ	Limit Option Value (Cap Available Net Option Value) Flag	19	1	X(01)	「Y」：採用 「N」または空白：不採用 備考4.参照	N
10 コンビネーション証拠金算出手順フラグ	Combination Margining Method Flag	20	1	X(01)	「S」：split-allocation 「D」または空白：delta-split-allocation	
11 予備	Filler	21	2	X(02)	空白	
12 商品コード1	Commodity (Product) Code 1	23	10	X(10)		NK225
13 商品タイプ1	Contract Type 1	33	3	X(03)	備考2.参照	PHY
14 予備	Filler	36	3	X(03)	空白	
15 商品コード2	Commodity (Product) Code 2	39	10	X(10)		NK225E
16 商品タイプ2	Contract Type 2	49	3	X(03)	備考2.参照	OOP
17 予備	Filler	52	3	X(03)	空白	
18 商品コード3	Commodity (Product) Code 3	55	10	X(10)		NK225F
19 商品タイプ3	Contract Type 3	65	3	X(03)	備考2.参照	FUT
20 予備	Filler	68	3	X(03)	空白	
21 商品コード4	Commodity (Product) Code 4	71	10	X(10)		
22 商品タイプ4	Contract Type 4	81	3	X(03)	備考2.参照	
23 予備	Filler	84	3	X(03)	空白	
24 商品コード5	Commodity (Product) Code 5	87	10	X(10)		
25 商品タイプ5	Contract Type 5	97	3	X(03)	備考2.参照	
26 予備	Filler	100	3	X(03)	空白	
27 商品コード6	Commodity (Product) Code 6	103	10	X(10)		
28 商品タイプ6	Contract Type 6	113	3	X(03)	備考2.参照	
29 予備	Filler	116	17	X(17)	空白	

【備考】

- リスク乗数(項目 05)は、リスクアレイ値、商品間スプレッド・クレジットレート、売オプション最低証拠金額、プライス・スキャンレンジ、1ネット・デルタ当たりの最終決済証拠金額(消費デルタ)、1ネット・デルタ当たりの最終決済証拠金額(残余デルタ)、商品内スプレッド割増額に適用されます。

SPAN リスク・パラメーター・ファイル仕様書

2. 商品タイプ(項目 13,16,19,22,25,28)には, 以下の内容が設定されます。

「FUT」: 先物(future)

「PHY」: 現物(physical)

「CMB」: コンビネーション(combination)

「OOF」: 先物オプション(option on future)

「OOP」: 現物オプション(option on physical)

「OOC」: コンビネーションオプション(option on combination)

3. 1つのタイプ2レコードで最大6個の商品コードと商品タイプを設定することができます。もし, 7個以上の設定をする場合は, 最初のタイプ2レコードの直後に追加されます。

4. オプション価値制限フラグ(項目 09)が「Y」の場合, ネット・オプション価値に上限が設定されます。

【使用箇所】

・証拠金通貨ISOコード(項目 06) … ネット・オプション価値の計算(2.6章)で使用

タイプ3レコード 【第2商品グループレコード(商品内スプレッド割増額パラメーター)】

項目名	英語名称	位置	桁数	属性	内容	設定例(は空白)
01 レコードID	Record ID	1	2	X(02)	「3」：タイプ3レコード(固定)	3
02 商品グループコード	Combined Commodity Code	3	6	X(06)		NK225
03 商品内スプレッド割増額の計算手順コード	Intracommodity (Intermonth) Spread Charge Method Code	9	2	X(02)	「01」：商品内スプレッド割増額の設定なし 「10」：テーブル制御方式 備考 参照	10
04 ティア1番号	Tier 1 Tier Number	11	2	9(02)		01
05 ティア1の開始月	Tier 1 Starting Contract Month	13	6	9(06)	西暦4桁 + 月2桁の形式で指定	200001
06 ティア1の終了月	Tier 1 Ending Contract Month	19	6	9(06)	西暦4桁 + 月2桁の形式で指定	200312
07 ティア2番号	Tier 2 Tier Number	25	2	9(02)		
08 ティア2の開始月	Tier 2 Starting Contract Month	27	6	9(06)	西暦4桁 + 月2桁の形式で指定	
09 ティア2の終了月	Tier 2 Ending Contract Month	33	6	9(06)	西暦4桁 + 月2桁の形式で指定	
10 ティア3番号	Tier 3 Tier Number	39	2	9(02)		
11 ティア3の開始月	Tier 3 Starting Contract Month	41	6	9(06)	西暦4桁 + 月2桁の形式で指定	
12 ティア3の終了月	Tier 3 Ending Contract Month	47	6	9(06)	西暦4桁 + 月2桁の形式で指定	
13 ティア4番号	Tier 4 Tier Number	53	2	9(02)		
14 ティア4の開始月	Tier 4 Starting Contract Month	55	6	9(06)	西暦4桁 + 月2桁の形式で指定	
15 ティア4の終了月	Tier 4 Ending Contract Month	61	6	9(06)	西暦4桁 + 月2桁の形式で指定	
16 予備	Filler	67	2	X(02)	空白	
17 当初/維持証拠金比率(メンバーアカウント)	Initial to Maintenance Ratio - Member Account	69	4	9(1)V9(3)	整数1桁 + 小数点以下3桁で指定	1000
18 当初/維持証拠金比率(ヘッジャーアカウント)	Initial to Maintenance Ratio - Headger Account	73	4	9(1)V9(3)	整数1桁 + 小数点以下3桁で指定	1000
19 当初/維持証拠金比率 (スペキュレーターアカウント)	Initial to Maintenance Ratio - Speculator Account	77	4	9(1)V9(3)	整数1桁 + 小数点以下3桁で指定	1000
20 予備	Filler	81	52	X(52)	空白	

【備考】

- 商品内スプレッド割増額の計算手順コード(項目 03)が「01」の場合、この商品グループの商品内スプレッド割増額はありません。
- 商品内スプレッド割増額の計算手順コード(項目 03)が「10」の場合、1レコードに4つの商品内スプレッドティアを設定することができます。
1つの商品グループに5つ以上のティアを設定する場合は、最初のタイプ3レコードの直後に追加されます。

【使用箇所】

- ティア番号(項目 04,07,10,13) … 商品内スプレッド割増額の計算(2.4.2章)で使用
- ティアの開始月(項目 05,08,11,14) … 商品内スプレッド割増額の計算(2.4.2章)で使用
- ティアの終了月(項目 06,09,12,15) … 商品内スプレッド割増額の計算(2.4.2章)で使用
- 当初/維持証拠金比率(項目 17,18,19) … 証拠金所要額の計算(2.8章)で使用

SPANリスク・パラメーター・ファイル仕様書

タイプ4レコード 【第3商品グループレコード(最終決済証拠金パラメーター)】

項目名	英語名称	位置	桁数	属性	内容	設定例(は空白)
01 レコードID	Record ID	1	2	X(02)	「4」: タイプ4レコード(固定)	4
02 商品グループコード	Combined Commodity Code	3	6	X(06)		NK225
03 最終決済証拠金額の計算手順コード	Delivery (Spot) Charge Method Code	9	2	X(02)	「01」: 最終決済証拠金額なし 「10」: テーブル駆動方式 「11」: ベーシスリスク方式 備考1.参照	01

項目 03が「01」または「10」の場合

04 最終決済証拠金額の対象限月数	Number of contract months in delivery	11	2	9(02)		
05 最終決済証拠金額対象限月1の限月番号	Delivery Month1 - Month Number	13	2	9(02)		
06 対象限月1の限月	Delivery Month1 - Contract Month	15	6	9(06)	西暦4桁 + 月2桁の形式で指定	
07 対象限月1の1ネット・デルタ当たりの最終決済証拠金額(消費デルタ)	Delivery Month1 - Charge Rate Per Delta Consumed By Spreads	21	7	9(07)		
08 対象限月1の1ネット・デルタ当たりの最終決済証拠金額(残余デルタ)	Delivery Month1 - Charge Rate Per Delta Remaining In Outrights	28	7	9(07)		
09 最終決済証拠金額対象限月2の限月番号	Delivery Month2 - Month Number	35	2	9(02)		
10 対象限月2の限月	Delivery Month2 - Contract Month	37	6	9(06)	西暦4桁 + 月2桁の形式で指定	
11 対象限月2の1ネット・デルタ当たりの最終決済証拠金額(消費デルタ)	Delivery Month2 - Charge Rate Per Delta Consumed By Spreads	43	7	9(07)		
12 対象限月2の1ネット・デルタ当たりの最終決済証拠金額(残余デルタ)	Delivery Month2 - Charge Rate Per Delta Remaining In Outrights	50	7	9(07)		
13 予備	Filler	57	6	9(06)		

項目 03が「11」の場合

04 現渡商品コード	Spot commodity (Product) Code	11	10	X(10)	項目 03が「11」の場合のみ使用	
05 ベーシスリスクチャージレート	Basis Risk Charge Rate	21	7	9(07)	項目 03が「11」の場合のみ使用	
06 予備	Filler	28	35	X(35)	項目 03が「11」の場合のみ使用	
14 売オプション1単位当たりの最低証拠金額	Short Option Minimum Charge Rate	63	7	9(07)		0000080
15 維持証拠金調整係数(メンバー用)	Risk Maintenance Performance Bond Adjustment Factor - Members	70	3	9(1)V9(2)	整数1桁 + 小数点以下2桁で指定 備考2.参照	100
16 維持証拠金調整係数(ヘッジャー用)	Risk Maintenance Performance Bond Adjustment Factor - Hedgers	73	3	9(1)V9(2)	整数1桁 + 小数点以下2桁で指定 備考2.参照	100
17 維持証拠金調整係数(スプレッダー用)	Risk Maintenance Performance Bond Adjustment Factor -	76	3	9(1)V9(2)	整数1桁 + 小数点以下2桁で指定 備考2.参照	100
18 売オプション最低証拠金額計算方法	Short Option Minimum Calculation Method	79	1	X(01)	備考3.参照	2
19 予備	Filler	80	53	X(53)	空白	

SPANリスク・パラメーター・ファイル仕様書

【備考】

1. 最終決済証拠金額の計算手順コード(項目 03)が「10」の場合、1レコードに2つの対象限月を設定することができます。
1つの商品グループに3つ以上の対象限月がある場合は、最初のタイプ4レコードの直後に追加されます。
2. 維持証拠金調整係数(項目 15,16,17)が「0」または「空白」の場合、デフォルト値の「100」となります。
3. 売オプション最低証拠金額計算方法(項目 18)は、売オプション最低証拠金額の計算の対象となる売オプションの建玉数を決定する方法です。
「1」はコールとプットの建玉数の多い方、「2」はコールとプットの建玉数合計を使用します。

【使用箇所】

- | | |
|---|----------------------------|
| ・1ネット・デルタ当たりの最終決済証拠金額(消費デルタ) (項目 07,11) | … 最終決済証拠金額の計算(2.4.3章)で使用 |
| ・1ネット・デルタ当たりの最終決済証拠金額(残余デルタ) (項目 08,12) | … 最終決済証拠金額の計算(2.4.3章)で使用 |
| ・売オプション1単位当たりの最低証拠金額(項目 14) | … 売オプション最低証拠金額の計算(2.7章)で使用 |
| ・維持証拠金調整係数(項目 15,16,17) | … 証拠金所要額の計算(2.8章)で使用 |
| ・売オプション最低証拠金額計算方法(項目 18) | … 売オプション最低証拠金額の計算(2.7章)で使用 |

タイプ5レコード 【商品グループレコード】

項目名	英語名称	位置	桁数	属性	内容	設定例(は空白)
01 レコードID	Record ID	1	2	X(02)	「5」：タイプ5レコード(固定)	5
02 商品グループ群コード	Combined Commodity Group Code	3	3	X(03)	「IDX」：株価指数 「EQU」：株式	IDX
03 予備	Filler	6	7	X(07)	空白	
04 商品グループコード1	Combined Commodity Code1	13	6	X(06)		NK225
05 商品グループコード2	Combined Commodity Code2	19	6	X(06)		NK300
06 商品グループコード3	Combined Commodity Code3	25	6	X(06)		
07 商品グループコード4	Combined Commodity Code4	31	6	X(06)		
08 商品グループコード5	Combined Commodity Code5	37	6	X(06)		
09 商品グループコード6	Combined Commodity Code6	43	6	X(06)		
10 商品グループコード7	Combined Commodity Code7	49	6	X(06)		
11 商品グループコード8	Combined Commodity Code8	55	6	X(06)		
12 商品グループコード9	Combined Commodity Code9	61	6	X(06)		
13 商品グループコード10	Combined Commodity Code10	67	6	X(06)		
14 予備	Filler	73	60	X(60)	空白	

【備考】

- 1つのタイプ5レコードで最大10個の商品グループコードを設定することができます。もし、11個以上の商品グループコードを設定する場合は、最初のタイプ5レコードの直後に追加されます。

SPANリスク・パラメーター・ファイル仕様書

タイプ6レコード 【商品間スプレッドレコード】

項目名	英語名称	位置	桁数	属性	内容	設定例(は空白)
01 レコードID	Record ID	1	2	X(02)	「6」:タイプ6レコード(固定)	6
02 商品グループ群コード	Commodity Group Code	3	3	X(03)	「IDX」: 株価指数 「EQU」: 株式	IDX
03 スプレッド優先順位	Spread Priority	6	4	9(04)		0001
04 商品間スプレッド・クレジットレート	Spread Credit Rate, in Percent	10	7	9(3)V9(4)	整数3桁 + 小数点以下4桁で指定	0820000
05 レグ1の取引所略称	Exchange Acronym Leg1	17	3	X(03)	「TSE」: 東京証券取引所、「OSE」: 大阪証券取引所	OSE
06 予備	Filler	20	1	X(01)	空白	
07 レグ1の商品グループコード	Combined Commodity Code Leg1	21	6	X(06)		NK225
08 レグ1の商品間デルタ/スプレッド比率	Delta Per Spread Ratio Leg1	27	7	9(3)V9(4)	整数3桁 + 小数点以下4桁で指定	0010000
09 レグ1のマーケットサイド・インディケータ	Spread Side Leg1	34	1	X(01)	「A」または「B」を指定	A
10 レグ2の取引所略称	Exchange Acronym Leg2	35	3	X(03)		OSE
11 予備	Filler	38	1	X(01)	空白	
12 レグ2の商品グループコード	Combined Commodity Code Leg2	39	6	X(06)		NK300
13 レグ2の商品間デルタ/スプレッド比率	Delta Per Spread Ratio Leg2	45	7	9(3)V9(4)	整数3桁 + 小数点以下4桁で指定	0010000
14 レグ2のマーケットサイド・インディケータ	Spread Side Leg2	52	1	X(01)	「A」または「B」を指定	B
15 レグ3の取引所略称	Exchange Acronym Leg3	53	3	X(03)		
16 予備	Filler	56	1	X(01)	空白	
17 レグ3の商品グループコード	Combined Commodity Code Leg3	57	6	X(06)		
18 レグ3の商品間デルタ/スプレッド比率	Delta Per Spread Ratio Leg3	63	7	9(3)V9(4)	整数3桁 + 小数点以下4桁で指定	
19 レグ3のマーケットサイド・インディケータ	Spread Side Leg3	70	1	X(01)	「A」または「B」を指定	
20 レグ4の取引所略称	Exchange Acronym Leg4	71	3	X(03)		
21 予備	Filler	74	1	X(01)	空白	
22 レグ4の商品グループコード	Combined Commodity Code Leg4	75	6	X(06)		
23 レグ4の商品間デルタ/スプレッド比率	Delta Per Spread Ratio Leg4	81	7	9(3)V9(4)	整数3桁 + 小数点以下4桁で指定	
24 レグ4のマーケットサイド・インディケータ	Spread Side Leg4	88	1	X(01)	「A」または「B」を指定	
25 商品間スプレッド割引額の手順コード	Intercommodity Spread Method Code	89	2	9(02)	「01」: ティアを使用しない 「20」: ティア使用	01
26 商品間スプレッド割引額の手順4の 対象取引所略称	Method4:Target Exchange Acronym	91	3	X(03)		
27 予備	Filler	94	1	X(01)	空白	
28 商品間スプレッド割引額の手順4の 対象商品グループコード	Method4:Target Combined Commodity Code	95	6	X(06)		
29 予備	Filler	101	1	X(01)	空白	
30 レグ1のティア番号	Tier Number Leg1	102	2	9(02)		00
31 レグ2のティア番号	Tier Number Leg2	104	2	9(02)		00
32 レグ3のティア番号	Tier Number Leg3	106	2	9(02)		
33 レグ4のティア番号	Tier Number Leg4	108	2	9(02)		
34 予備	Filler	110	23	X(23)	空白	

SPANリスク・パラメーター・ファイル仕様書

【備考】

- 1つのタイプ6レコードで、1つのスプレッドのレグを最大4個設定することができます。1つのスプレッドに対するレグ数の上限はありません。もし、5個以上のレグを設定する場合は、最終のタイプ6レコードの直後に追加されます。
2. 商品間スプレッド割引額の手順コード(項目 25)の値は、現在のところ「01」または「20」となっています。このフィールドが空白またはこの2つの値以外の場合、「01」であると判断します。
 - ・方式「01」は、商品グループの全限月のデルタを使用してスプレッドを組成します。
 - ・方式「20」は、ティアを使用してスプレッドを組成します。
3. 商品間スプレッド割引額の手順コード(項目 25)が「01」の場合、使用されるレグのティア番号(項目 30～33)に「00」が設定されます。「20」の場合は、各レグの商品間スプレッドに使用されるティア番号が設定されます。

【使用箇所】

- | | |
|-----------------------------------|---------------------------|
| ・スプレッド優先順位(項目 03) | … 商品間スプレッド割引額の計算(2.5章)で使用 |
| ・商品間スプレッド・クレジットレート(項目 04) | … 商品間スプレッド割引額の計算(2.5章)で使用 |
| ・商品グループコード(項目 07,12,17,22) | … 商品間スプレッド割引額の計算(2.5章)で使用 |
| ・商品間デルタノスプレッド比率(項目 08,13,18,23) | … 商品間スプレッド割引額の計算(2.5章)で使用 |
| ・マーケットサイド・インディケータ(項目 09,14,19,24) | … 商品間スプレッド割引額の計算(2.5章)で使用 |
| ・ティア番号(項目 30,31,32,33) | … 商品間スプレッド割引額の計算(2.5章)で使用 |

SPANリスク・パラメータ・ファイル仕様書

タイプ81レコード 【リスクアレイ第1レコード】

項目名	英語名称	位置	桁数	属性	内容	設定例(は空白)
01 レコードID	Record ID	1	2	X(02)	「81」：タイプ81レコード(固定)	81
02 取引所略称	Exchange Acronym	3	3	X(03)	「TSE」：東京証券取引所、「OSE」：大阪証券取引所	OSE
03 商品(プロダクト)コード	Commodity (Product) Code	6	10	X(10)		NK225E
04 原資産コード	Underlying Commodity (Product)	16	10	X(10)		NK225
05 プロダクトタイプコード	Product Type Code	26	3	X(03)		OOP
06 プット/コール区分	Option Right Code - for an option only	29	1	X(01)	「P」：プット 「C」：コール	P
07 先物限月	Futures Contract Month	30	6	9(06)	西暦4桁+月2桁の形式で指定	
08 先物限日/限週コード	Futures Contract Day or Week Code	36	2	X(02)		
09 予備	Filler	38	1	X(01)	空白	
10 オプション限月	Option Contract Month	39	6	9(06)		200006
11 オプション限日/限週コード	Option Contract Day or Week Code	45	2	X(02)		
12 予備	Filler	47	1	X(01)	空白	
13 オプション権利行使価格	Option Strike Price	48	7	9(07)		20000
14 シナリオ1のリスクアレイ値	Array Value1 : Futures No Change / Volatility Up	55	5	9(05)		00000
15 シナリオ1のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 1	60	1	X(01)	「+」または「-」を指定	+
16 シナリオ2のリスクアレイ値	Array Value2 : Futures No Change / Volatility Down	61	5	9(05)		00000
17 シナリオ2のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 1	66	1	X(01)	「+」または「-」を指定	+
18 シナリオ3のリスクアレイ値	Array Value3 : Futures Up 1/3 / Volatility Up	67	5	9(05)		00000
19 シナリオ3のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 3	72	1	X(01)	「+」または「-」を指定	+
20 シナリオ4のリスクアレイ値	Array Value4 : Futures Up 1/3 / Volatility Down	73	5	9(05)		00000
21 シナリオ4のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 4	78	1	X(01)	「+」または「-」を指定	+
22 シナリオ5のリスクアレイ値	Array Value5 : Futures Down 1/3 / Volatility Up	79	5	9(05)		00000
23 シナリオ5のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 5	84	1	X(01)	「+」または「-」を指定	+
24 シナリオ6のリスクアレイ値	Array Value6 : Futures Down 1/3 / Volatility Down	85	5	9(05)		00000
25 シナリオ6のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 6	90	1	X(01)	「+」または「-」を指定	+
26 シナリオ7のリスクアレイ値	Array Value7 : Futures Up 2/3 / Volatility Up	91	5	9(05)		00000
27 シナリオ7のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 7	96	1	X(01)	「+」または「-」を指定	+
28 シナリオ8のリスクアレイ値	Array Value8 : Futures Up 2/3 / Volatility Down	97	5	9(05)		00000
29 シナリオ8のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 8	102	1	X(01)	「+」または「-」を指定	+
30 シナリオ9のリスクアレイ値	Array Value9 : Futures Down 2/3 / Volatility Up	103	5	9(05)		00000
31 シナリオ9のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 9	108	1	X(01)	「+」または「-」を指定	+

SPANリスク・パラメーター・ファイル仕様書

タイプ82レコード 【リスクアレイ第2レコード】

項目名	英語名称	位置	桁数	属性	内容	設定例	
01	レコードID	Record ID	1	2	X(02)	「82」：タイプ82レコード(固定)	82
02	取引所略称	Exchange Acronym	3	3	X(03)		OSE
03	商品(プロダクト)コード	Commodity (Product) Code	6	10	X(10)		NK225E
04	原資産コード	Underlying Commodity (Product) Code	16	10	X(10)		NK225
05	プロダクトタイプコード	Product Type Code	26	3	X(03)		OOP
06	プット/コール区分	Option Right Code	29	1	X(01)		P
07	先物限月	Futures Contract Month	30	6	9(06)		
08	先物限日/限週コード	Futures Contract Day or Week	36	2	X(02)		
09	予備	Filler	38	1	X(01)	空白	
10	オプション限月	Option Contract Month	39	6	9(06)		200006
11	オプション限日/限週コード	Option Contract Day or Week	45	2	X(02)		
12	予備	Filler	47	1	X(01)	空白	
13	オプション権利行使価格	Option Strike Price	48	7	9(07)		20000
14	シナリオ10のリスクアレイ値	Array Value10 : Futures Down 2/3 / Volatility Down	55	5	9(05)		00000
15	シナリオ10のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 10	60	1	X(01)	「+」または「-」を指定	+
16	シナリオ11のリスクアレイ値	Array Value11 : Futures Up 3/3 / Volatility Up	61	5	9(05)		00000
17	シナリオ11のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 11	66	1	X(01)	「+」または「-」を指定	+
18	シナリオ12のリスクアレイ値	Array Value12 : Futures Up 3/3 / Volatility Down	67	5	9(05)		00000
19	シナリオ12のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 12	72	1	X(01)	「+」または「-」を指定	+
20	シナリオ13のリスクアレイ値	Array Value13 : Futures Down 3/3 / Volatility Up	73	5	9(05)		00000
21	シナリオ13のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 13	78	1	X(01)	「+」または「-」を指定	+
22	シナリオ14のリスクアレイ値	Array Value14 : Futures Down 3/3 / Volatility Down	79	5	9(05)		00000
23	シナリオ14のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 14	84	1	X(01)	「+」または「-」を指定	+
24	シナリオ15のリスクアレイ値	Array Value15 : Futures Up Extreme - Cover Fraction	85	5	9(05)		00000
25	シナリオ15のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 15	90	1	X(01)	「+」または「-」を指定	+
26	シナリオ16のリスクアレイ値	Array Value16 : Futures Down Extreme - Cover Fraction	91	5	9(05)		00000
27	シナリオ16のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 16	96	1	X(01)	「+」または「-」を指定	+
28	コンポジット・デルタ	Composite Delta	97	5	9(05)	整数1桁 + 小数点以下4桁で指定	00000
29	コンポジット・デルタの符号	Sign for Composite Delta	102	1	X(01)	「+」または「-」を指定	+
30	インプライド・ボラティリティ	Implied Volatility as decimal fraction	103	8	9(08)	整数2桁 + 小数点以下6桁で指定	25130000
31	清算値段(証拠金算定基準値段)	Settlement Price	111	7	9(07)		0001000
32	清算値段(証拠金算定基準値段)の符号	Sign for Settlement Price	118	1	X(01)	「+」または「-」を指定	+

【備考】

1. リスクアレイ値は、正が損失額を表し、負が利益を表します。
2. リスクアレイ値は、その商品グループの証拠金通貨で設定されています。
3. この商品グループに対するリスク乗数が1以上の場合、「リスクアレイ値 × 10²」を行う必要があります。(Zはこの同属商品のリスク乗数)
4. オプション限日/限週コード(項目 11)は、限月オプション取引と異なる時期に取引終了するオプション取引に使用します。限月オプション取引の場合、このフィールドは0または空白となります。それ以外のオプション取引の場合、このフィールドには、「W1」、「W2」などの値(その月の第1週に満了する週次オプション、月の第2週に満了する週次オプションなどの場合)、または2桁の日付(フレックスオプションや明確に満期日が指定されているその他のオプションなどの場合)が入ります。「先物限日/限週コード」は、通常の先物取引と異なる時期に取引終了する先物取引に、オプション取引と同様に使用します。
5. 原資産コード(項目 04)は、証拠金の計算には使用しません。
6. プロダクトタイプコード(項目 05)には、以下の内容が設定されます。
 - 「FUT」: 先物(future)
 - 「PHY」: 現物(physical)
 - 「CMB」: コンビネーション(combination)
 - 「OOF」: 先物オプション(option on future)
 - 「OOP」: 現物オプション(option on physical)
 - 「OOC」: コンビネーションオプション(option on combination)

【使用箇所】

タイプ81レコード

・リスクアレイ値(項目 14,16,18,20,22,24,26,28,30) …… 商品グループのスキャンリスク(2.4.1章)で使用

タイプ82レコード

・リスクアレイ値(項目 14,16,18,20,22,24,26) …… 商品グループのスキャンリスク(2.4.1章)で使用
・コンボジット・デルタ(項目 28) …… 商品内スプレッド割増額の計算(2.4.2章)で使用
・清算値段(証拠金算定基準値段)(項目 31) …… ネット・オプション価値の計算(2.6章)で使用

タイプBレコード 【アレイ計算パラメータとデルタ・スケーリング係数】

項目名	英語名称	位置	桁数	属性	内容	設定例(は空白)
01 レコードID	Record ID	1	2	X(02)	「B」：タイプBレコード(固定)	B
02 取引所略称	Exchange Acronym	3	3	X(03)	「TSE」：東京証券取引所、「OSE」：大阪証券取引所	OSE
03 商品コード	Commodity Code	6	10	X(10)		NK225F
04 プロダクトタイプコード	Product Type Code	16	3	X(03)		FUT
05 先物限月	Futures Contract Month	19	6	9(06)	西暦4桁 + 月2桁の形式で指定	200003
06 先物限日/限週コード	Futures Contract Day or Week Code	25	2	X(02)		
07 予備	Filler	27	1	X(01)	空白	
08 オプション限月	Option Contract Month	28	6	9(06)	西暦4桁 + 月2桁の形式で指定	199912
09 オプション限日/限週コード	Option Contract Day or Week Code	34	2	X(02)		
10 予備	Filler	36	1	X(01)	空白	
11 ベースボラティリティ	Base Volatility	37	8	9(2)V9(6)	整数2桁 + 小数点以下6桁で指定	0000000
12 ボラティリティ・スキャンレンジ	Volatility Scan Range	45	8	9(2)V9(6)	整数2桁 + 小数点以下6桁で指定	00022500
13 プライス・スキャンレンジ	Futures Price Scan Range	53	5	9(05)		35000
14 極端な変動率	Extreme Move Multiplier	58	5	9(2)V9(3)	整数2桁 + 小数点以下3桁で指定	02000
15 極端に変動した時のカバー率	Extreme Move Covered Fraction	63	5	9(1)V9(4)	整数1桁 + 小数点以下4桁で指定	03500
16 金利	Interest Rate	68	5	9(1)V9(4)	整数1桁 + 小数点以下4桁で指定	00025
17 残存期間	Time to Expiration (in years)	73	7	9(1)V9(6)	整数1桁 + 小数点以下6桁で指定	0156164
18 ルックaheadタイム	Lookahead Time (in year)	80	6	V9(06)	小数点以下6桁で指定	004000
19 デルタ・スケーリング係数	Delta Scaling Factor	86	6	9(2)V9(4)	整数2桁 + 小数点以下4桁で指定	010000
20 満期(決済)日	Expiration (Settlement) Date	92	8	9(08)	西暦4桁 + 月2桁 + 日2桁の形式で指定	20000319
21 原資産商品コード	Underlying Commodity Code	100	10	X(10)		NK225F
22 プライシングモデル	Pricing Model	110	2	X(02)		BS
23 クーポン・配当利回り	Coupon or Dividend Yield	112	8	9(2)V9(6)	整数2桁 + 小数点以下6桁で指定	00000000
24 予備	Filler	120	13	X(13)	空白	

【備考】

- Bレコードは、先物取引またはオプション取引(プット/コール及び権利行使価格を除いて同じであるすべてのオプション)のデルタ・スケーリング係数と、リスクアレイ計算に使用したパラメータを提供します。
- デルタ・スケーリング係数を除いて、Bレコードに含まれるパラメータは、SPANの証拠金計算には不要です。Bレコードを指定しない場合、その先物またはそのオプション取引のデルタ・スケーリング係数は、1.00となります。
- タイプBレコードは、その商品グループのタイプ4レコードより後にセットされます。
- プロダクトタイプコード(項目 04)が「FUT」の場合、オプション限月(項目 08)とオプション限日/限週コード(項目 09)には、0または空白が設定されます。
- オプション限日/限週コード(項目 09)は、限月オプション取引と異なる時期に取引終了するオプション取引に使用します。限月オプション取引の場合、このフィールドは0または空白である。それ以外のオプション取引の場合、このフィールドには、「W1」、「W2」などの値(その月の第1週に満了する週次オプション、月の第2週に満了する週次オプションなどの場合)、または2桁の日付(フレックスオプションや明確に満期日が指定されているその他のオプションなどの場合)が入ります。先物限日/限週コード(項目 06)は、通常先物取引と異なる時期に取引終了する先物取引に、オプション取引と同様に使用します。

SPANリスク・パラメーター・ファイル仕様書

6. プライス・スキャンレンジ(項目 13)は、商品グループの証拠金通貨で指定し、「リスクアレイ値 × 10^Z」を行う必要があります。(Zはこの同属商品のリスク乗数)リスク乗数は、タイプ2レコードに存在します。
7. 先物の満期(決済)日(項目 20)は、最終清算値段が決定される日です。オプション取引の満期(決済)日は、その限月の権利行使日となります。
8. プロダクトタイプコード(項目 04)には、以下の内容が設定されます。
 - 「FUT」: 先物(future)
 - 「PHY」: 現物(physical)
 - 「CMB」: コンビネーション(combination)
 - 「OOF」: 先物オプション(option on future)
 - 「OOP」: 現物オプション(option on physical)
 - 「OOC」: コンビネーションオプション(option on combination)

【使用箇所】

・デルタ・スケーリング係数(項目 19) …… 商品グループのスキャンリスク(2.4.1章), 売オプション最低証拠金額の計算(2.7章)で使用

SPANリスク・パラメータ・ファイル仕様書

タイプCレコード 【ティア間の商品内スプレッド割増額】

項目名	英語名称	位置	桁数	属性	内容	設定例(は空白)	
01	レコードID	Record ID	1	2	X(02)	「C」：タイプCレコード(固定)	C
02	商品グループコード	Combined Commodity Code	3	6	X(06)		NK225
03	商品内スプレッド割増額の計算手順コード	Intracommodity Spread Method Charge Code	9	2	X(02)	「10」：テーブル制御方式(固定)	10
04	スプレッド優先順位	Spreads priority (Spread Number)	11	2	9(02)		01
05	レグ数	Number of Legs	13	2	9(02)		02
06	1ネット・デルタ当たりの商品内スプレッド割増額	Charge Rate	15	7	9(07)		0002000
07	レグ1のレグ番号	Leg1 - Leg number	22	2	9(02)		01
08	レグ1のティア番号	Leg1 - Tier number	24	2	9(02)		01
09	レグ1の商品内デルタ/スプレッド比率	Leg1 - Delta Per Spread Ratio	26	2	9(02)		01
10	レグ1のマーケットサイド・インディケータ	Leg1 - Market Side	28	1	X(01)	「A」または「B」を指定	A
11	レグ2のレグ番号	Leg2 - Leg number	29	2	9(02)		02
12	レグ2のティア番号	Leg2 - Tier number	31	2	9(02)		01
13	レグ2の商品内デルタ/スプレッド比率	Leg2 - Delta Per Spread Ratio	33	2	9(02)		01
14	レグ2のマーケットサイド・インディケータ	Leg2 - Market Side	35	1	X(01)	「A」または「B」を指定	B
15	レグ3のレグ番号	Leg3 - Leg number	36	2	9(02)		
16	レグ3のティア番号	Leg3 - Tier number	38	2	9(02)		
17	レグ3の商品内デルタ/スプレッド比率	Leg3 - Delta Per Spread Ratio	40	2	9(02)		
18	レグ3のマーケットサイド・インディケータ	Leg3 - Market Side	42	1	X(01)	「A」または「B」を指定	
19	レグ4のレグ番号	Leg4 - Leg number	43	2	9(02)		
20	レグ4のティア番号	Leg4 - Tier number	45	2	9(02)		
21	レグ4の商品内デルタ/スプレッド比率	Leg4 - Delta Per Spread Ratio	47	2	9(02)		
22	レグ4のマーケットサイド・インディケータ	Leg4 - Market Side	49	1	X(01)	「A」または「B」を指定	
23	レグ5のレグ番号	Leg5 - Leg number	50	2	9(02)		
24	レグ5のティア番号	Leg5 - Tier number	52	2	9(02)		
25	レグ5の商品内デルタ/スプレッド比率	Leg5 - Delta Per Spread Ratio	54	2	9(02)		
26	レグ5のマーケットサイド・インディケータ	Leg5 - Market Side	56	1	X(01)	「A」または「B」を指定	
27	レグ6のレグ番号	Leg6 - Leg number	57	2	9(02)		
28	レグ6のティア番号	Leg6 - Tier number	59	2	9(02)		
29	レグ6の商品内デルタ/スプレッド比率	Leg6 - Delta Per Spread Ratio	61	2	9(02)		
30	レグ6のマーケットサイド・インディケータ	Leg6 - Market Side	63	1	X(01)	「A」または「B」を指定	
31	レグ7のレグ番号	Leg7 - Leg number	64	2	9(02)		
32	レグ7のティア番号	Leg7 - Tier number	66	2	9(02)		
33	レグ7の商品内デルタ/スプレッド比率	Leg7 - Delta Per Spread Ratio	68	2	9(02)		
34	レグ7のマーケットサイド・インディケータ	Leg7 - Market Side	70	1	X(01)	「A」または「B」を指定	
35	レグ8のレグ番号	Leg8 - Leg number	71	2	9(02)		
36	レグ8のティア番号	Leg8 - Tier number	73	2	9(02)		
37	レグ8の商品内デルタ/スプレッド比率	Leg8 - Delta Per Spread Ratio	75	2	9(02)		
38	レグ8のマーケットサイド・インディケータ	Leg8 - Market Side	77	1	X(01)	「A」または「B」を指定	
39	予備	Filler	78	55	X(55)	空白	

SPANリスク・パラメーター・ファイル仕様書

【備考】

1. タイプCレコードは、商品グループのタイプ3レコード(商品間スプレッドパラメーター)のサブレコードであり、通常はそのレコードの直後に設定します。各Cレコードは、該当商品グループの特定のティアの間の商品間スプレッドについてのデータを提供する。
2. 1つのタイプCレコードは最大8個のレグをサポートする。レグを9個以上定義すると、最初のCレコードの直後に同じスプレッド優先順位を持つ別のCレコードが作成される。

【使用箇所】

- | | |
|--|-----------------------------|
| ・スプレッド優先順位(項目 04) | … 商品内スプレッド割増額の計算(2.4.2章)で使用 |
| ・商品内スプレッド割増額(項目 06) | … 商品内スプレッド割増額の計算(2.4.2章)で使用 |
| ・レグ番号(項目 07,11,15,19,23,27,31,35) | … 商品内スプレッド割増額の計算(2.4.2章)で使用 |
| ・ティア番号(項目 08,12,16,20,24,28,32,36) | … 商品内スプレッド割増額の計算(2.4.2章)で使用 |
| ・商品内デルタ/スプレッド比率(項目 09,13,17,21,29,33,37) | … 商品内スプレッド割増額の計算(2.4.2章)で使用 |
| ・マーケット・サイド・インディケータ(項目 10,14,18,22,26,30,34,38) | … 商品内スプレッド割増額の計算(2.4.2章)で使用 |