

SPAN[®]リスク・パラメータ・ファイル仕様書

(株)日本商品清算機構

平成28年9月20日

第3版

SPAN[®] 及びPC-SPAN[®]は、CME に登録された商標です。当仕様書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、当仕様書の記載内容については、CMEが公表する内容が優先し、これらは予告無しに変更することがありますので、ご注意下さい。

SPANリスク・パラメータ・ファイル仕様書(本仕様書)について

1. 本仕様書に記載されるレコードタイプのSPANリスク・パラメータ・ファイルにおける配列

本仕様書に記載される各レコードタイプのSPANリスク・パラメータ・ファイルにおける配列順は以下の通りです。同一レコードに複数の商品グループコード又は商品コードが存在する場合は、アルファベット順に設定されます。

- ・タイプ0レコード
- ・タイプTレコード
- ・タイプ1レコード

以降、商品グループ毎に以下のタイプレコードが設定されます。

- ・タイプ2レコード
- ・タイプ3レコード
- ・タイプCレコード
- ・タイプ4レコード
- ・タイプBレコード(シリーズ毎に1レコード。以下の順に設定)
 - ・現物
 - ・先物/限月
 - ・オプション/限月/オプション区分(コール、プットの順)/オプション権利行使価格(昇順)
- ・タイプPレコード(各商品の商品タイプコード毎に1レコード)
- ・タイプ5レコード
- ・タイプ6レコード(スプレッド優先順位順に設定)
- ・タイプ81/82レコード(シリーズ毎に以下の順に設定)
 - ・先物/限月
 - ・オプション/限月/オプション区分(コール、プットの順)/オプション権利行使価格(昇順)

2. 各レコード・タイプにおけるフォーマット記載例

N	— 数字(整数1~9)
n	— 数字(小数点以下0~9)
X	— 英数字
YYYYMMDD	— 年月日
HHMM	— 時分

- ・当仕様書に記載される”シリーズ”とは、商品コード、商品タイプコード、限月、オプション区分及びオプション権利行使価格の組合せのことを指します。
- ・”NNnnn”と定義されている項目は、”N”と”n”の間に小数点は表示されませんが、実際の値は「整数2桁+小数点以下3桁」の数字を意味します。
- ・レコード中の使用しない項目は、”filler”と定義されており、空欄となります。(”filler”項目は、全てスペースが設定されます。)
- ・各レコードの残りの項目が空欄であれば、空欄は表示されずに改行され次の項目に続きます。
- ・CMEのリスク・パラメータ・ファイルに定義されているレコード項目で、JCCHのSPANリスク・パラメータ・ファイルで使用しない項目について、当該項目がレコードの途中に存在する場合は、”filler”(空欄)項目に置き換えられます。
- ・各レコードの最終項目以降は、改行文字を除いて、文字は一切表示されません。
- ・各レコードの最終項目の後に、改行コード(X' ODOA')が設定されます。

Record Type0 (レコードタイプ0)

Exchange Complex Header(取引所グループヘッダー)

項目名	英語名	開始位置	桁数	フォーマット	内容説明
レコードID	Record ID	1	2	XX	"0"(固定) (左ツメ、後スペース)
清算機関略称	Clearing organization Acronym	3	6	XXXXXX	"JCCH" - 東京商品取引所分 "JCCH2" - 大阪堂島商品取引所分 (左ツメ、後スペース)
営業日	Business date	9	8	NNNNNNNN	YYYYMMDD(システム日付)
ファイル種別	Settlement or Intraday	17	1	X	"S" - 取引終了後(アーリー/ファイナル) "I" - 緊急証拠金時
ファイルID	File Identifier	18	2	XX	"E" - アーリー "FC" - ファイナル、緊急証拠金時 (左ツメ、後スペース)
営業日時刻	Business Time	20	4	NNNN	"1700" - ファイナル "1600" - アーリー "1300" - 緊急証拠金時
ファイル作成日	File Creation Date	24	8	NNNNNNNN	YYYYMMDD(ファイル作成日付)
ファイル作成時刻	File Creation Time	32	4	NNNN	HHMM(ファイル作成時刻)
ファイルフォーマット	File Format	36	2	XX	"U2" - エクスパンド形式(固定)
証拠金計算方式	Gross/Net-margining Indicator	38	1	X	"G" - グロス "N" - ネット
オプション価値制限フラグ	Overall Limit Option Value Flag	39	1	X	"Y" - 制限あり "N" - 制限なし

Record TypeT (レコードタイプT)

Currency Conversion Rates (通貨換算レート)

項目名	英語名	開始位置	桁数	フォーマット	内容説明
レコードID	Record ID	1	2	XX	"T" (固定) (左ツメ、後スペース)
換算元通貨(ISOコード)	Convert-From Currency ISO Code	3	3	XXX	"USD" (固定) - 米ドル
換算元通貨(1バイトコード)	Convert-From Currency One-Byte	6	1	X	"\$" (固定) - 米ドル
換算先通貨(ISOコード)	Convert-To Currency ISO Code	7	3	XXX	"JPY" (固定) - 日本円
換算先通貨(1バイトコード)	Convert-To Currency One-Byte	10	1	X	"Y" (固定) - 日本円
換算レート	Conversion Multiplier	11	10	NNNNnnnnnn	1ドル当たりの円価(右ツメ、前スペース) (整数部4桁、少数部6桁)

Record Type1 (レコードタイプ1)

Exchange Header (取引所ヘッダー)

項目名	英語名	開始位置	桁数	フォーマット	内容説明
レコードID	Record ID	1	2	XX	"1" (固定) (左ツメ、後スペース)
取引所略称	Exchange Acronym	3	3	XXX	"TC" - 東京商品取引所 "OD" - 大阪堂島商品取引所 (左ツメ、後スペース)
予備	filler	6	2		
取引所コード	Exchange Code	8	2	XX	別紙「SPANリスク・パラメータ・ファイルにおいて使用するコード一覧」を参照

Record Type2 (レコードタイプ2)

Combined Commodity Definition (商品グループ定義)

項目名	英語名	開始位置	桁数	フォーマット	内容説明
レコードID	Record ID	1	2	XX	"2" (固定) (左ツメ、後スペース)
取引所略称	Exchange Acronym	3	3	XXX	"TC" - 東京商品取引所 "OD" - 大阪堂島商品取引所 (左ツメ、後スペース)
予備	filler	6	1		
商品グループコード	Combined Commodity Code	7	6	XXXXXX	別紙「SPANリスク・パラメータ・ファイルにおいて使用するコード一覧」を参照
リスク乗数	Risk Exponent	13	1	N	(※)
証拠金通貨(ISOコード)	Performance Bond Currency ISO Code	14	3	XXX	"JPY" (固定) - 日本円
証拠金通貨コード(1バイトコード)	Performance Bond Currency Code	17	1	X	"Y" (固定) - 日本円
オプション証拠金スタイル	Option Margin Style	18	1	X	"P" - プレミアム方式 "F" - 先物方式
オプション価値制限フラグ	Limit Option Value Flag	19	1	X	"Y" - 制限あり (ネット・オプション価値に上限が設定) "N" - 制限なし
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	"スペース" (固定) - 使用しない
予備	filler	21	2		
商品コード1	Commodity (Product) Code 1	23	10	XXX...XXXX	当該商品グループに属する商品コード 別紙「SPANリスク・パラメータ・ファイルにおいて使用するコード一覧」を参照 (左ツメ、後スペース)
商品タイプ1	Contract Type 1	33	3	XXX	"PHY" - 現物 "FUT" - 先物 "OOF" - オプション
予備	filler	36	3		
商品コード2	Commodity (Product) Code 2	39	10	XXX...XXXX	商品コード1と同様 (左ツメ、後スペース)
商品タイプ2	Contract Type 2	49	3	XXX	"PHY", "FUT", "OOF"
予備	filler	52	3		

項目名	英語名	開始位置	桁数	フォーマット	内容説明
商品コード3	Commodity (Product) Code 3	55	10	XXX...XXXX	商品コード1と同様 (左ツメ、後スペース)
商品タイプ3	Contract Type 3	65	3	XXX	"PHY", "FUT", "OOF"
予備	filler	68	3		
商品コード4	Commodity (Product) Code 4	71	10	XXX...XXXX	商品コード1と同様 (左ツメ、後スペース)
商品タイプ4	Contract Type 4	81	3	XXX	"PHY", "FUT", "OOF"
予備	filler	84	3		
商品コード5	Commodity (Product) Code 5	87	10	XXX...XXXX	商品コード1と同様 (左ツメ、後スペース)
商品タイプ5	Contract Type 5	97	3	XXX	"PHY", "FUT", "OOF"
予備	filler	100	3		
商品コード6	Commodity (Product) Code 6	103	10	XXX...XXXX	商品コード1と同様 (左ツメ、後スペース)
商品タイプ6	Contract Type 6	113	3	XXX	"PHY", "FUT", "OOF"

【備考】

- ・レコードタイプ2は、商品グループ単位に1レコードとなりますが、1つの商品グループに複数のレコードを持つことが可能です。
- ・商品コードが3以上設定されない場合は、それ以降のエリアは存在しません。
- ・各商品グループにつき、1つの現物"PHY"のレコードタイプ2が作成され、その商品コードは当該商品グループコードと同一のものとなります。

※ リスク乗数は、リスクアレイ値、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・デルタあたりの納会月割増額(消費デルタ/残余デルタ)及び商品内スプレッド割増額に適用されます。

Record Type3 (レコードタイプ3)

Intracommodity Spread Charge Parameters (商品内スプレッド割増額パラメータ)

項目名	英語名	開始位置	桁数	フォーマット	内容説明
レコードID	Record ID	1	2	XX	"3"(固定) (左ツメ、後スペース)
商品グループコード	Combined Commodity Code	3	6	XXXXXX	別紙「SPANリスク・パラメータ・ファイルにおいて使用するコード一覧」を参照
商品内(限月間)スプレッド割増額の手順コード	Intracommodity (Intermonth) Spread Charge Method Code	9	2	XX	"10"ーテーブル制御方式 "01"ー割増しを行わない
ティア1番号	Tier 1 Tier Number	11	2	NN	"01"(固定)
ティア1の開始月	Tier 1 Starting Contract Month	13	6	NNNNNN	期近限月(YYYYMM)
ティア1の終了月	Tier 1 Ending Contract Month	19	6	NNNNNN	期先限月(YYYYMM)
予備	filler	25	44		
当初/維持証拠金比率 (メンバー用)	Initial to Maintenance Ratio -- Member Accounts	69	4	Nnnn	(整数部1桁、小数部3桁) (右ツメ、前ゼロ)
当初/維持証拠金比率 (ヘッジャー用)	Initial to Maintenance Ratio -- Hedger Accounts	73	4	Nnnn	(整数部1桁、小数部3桁) (右ツメ、前ゼロ)
当初/維持証拠金比率 (スペキュレーター用)	Initial to Maintenance Ratio -- Speculator Accounts	77	4	Nnnn	(整数部1桁、小数部3桁) (右ツメ、前ゼロ)

【備考】

- ・レコードタイプ3は、商品グループ単位で1レコードとなります。
- ・商品内(限月間)スプレッド割増額の手順コードが"01"の場合、11～68桁までは空欄(filler)となります。

Record TypeC (レコードタイプC)

Tier to Tier Intracommodity Spreads (ティア間の商品内スプレッド割増額)

項目名	英語名	開始位置	桁数	フォーマット	内容説明
レコードID	Record ID	1	2	XX	"C"(固定) (左ツメ、後スペース)
商品グループコード	Combined Commodity Code	3	6	XXXXXX	別紙「SPANリスク・パラメータ・ファイルにおいて使用するコード一覧」を参照
商品内スプレッドの手順コード	Intracommodity Spread Method Code	9	2	XX	"10"(固定)ーテーブル制御方式
スプレッド優先順位	Spread Priority (Spread Number)	11	2	NN	"01"(固定)
レグ数	Number of Legs	13	2	NN	"02"(固定)
1ネット・デルタあたりの商品内スプレッド割増額	Charge Rate	15	7	NNNNNNN	(※)
レグ1のレグ番号	Leg 1 - Leg number	22	2	NN	"01"(固定)
レグ1のティア番号	Leg 1 - Tier number	24	2	NN	"01"(固定)
レグ1の商品内デルタ／スプレッド比率	Leg 1 - Delta Per Spread Ratio	26	2	NN	"01"(固定)
レグ1のマーケット・サイド	Leg 1 - Market Side	28	1	X	"A" 又は"B"
レグ2のレグ番号	Leg 2 - Leg number	29	2	NN	"02"(固定)
レグ2のティア番号	Leg 2 - Tier number	31	2	NN	"01"(固定)
レグ2の商品内デルタ／スプレッド比率	Leg 2 - Delta Per Spread Ratio	33	2	NN	"01"(固定)
レグ2のマーケット・サイド	Leg 2 - Market Side	35	1	X	"B" 又は"A"

【備考】

- レコードタイプCは、スプレッド及び商品グループ単位に1レコードとなります。
- レコードタイプCは、商品グループのレコードタイプ3(商品内スプレッド割増額パラメータ)のサブレコードであり、通常は、レコードタイプ3の直後に設定します。

※1ネット・デルタあたりの商品内スプレッド割増額は、リスク乗数による調整対象項目となります。

Record Type4 (レコードタイプ4)

Delivery (Spot) Charge Parameters (納会月割増額パラメータ)

項目名	英語名	開始位置	桁数	フォーマット	内容説明
レコードID	Record ID	1	2	XX	"4"(固定) (左ツメ、後スペース)
商品グループコード	Combined Commodity Code	3	6	XXXXXX	別紙「SPANリスク・パラメータ・ファイルにおいて使用するコード一覧」を参照
納会月割増額の手順コード	Delivery (Spot) Charge Method Code	9	2	XX	当該商品グループの納会月割増額適用の有無。 "10"－納会限月割増額適用 "01"－納会限月割増額不適用(備考参照)
対象限月数	Number of contract months in delivery	11	2	NN	納会月割増額の対象限月数 (右ツメ、前スペース)
納会月割増額対象月1-番限	Delivery Month 1 - Month Number	13	2	NN	01, 02, 03 等 (右ツメ、前スペース)
納会月割増額対象月1-限月	Delivery Month 1 - Contract Month	15	6	NNNNNN	YYYYMM
納会月割増額対象月1-1ネット・デルタ当りの納会月割増額(消費デルタ)	Delivery Month 1 - Charge Rate Per Delta Consumed By Spreads	21	7	NNNNNNN	(右ツメ、前スペース) (※)
納会月割増額対象月1-1ネット・デルタ当りの納会月割増額(残余デルタ)	Delivery Month 1 - Charge Rate Per Delta Remaining In Outrights	28	7	NNNNNNN	(右ツメ、前スペース) (※)
納会月割増額対象月2-番限	Delivery Month 2 - Month Number	35	2	NN	01, 02, 03 等 (右ツメ、前スペース)
納会月割増額対象月2-限月	Delivery Month 2 - Contract Month	37	6	NNNNNN	YYYYMM
納会月割増額対象月2-1ネット・デルタ当りの納会月割増額(消費デルタ)	Delivery Month 2 - Charge Rate Per Delta Consumed By Spreads	43	7	NNNNNNN	(右ツメ、前スペース) (※)
納会月割増額対象月2-1ネット・デルタ当りの納会月割増額(残余デルタ)	Delivery Month 2 - Charge Rate Per Delta Remaining In Outrights	50	7	NNNNNNN	(右ツメ、前スペース) (※)
予備	filler	57	6		
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	NNNNNNN	(※)
維持証拠金調整係数 (メンバー用)	Risk Maintenance Performance Bond Adjustment Factor -- Members	70	3	Nnn	(整数部1桁、小数部2桁) (右ツメ、前ゼロ)
維持証拠金調整係数 (ヘッジャー用)	Risk Maintenance Performance Bond Adjustment Factor -- Hedgers	73	3	Nnn	(整数部1桁、小数部2桁) (右ツメ、前ゼロ)

項目名	英語名	開始位置	桁数	フォーマット	内容説明
維持証拠金調整係数 (スペキュレーター用)	Risk Maintenance Performance Bond Adjustment Factor --	76	3	Nnn	(整数部1桁、小数部2桁) (右ツメ、前ゼロ)
売オプション最低証拠金額計算 方法	Short Option Minimum Calculation Method	79	1	X	"2"(固定)ープット・コール合計(オリジナル手法)

【備考】

- ・納会月割増額の手順コードが"01"の場合、11～62桁までは空欄(filler)となります。
- ・レコードタイプ4は、商品グループ単位に1レコードとなります。

※1ネット・デルタあたりの納会月割増額(消費デルタ/残余デルタ)及び売オプション1単位当たりの最低証拠金額は、リスク乗数による調整対象項目となります。

Record TypeB (レコードタイプB)

Array Calculation Parameters & Delta-Scaling Factors (リスクアレイ計算パラメータ/デルタ・スケーリング係数)

項目名	英語名	開始位置	桁数	フォーマット	内容説明
レコードID	Record ID	1	2	XX	"B"(固定) (左ツメ、後スペース)
取引所略称	Exchange Acronym	3	3	XXX	"TC"ー東京商品取引所 "OD"ー大阪堂島商品取引所 (左ツメ、後スペース)
商品コード	Commodity Code	6	10	XXX...XXX	別紙「SPANリスク・パラメータ・ファイルにおいて使用するコード一覧」を参照 (左ツメ、後スペース)
商品タイプコード	Product Type Code	16	3	XXX	"PHY"ー現物 "FUT"ー先物 "OOF"ーオプション
先物限月	Futures Contract Month	19	6	NNNNNN	商品タイプコードが "PHY"の場合ー"000000"(固定) "FUT"の場合ー当該先物の限月(YYYYMM) "OOF"の場合ー対象先物の限月(YYYYMM)
先物限日/限週コード	Futures Contract Day or Week Code	25	2	NN	スペース
予備	filler	27	1		
オプション限月	Option Contract Month	28	6	NNNNNN	商品タイプコードが "PHY"又は"FUT"の場合ースペース "OOF"の場合ー当該オプションの限月
オプション限日/限週コード	Option Contract Day or Week Code	34	2	NN	スペース
予備	filler	36	1		
ベースボラティリティ	Base Volatility	37	8	NNnnnnnn	(整数部2桁+小数部6桁) (右ツメ、整数部が1桁の場合、10の位はスペース)
ボラティリティ・スキャンレンジ	Volatility Scan Range	45	8	NNnnnnnn	商品タイプコードが "PHY"又は"FUT"の場合ー"△△△△△△△0" "OOF"の場合ーボラティリティ・スキャンレンジ (整数部2桁+小数部6桁) (右ツメ、整数部が1桁の場合、 10の位はスペース)
プライス・スキャンレンジ	Futures Price Scan Range	53	5	NNNNN	(右ツメ、前スペース) (※)
極端な変動率	Extreme Move Multiplier	58	5	NNnnn	(整数部2桁+小数部3桁) (右ツメ、整数部が1桁の場合、10の位はスペース)

項目名	英語名	開始位置	桁数	フォーマット	内容説明
極端に変動した場合のカバー率	Extreme Move Covered Fraction	63	5	Nnnnn	(整数部1桁+小数部4桁) (右ツメ)
金利	Interest Rate	68	5	Nnnnn	商品タイプコードが "PHY"の場合－スペース "FUT"の場合－"00000" "OOF"の場合－金利 (整数部1桁+小数部4桁)(右ツメ)
残存時間	Time to Expiration (in years)	73	7	Nnnnnnn	商品タイプコードが "PHY"の場合－スペース "FUT"の場合－"0000000" "OOF"の場合－決済日までの日数 (整数部1桁+小数部6桁)(右ツメ)
ルックaheadタイム	Lookahead Time (in years)	80	6	nnnnnn	(小数部6桁)(右ツメ)
デルタ・スケーリング係数	Delta Scaling Factor	86	6	NNnnnn	(整数部2桁+小数部4桁) (右ツメ、整数部が1桁の場合、10の位はスペース)
満期(決済)日	Expiration (Settlement) Date	92	8	NNNNNNNN	商品タイプコードが "FUT"の場合－"0000000" "OOF"の場合－満期日(YYYYMMDD)
原資産商品コード	Underlying Commodity Code	100	10	XXX...XXX	商品タイプコードが "FUT"の場合－対象現物の商品コード(当該商品の属する商品グループコード) "OOF"の場合－対象先物の商品コード (左ツメ、後スペース)
プライシングモデル	Pricing Model	110	2	XX	"B"－ブラック(ヨーロピアンタイプ) (左ツメ、後スペース)
クーポン/配当利回り	Coupon or Dividend Yield	112	8	NNnnnnnn	(整数部2桁、少数部6桁)

【備考】

- ・レコードタイプBは、商品コード、商品タイプ及び限月毎に1レコードが設定されます。
- ・各商品グループにつき、1つの現物"PHY"のレコードタイプBが作成され、その商品コードは当該商品グループコードと同一のものとなります。
- ・満期日(決済日)以降の項目が設定されない場合、以降のエリアは存在しません。

※プライス・スキャンレンジは、リスク乗数による調整対象項目となります。

Record TypeP (レコードタイプP)

Price Conversion Parameters (価格変換パラメータ)

項目名	英語名	開始位置	桁数	フォーマット	内容説明
レコードID	Record ID	1	2	XX	"P"(固定) (左ツメ、後スペース)
取引所略称	Exchange Acronym	3	3	XXX	"TC"ー東京商品取引所 "OD"ー大阪堂島商品取引所 (左ツメ、後スペース)
商品コード	Commodity Code	6	10	XXX...XXX	別紙「SPANリスク・パラメータ・ファイルにおいて使用するコード一覧」を参照 (左ツメ、後スペース)
商品タイプコード	Product Type Code	16	3	XXX	"PHY"ー現物 "FUT"ー先物 "OOF"ーオプション
商品名	Product Name (short name)	19	15	XXX...XXX	別紙「SPANリスク・パラメータ・ファイルにおいて使用するコード一覧」を参照 (左ツメ、後スペース)
清算値段の小数点位置	Settlement Price Decimal Locator	34	3	NNN	当該商品の清算値段の小数点位置の調整係数 (負数の場合、先頭が"-", 後2桁で指定)
権利行使価格の小数点位置	Strike Price Decimal Locator (for options only)	37	3	NNN	当該商品の権利行使価格の小数点位置の調整係数 (負数の場合、先頭が"-", 後2桁で指定)
予備	filler	40	2		
取引金額換算乗数	Contract Value Factor (Multiplier)	42	14	NNNNNNNnnnnnn n	(整数部7桁、小数部7桁) (右ツメ、前ゼロ)
標準キャビネットオプション価値	Standard Cabinet Option Value	56	8	NNNNNNnn	"00000000"(固定)
1契約毎の建玉枚数	Quoted Position Quantity per	64	2	NN	"01"(固定)
清算通貨(ISOコード)	Settlement Currency ISO Code	66	3	XXX	"JPY"(固定)ー日本円
清算通貨(1バイトコード)	Settlement Currency One-Byte Code	69	1	X	"Y"(固定)ー日本円
気配方式	Price Quotation Method	70	3	XXX	"STD"(固定)ー標準方式

【備考】

・各商品グループにつき、1つの現物"PHY"のレコードタイプPが作成され、その商品コードは当該商品グループコードと同一のものととなります。

Record Type5 (レコードタイプ5)

Combined Commodity Groups (商品グループ群)

項目名	英語名	開始位置	桁数	フォーマット	内容説明
レコードID	Record ID	1	2	XX	"5"(固定) (左ツメ、後スペース)
商品グループ群コード	Combined Commodity Group Code	3	3	XXX	別紙「SPANリスク・パラメータ・ファイルにおいて使用するコード一覧」を参照
予備	filler	6	7		
商品グループコード1	Combined commodity code 1	13	6	XXXXXX	別紙「SPANリスク・パラメータ・ファイルにおいて使用するコード一覧」を参照 (左ツメ、後スペース)
商品グループコード2	Combined commodity code 2	19	6	XXXXXX	同上 (左ツメ、後スペース)
商品グループコード3	Combined commodity code 3	25	6	XXXXXX	同上 (左ツメ、後スペース)
商品グループコード4	Combined commodity code 4	31	6	XXXXXX	同上 (左ツメ、後スペース)
商品グループコード5	Combined commodity code 5	37	6	XXXXXX	同上 (左ツメ、後スペース)
商品グループコード6	Combined commodity code 6	43	6	XXXXXX	同上 (左ツメ、後スペース)
商品グループコード7	Combined commodity code 7	49	6	XXXXXX	同上 (左ツメ、後スペース)
商品グループコード8	Combined commodity code 8	55	6	XXXXXX	同上 (左ツメ、後スペース)
商品グループコード9	Combined commodity code 9	61	6	XXXXXX	同上 (左ツメ、後スペース)
商品グループコード10	Combined commodity code 10	67	6	XXXXXX	同上 (左ツメ、後スペース)

【備考】

- レコードタイプ5は、商品グループ群単位に1レコードとなります。
- 1つのレコードタイプ5に商品グループコードは10まで設定できます。それを超える商品グループを持つ商品グループ群コードがある場合は、1つの商品グループ群について複数レコードを持つことが可能です。
- 最後に設定された項目以降のスペース及びエリアは存在しません。

Record Type6 (レコードタイプ6)

Intercommodity Spreads (商品間スプレッド)

項目名	英語名	開始位置	桁数	フォーマット	内容説明
レコードID	Record ID	1	2	XX	"6"(固定) (左ツメ、後スペース)
商品グループ群コード	Combined Commodity Group Code	3	3	XXX	別紙「SPANリスク・パラメータ・ファイルにおいて使用するコード一覧」を参照
スプレッド優先順位	Spread Priority	6	4	NNNN	(右ツメ、前ゼロ)
スプレッドクレジットレート	Spread Credit Rate	10	7	NNNnnnn	当該商品間スプレッドに適用される割引率 (%表示、整数部3桁、小数部4桁) (右ツメ、前ゼロ)
レグ1の取引所略称	Exchange Acronym Leg 1	17	3	XXX	レグ1(当該商品間スプレッドの1番目の商品グループ)が取引される取引所。 "TC"ー東京商品取引所 "OD"ー大阪堂島商品取引所 (左ツメ、後スペース)
予備	filler	20	1		
レグ1の商品グループコード	Combined Commodity Code Leg 1	21	6	XXXXXX	
レグ1のデルタ/スプレッド比率	Delta/Spread Ratio Leg 1	27	7	NNNnnnn	(整数部3桁、小数部4桁) (右ツメ、前ゼロ)
レグ1のスプレッドサイド	Spread Side Leg 1	34	1	X	"A" 又は"B"
レグ2の取引所略称	Exchange Acronym Leg 2	35	3	XXX	レグ2が取引される取引所。 "TC"ー東京商品取引所 "OD"ー大阪堂島商品取引所 (左ツメ、後スペース)
予備	filler	38	1		
レグ2の商品グループコード	Combined Commodity Code Leg 2	39	6	XXXXXX	
レグ2のデルタ/スプレッド比率	Delta/Spread Ratio Leg 2	45	7	NNNnnnn	(整数部3桁、小数部4桁) (右ツメ、前ゼロ)
レグ2のスプレッドサイド	Spread Side Leg 2	52	1	X	"B" 又は"A"

【備考】

・レコードタイプ6は、商品間スプレッド単位毎に1レコードとなります。

Record Type81 (レコードタイプ81)

Risk Arrays 1 (リスクアレイ1)

項目名	英語名	開始位置	桁数	フォーマット	内容説明
レコードID	Record ID	1	2	XX	"81"(固定)
取引所略称	Exchange Acronym	3	3	XXX	"TC"ー東京商品取引所 "OD"ー大阪堂島商品取引所 (左ツメ、後スペース)
商品コード	Commodity Code	6	10	XXX...XXX	別紙「SPANリスク・パラメータ・ファイルにおいて使用するコード一覧」を参照 (左ツメ、後スペース)
原商品コード	Underlying Commodity Code	16	10	XXX...XXX	商品タイプコードが "FUT"の場合ー対象現物の商品コード(当該商品の属する商品グループコード) "OOF"の場合ー対象先物の商品コード (左ツメ、後スペース)
商品タイプコード	Product Type Code	26	3	XXX	"PHY"ー現物 "FUT"ー先物 "OOF"ーオプション
プット/コール区分	Option Right Code	29	1	X	"P"ープット "C"ーコール スペースー先物
先物限月	Futures Contract Month	30	6	NNNNNN	商品タイプコードが "FUT"の場合ー当該先物の限月(YYYYMM) "OOF"の場合ー対象先物の限月(YYYYMM)
予備	filler	36	3		
オプション限月	Option Contract Month	39	6	NNNNNN	商品タイプコードが "FUT"の場合ースペース "OOF"の場合ー当該オプションの限月 (YYYYMM)
予備	filler	45	3		
オプション権利行使価格	Option Strike Price	48	7	NNNNNNN	商品タイプコードが "FUT"の場合ースペース "OOF"の場合ー当該オプションの権利行使価格 (整数部7桁)(右ツメ、前ゼロ)
シナリオ1のリスクアレイ値	Array Value 1 Futures No Change / Volatility Up	55	5	NNNNN	(※) (右ツメ、前ゼロ)
シナリオ1のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 1	60	1	X	"+"又は"-"

項目名	英語名	開始位置	桁数	フォーマット	内容説明
シナリオ2のリスクアレイ値	Array Value 2 Futures No Change / Volatility	61	5	NNNNN	(※) (右ツメ、前ゼロ)
シナリオ2のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 2	66	1	X	"+"又は"-"
シナリオ3のリスクアレイ値	Array Value 3 Futures Up 1/3 / Volatility Up	67	5	NNNNN	(※) (右ツメ、前ゼロ)
シナリオ3のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 3	72	1	X	"+"又は"-"
シナリオ4のリスクアレイ値	Array Value 4 Futures Up 1/3 / Volatility Down	73	5	NNNNN	(※) (右ツメ、前ゼロ)
シナリオ4のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 4	78	1	X	"+"又は"-"
シナリオ5のリスクアレイ値	Array Value 5 Futures Down 1/3 / Volatility Up	79	5	NNNNN	(※) (右ツメ、前ゼロ)
シナリオ5のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 5	84	1	X	"+"又は"-"
シナリオ6のリスクアレイ値	Array Value 6 Futures Down 1/3 / Volatility Down	85	5	NNNNN	(※) (右ツメ、前ゼロ)
シナリオ6のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 6	90	1	X	"+"又は"-"
シナリオ7のリスクアレイ値	Array Value 7 Futures Up 2/3 / Volatility Up	91	5	NNNNN	(※) (右ツメ、前ゼロ)
シナリオ7のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 7	96	1	X	"+"又は"-"
シナリオ8のリスクアレイ値	Array Value 8 Futures Up 2/3 / Volatility Down	97	5	NNNNN	(※) (右ツメ、前ゼロ)
シナリオ8のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 8	102	1	X	"+"又は"-"
シナリオ9のリスクアレイ値	Array Value 9 Futures Down 2/3 / Volatility Up	103	5	NNNNN	(※) (右ツメ、前ゼロ)
シナリオ9のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 9	108	1	X	"+"又は"-"

【備考】

・レコードタイプ81は、シリーズ単位に1レコードとなります。

※ リスクアレイ値は、リスク乗数による調整対象項目となります。

Record Type82 (レコードタイプ82)

Risk Arrays 2 (リスクアレイ2)

項目名	英語名	開始位置	桁数	フォーマット	内容説明
レコードID	Record ID	1	2	XX	"82"(固定)
取引所略称	Exchange Acronym	3	3	XXX	"TC"ー東京商品取引所 "OD"ー大阪堂島商品取引所 (左ツメ、後スペース)
商品コード	Commodity Code	6	10	XXX...XXX	別紙「SPANリスク・パラメータ・ファイルにおいて使用するコード一覧」を参照 (左ツメ、後スペース)
原商品コード	Underlying Commodity Code	16	10	XXX...XXX	商品タイプコードが "FUT"の場合ー対象現物の商品コード(当該商品の属する商品グループコード) "OOF"の場合ー対象先物の商品コード (左ツメ、後スペース)
商品タイプコード	Product Type Code	26	3	XXX	"PHY"ー現物 "FUT"ー先物 "OOF"ーオプション
プット/コール区分	Option Right Code	29	1	X	"P" ープット "C" ーコール スペースー先物
先物限月	Futures Contract Month	30	6	NNNNNN	商品タイプコードが "FUT"の場合ー当該先物の限月(YYYYMM) "OOF"の場合ー対象先物の限月(YYYYMM)
予備	filler	36	3		
オプション限月	Option Contract Month	39	6	NNNNNN	商品タイプコードが "FUT"の場合ースペース "OOF"の場合ー当該オプションの限月 (YYYYMM)
予備	filler	45	3		
オプション権利行使価格	Option Strike Price	48	7	NNNNNNN	商品タイプコードが "FUT"の場合ースペース "OOF"の場合ー当該オプションの権利行使価格 (整数部7桁)(右ツメ、前ゼロ)
シナリオ10のリスクアレイ値	Array Value 10 Futures Down 2/3 / Volatility Down	55	5	NNNNN	(※) (右ツメ、前ゼロ)
シナリオ10のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 10	60	1	X	"+"又は"-"

項目名	英語名	開始位置	桁数	フォーマット	内容説明
シナリオ11のリスクアレイ値	Array Value 11 Futures Up 3/3 / Volatility Up	61	5	NNNNN	(※) (右ツメ、前ゼロ)
シナリオ11のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 11	66	1	X	"+"又は"-"
シナリオ12のリスクアレイ値	Array Value 12 Futures Up 3/3 / Volatility Down	67	5	NNNNN	(※) (右ツメ、前ゼロ)
シナリオ12のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 12	72	1	X	"+"又は"-"
シナリオ13のリスクアレイ値	Array Value 13 Futures Down 3/3 / Volatility Up	73	5	NNNNN	(※) (右ツメ、前ゼロ)
シナリオ13のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 13	78	1	X	"+"又は"-"
シナリオ14のリスクアレイ値	Array Value 14 Futures Down 3/3 / Volatility Down	79	5	NNNNN	(※) (右ツメ、前ゼロ)
シナリオ14のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 14	84	1	X	"+"又は"-"
シナリオ15のリスクアレイ値	Array Value 15 Futures Up Extreme - Cover Fraction	85	5	NNNNN	(※) (右ツメ、前ゼロ)
シナリオ15のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 15	90	1	X	"+"又は"-"
シナリオ16のリスクアレイ値	Array Value 16 Futures Down Extreme - Cover	91	5	NNNNN	(※) (右ツメ、前ゼロ)
シナリオ16のリスクアレイ値の符号	Sign for Array Value 16	96	1	X	"+"又は"-"
コンポジット・デルタ	SPAN Composite Delta	97	5	Nnnnn	(整数部1桁、小数部4桁)
コンポジット・デルタの符号	Sign for SPAN Composite Delta	102	1	X	"+"又は"-"
インプライド・ボラティリティ	Implied Volatility	103	8	NNNNnnnn	清算値段算出に用いられたIV。 (%表示で整数部4桁、小数部4桁)
帳入値段	Settlement Price	111	7	NNNNNNN	(右ツメ、前ゼロ)

【備考】

・レコードタイプ82は、シリーズ単位に1レコードとなります。

※ リスクアレイ値は、リスク乗数による調整対象項目となります。