

SPAN'リスク・パラメータ・ファイル仕様書第3版と第2版との変更点について

- ・東京商品取引所(TOCOM)のRPFは、"JCCH"、大阪堂島商品取引所(ODE)のRPFは"JCCH2"として、取引所毎に1つのRPFが作成されます。
- ・レコードタイプT(通貨換算レート)及びレコードタイプP(価格変換パラメータ)が新規に作成されます。
- ・レコードタイプ2、B、Pにおいて、各商品グループにつき、1つの現物"PHY"のレコードが作成され、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。
ただし、"PHY"のレコードは、仕様上作成されるものであり、証拠金の計算には影響はありません。
- ・RPFの限月は、TOCOM及びODEの取引限月と同一のものになります。
- ・緊急証拠金については、システム上実装されておりますが、当面の間実施いたしません。

レコードタイプ0(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	新(ドラフト版)	旧(第2版)
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)	"JCCH"
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)	"E" - アーリー "F" - ファイナル
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	実際のファイル作成時間
証拠金計算方式	Gross/Net-margining Indicator	38	1	X	"G" - グロス "N" - ネット	(新規)
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	(新規)
清算機関/顧客コード	Clearing or Customer code	51	1	X	(なし)	"A" - 清算コード "C" - 顧客コード
予備	fill	52	1		(なし)	
清算機関/顧客略称名	Clearing or Customer Acronym	53	5	XXXXX	(なし)	"CLR" - 清算機関 "CUST" - 顧客

レコードタイプT(通貨換算レート)(新規)

項目名	英語名	開始位置	桁数	フォーマット	新(ドラフト版)	旧(第2版)
レコードID	Record ID	1	2	XX	"T" (固定) (左ツメ、後スペース)	(新規)
換算元通貨(ISOコード)	Convert-From Currency ISO Code	3	3	XXX	"USD" (固定) - 米ドル	(新規)
換算元通貨(1バイトコード)	Convert-From One-Byte Code	6	1	X	"\$" (固定) - 米ドル	(新規)
換算先通貨(ISOコード)	Convert-To Currency ISO Code	7	3	XXX	"JPY" (固定) - 日本円	(新規)
換算先通貨(1バイトコード)	Convert-To Currency One-Byte Code	10	1	X	"Y" (固定) - 日本円	(新規)
換算レート	Conversion Multiplier	11	10	NNNNnnnnnn	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)	(新規)

レコードタイプ1(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	新(ドラフト版)	旧(第2版)
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	"TC"
取引所コード	Exchange Code	8	2	XX	"TC"ー東京商品取引所 "OD"ー大阪堂島商品取引所	"TC"

レコードタイプ2(商品グループ定義)

・各商品グループにつき、1つの現物"PHY"のレコードが作成され、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。(※)

項目名	英語名	開始位置	桁数	フォーマット	新(第3版)	旧(第2版)
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	"TC"
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)ー使用しない	(新規)
商品コード1	Commodity (Product) Code 1	23	10	XXX...	(※)	
商品タイプ1	Contract Type 1	33	3	XXX	(※)	

レコードタイプ3(商品内スプレッド割増額パラメータ)

・同一商品内におけるティアの設定はできない仕様となります。

項目名	英語名	開始位置	桁数	フォーマット	新(ドラフト版)	旧(第2版)
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)	(新規)
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)	(新規)
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)	(新規)

レコードタイプC(ティア間の商品内スプレッド割増額)

変更なし

レコードタイプ4(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	新(ドラフト版)	旧(第2版)
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)	(新規)
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)	(新規)
維持証拠金調整係数 (スペキュレーター用)	Risk Maintenance Performance Bond Adjustment Factor -- Speculators	76	3	Nnn	(整数部1桁、小数部2桁) (右ツメ、前ゼロ)	(新規)
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)	空欄:Original method(オリジナルメソッド) "1":最大(Short call, short put)

レコードタイプB(リスクアレイ計算パラメータ/デルタ・スケーリング係数)

・各商品グループにつき、1つの現物"PHY"のレコードが作成され、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。

項目名	英語名	開始位置	桁数	フォーマット	新(ドラフト版)	旧(第2版)
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)	"TC"
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)	(右ツメ、前ゼロ)
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"(右ツメ、前スペース) "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)	(右ツメ、前ゼロ)
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)	(右ツメ、前ゼロ)
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)	(右ツメ、前ゼロ)
金利	Interest Rate	68	5	Nnnnn	商品タイプコードが "PHY"の場合ースペース "FUT"の場合ー"00000" "OOF"の場合ー金利 (整数部1桁+小数部4桁) (右ツメ)	"GOLD FUT"、"GOLD OOF"ー金利 上記以外 ー"00000"
残存時間	Time to Expiration (in years)	73	7	Nnnnnnn	商品タイプコードが "PHY"の場合ースペース "FUT"の場合ー"0000000" "OOF"の場合ー決済日までの日数 (整数部1桁+小数部6桁) (右ツメ)	決済日までの日数(整数部1桁+数部6桁)
ルックaheadタイム	Lookahead Time (in years)	80	6	nnnnnn	(小数部6桁)(右ツメ)	"GOLD FUT"、"GOLD OOF" ールックaheadタイム 上記以外ー"000000"
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)	(右ツメ、前ゼロ)
満期(決済)日	Expiration (Settlement) Date	92	8	NNNNNNNN	商品タイプコードが "FUT"の場合ー"0000000" "OOF"の場合ー満期日(YYYYMMDD)	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"の場合ー対象現物の商品コード(※) "OOF"の場合ー対象先物の商品コード (左ツメ、後スペース)	(新規)
プライシングモデル	Pricing Model	110	2	XX	"B"ーオプション (左ツメ、後スペース)	(新規)

レコードタイプP(価格変換パラメータ)(新規)

・各商品グループにつき、1つの現物"PHY"のレコードが作成され、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。

・当社が作成するSPANリスク・パラメータファイルでは、仕様上、項目「権利行使タイプ」が設定できないため仕様書に記載しておりませんが、PC-SPANではデフォルト設定のアメリカンタイプとして認識されます。

そのため、金オプションの権利行使タイプはヨーロッパタイプですが、仕様の都合によりPC-SPANのorganization masterでは"AMER"として設定しております。

項目名	英語名	開始位置	桁数	フォーマット	新(ドラフト版)	旧(第2版)
レコードID	Record ID	1	2	XX	"P"(固定) (左ツメ、後スペース)	(新規)
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)	(新規)
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)	(新規)
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	(新規)
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)	(新規)
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)	(新規)
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)	(新規)
予備	filler	40	2			(新規)
取引金額換算乗数	Contract Value Factor (Multiplier)	42	14	NNNNNNNn nnnnnn	(整数部7桁、小数部7桁) (右ツメ、前ゼロ)	(新規)
標準キャビネットオプション価値	Standard Cabinet Option Value	56	8	NNNNNNNn	(整数部6桁、小数部2桁) "00000000"(固定)	(新規)
1契約毎の建玉枚数	Quoted Position Quantity per	64	2	NN	"01"(固定)	(新規)
清算通貨(ISOコード)	Settlement Currency ISO Code	66	3	XXX	"JPY"(固定)ー日本円	(新規)
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	(新規)
気配方式	Price Quotation Method	70	3	XXX	"STD"(固定)ー標準方式	(新規)

レコードタイプS(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	新(ドラフト版)	旧(第2版)
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	"CCG"

レコードタイプ6(商品間スプレッド)

商品の組合せについて、商品グループコードのアルファベット順の比較により、レグ1及びレグ2のマーケットサイドが決定します。

項目名	英語名	開始位置	桁数	フォーマット	新(ドラフト版)	旧(第2版)
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)	"TC"
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)	"TC"

レコードタイプ81(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	新(ドラフト版)	旧(第2版)
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)	"TC"
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)	(新規)
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)	商品タイプコードが "FUT"の場合ー"0000000" "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)

レコードタイプ82(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	新(ドラフト版)	旧(第2版)
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)	"TC"
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)	(新規)
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)	商品タイプコードが "FUT"の場合ー"0000000" "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)
帳入価格の符号	Sign for settlement price	118	1	XXX...XXX	(なし)	常に"+"