

PC-SPAN[®] version 4 操作マニュアル

第 2 版(2010 年 12 月 24 日作成)

株式会社 日本商品清算機構(JCCH)

ご注意

第1版「PC-SPAN[®] version 4 操作マニュアル」には、一部未定の内容を含んでおります。今後、適宜修正を行う予定ですので、この旨ご承知頂くとともに、利用につきましては社内限定とさせて頂き、第三者への提供はお控えくださるようお願い申し上げます。

目次

はじめに.....	P. 2
第1章 PC-SPAN とは	P. 3
第2章 PC-SPAN のインストール	P. 5
第3章 PC-SPAN の基本動作.....	P. 11
第4章 SPAN リスク・パラメータ・ファイル	P. 15
第5章 ポートフォリオの作成	P. 17
第6章 証拠金所要額の計算.....	P. 27
第7章 PC-SPAN のレポート機能.....	P. 35
第8章 ポートフォリオ・データの保存.....	P. 43
第9章 その他の機能.....	P. 45
第10章 スクリプト・ユーティリティ	P. 52

はじめに

本マニュアルでは、シカゴ・マーカンタイル取引所 (Chicago Mercantile Exchange、以下「CME」といいます。) が提供しているパソコン上で SPAN 証拠金計算を実施するためのソフトウェア、PC-SPAN[®] version 4 (以下「PC-SPAN」といいます。なお、過去のバージョンと区別する場合、「PC-SPAN4」と表記します。) の操作方法について、CME が HP 上で公開している「PC-SPAN[®] version 4 -- Online Guide」などの資料をもとに日本語で解説しています。

(引用)

- ・「PC-SPAN[®] version 4 -- Online Guide」

http://www.cme-ch.com/span/span4/doc/span4_help_index.htm

- ・「Documentation, Upgrades and Other Resources」

<http://www.cmegroup.com/clearing/risk-management/span-use.html>

- ・「SpanPosConv Utility Documentation」

- ・「SpanReporter Utility Documentation」

ご注意

「SPAN[®] 及び PC-SPAN[®] は、CME に登録された商標です。当マニュアル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、当マニュアル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、ご注意ください。」

第1章 PC-SPAN とは

(1) PC-SPANの概要

PC-SPAN とは、パソコン上でSPAN 証拠金計算を行なうことができるアプリケーションソフトです。PC-SPAN4は、グラフィカル・ユーザー・インターフェイスを採用しており、視認性と操作性において、多くの新しい点があります。しかし、基本的な機能や全体的な証拠金処理プロセスについては過去のバージョンと差がありません。これまでのPC-SPAN 同様、PC-SPAN4 も次のような機能を持っています。

- 特定の時点(通常、当該営業日を指します)、特定取引所グループ(通常、取引所または清算機関を指します。ただし、クロスマージン協定または他の証拠金業務グループを指すこともあります。)についてのSPANリスク・パラメータ・ファイルの読み込み。
- ポートフォリオおよび当該ポートフォリオに係るポジションの入力、またはデータファイルからのポートフォリオ／ポジション情報の読み込み。
- 証拠金所要額の計算。
- オンラインでの証拠金所要額計算結果確認、当該結果の印刷、および当該結果のファイル出力。

(2) PC-SPANにおける概念

PC-SPAN4 には、従来のバージョンと同様にexchange complex(取引所グループ)の概念があります。exchange complex(取引所グループ)とは、(1)清算機関または証拠金計算の対象となる取引所、または(2)クロスマージン協定等、1つまたは複数の清算機関または取引所が参加する他の証拠金業務グループをいいます。

combined commodities(商品グループ)の概念も、従来のバージョンと同様に使用します。取引所グループは固有にcombined commodities(商品グループ)を持っており、当該取引所グループで清算される各商品は、特定の商品グループに割り当てられています。

PC-SPAN ユーザの多くは、final end-of-day settlement(最終決済)またはearly(preliminary) end-of-day settlement(暫定決済)の各タイミングでデータ処理を行っていますが、中には、intraday points in time(日中のポイント・イン・タイム)で処理しているユーザもあります。こうした点を考慮し、PC-SPAN4 でも、従来同様、最終決済/暫定決済のintraday points in time(日中のポイント・イン・タイム)を識別するためにpoint in time(ポイント・イン・タイム)という言葉を使っています。

ポートフォリオに含まれている各商品グループについて、商品グループリスク額の内容を確認することができます。これらは通常、維持証拠金と当初証拠金に分かれます。

ある一つの商品グループのSPAN証拠金は、scan risk(スキャン・リスク額)、intracommodity spread charge(商品内スプレッド割増額(従来、限月間スプレッド割増額(intermonth spread charge またはcalendar spread)と呼ばれていたもの))、delivery month charge(最終決済証拠金額)、intercommodity spread credit(商品間スプレッド割引額)、short option minimum(売オプション最低証拠金額)で構成されています。SPAN証拠金額の計算では、まずスキャン・リスク額、商品内スプレッド割増額、最終決済証拠金額の合計を算出し、この合計から商品間スプレッド割引額を差し引きます。その後、この計算結果を売オプション最低証拠金額と比較し、大きい額をSPAN証拠金額とします。

第2章 PC-SPAN のインストール

(1) 推奨環境

①ソフトウェア

PC-SPAN は Microsoft の以下に示すバージョンのソフトウェア上で作動します。

- ・ Microsoft Windows 95, 98 ,Windows NT 4.0 、またはそれ以上(Windows2000/ XP)
- ・ Microsoft Internet Explorer ver.5.0 、またはそれ以上

②プロセッサ

PC-SPAN の実行速度は、プロセッサの処理能力、処理対象となるアカウントの規模や数、および保有する異なる商品(インストルメンツ)の数などに依存します。

③メモリ

最低限 32MB の RAM を必要とします。

PC-SPAN のパフォーマンスは有効な RAM の容量に影響を受けます。

④ディスク容量

PC-SPAN のインストール自体には、約 18MB のディスク容量が必要になります。それに加え、PC-SPAN は Microsoft DCOM や MDAC コンポーネントのインストールを必要としますので、PC-SPAN のインストール自体以外に必要な容量は、PC-SPAN を利用する PC に既に何がインストールされているかによって異なります。

(2) インストール手順

PC-SPAN は、CME の以下 Web サイトからダウンロードで購入することができます。

<http://www.cmegroup.com/clearing/risk-management/span-purchase.html>

なお、希望する場合は、別途送料を支払うことにより、CD-ROM で購入することも可能です。

①PC-SPANのダウンロード

● インターネットからのダウンロード

上記WebサイトからPC-SPANを購入すると、ファイルをダウンロードするためのURL、ログインID、およびログイン・パスワードがメールで通知されますので、当該サイトにログインし、PC-SPAN softwareをダウンロードします。

- CD-ROMからのダウンロード

インストールするPCで動作中のプログラムを全て終了し、PC-SPANのCD-ROMをCD-ROMドライブに挿入します。次に、「Start(スタート)」メニューをクリックし、「ファイル名を指定して実行」を選択します。

②ダウンロードファイルの実行

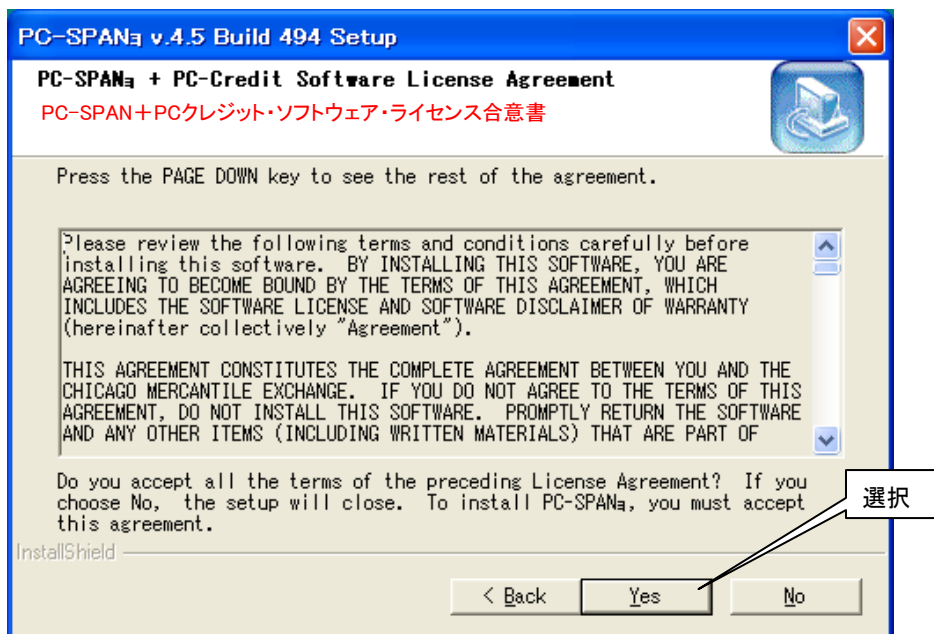
“PCSPAN-4.5.499.exe”をダブルクリックし、「実行」を選択します。

インターネット・エクスプローラVer.5.0またはそれ以上がインストールされている場合は、以下のポップアップ画面が表示されますので、「Next(次へ)」ボタンを選択します。

セットアップを中断する場合は「Cancel(中断)」を選択し、セットアップを中止します。



以下のSoftware License Agreement(ソフトウェア・ライセンス・アグリーメント)が表示されたら内容を確認し、同意する場合は「Yes(同意する)」を選択します。「No(いいえ)」を選択した場合はインストールが中止されます。)



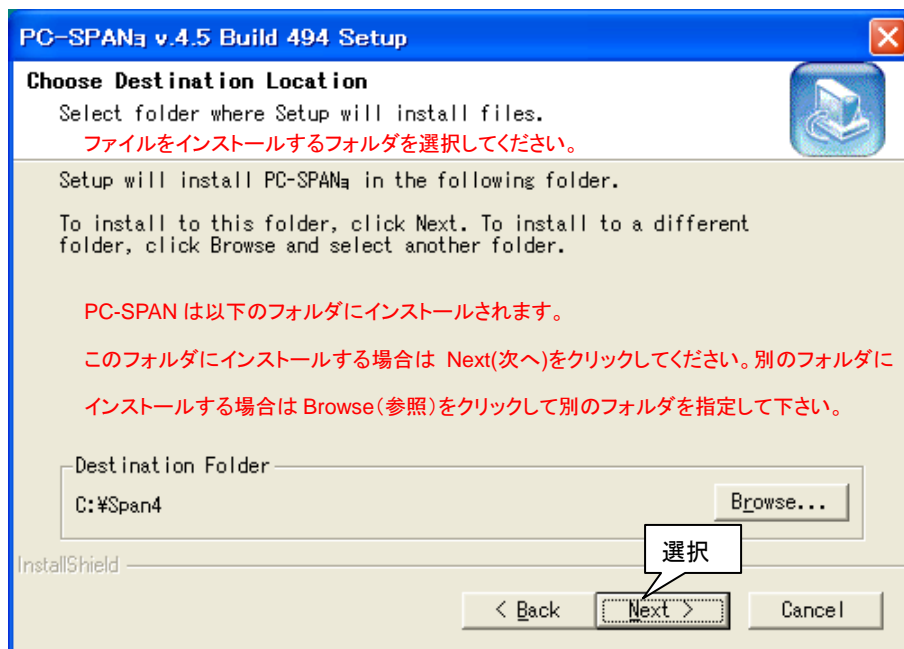
※上図、Software License Agreementの記載内容

このソフトウェアをインストールする前に、以下の契約条項を注意深くお読みください。このソフトウェアをインストールすることは、ソフトウェアライセンスおよびソフトウェアの保証にかかる免責条項を含む本契約条項(以下、まとめて「本契約書」と呼ぶ)に拘束されることに同意されたとみなされます。

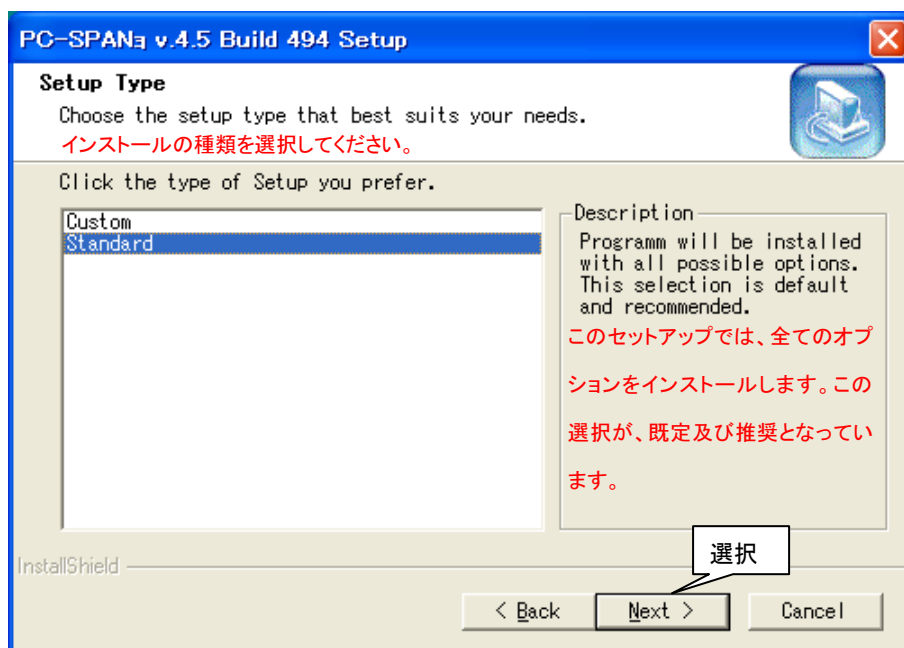
本契約書は、お客さまとシカゴ・マーカントイル取引所との間に完全な同意を構成します。本契約に同意されない場合は、このソフトウェアをインストールしないでください。この場合、本ソフトウェアおよびその一部である他の品目(文書を含む)を速やかにシカゴ・マーカントイル取引所(30 South Wacker Drive, Chicago IL 60606, USA)に返品してください。お支払いいただいた全金額を返金いたします。

③PC-SPANプログラムのインストール

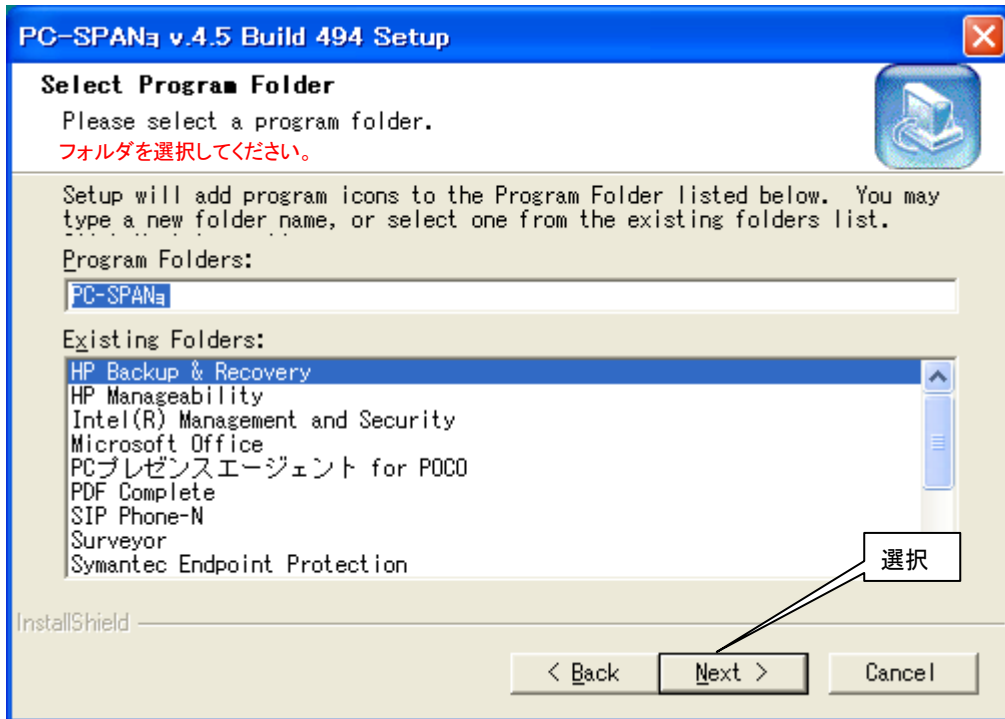
- i) PC-SPAN をダウンロードする場所を選択します。デフォルトは「C:\%Span4」となっていますが、変更する場合は「Browse(参照)」ボタンを選択し別の場所を指定します。デフォルトのフォルダに保存する場合は、「Next(次へ)」ボタンを選択します。



- ii) インストールオプションを選択します。初めて PC-SPAN をインストールする場合は「Standard(標準)」を選択し、「Next(次へ)」ボタンを選択します。



- iii) スタートメニューに表示する PC-SPAN のフォルダ名を指定します。デフォルトは「PC-SPAN®」となっています。次に「Next(次へ)」ボタンを選択すると、PC-SPAN のインストールが開始されます。



次に、「Would you like to place an icon for running PC-SPAN on your Desktop?(デスクトップにアイコンを作成しますか?)」とポップアップ画面に表示されるので、デスクトップにアイコンを作成し表示する場合には「はい(Y)」を選択して下さい。



④インストールの終了

最後に、「Finish(完了)」を選択しインストールを終了します。



参考

PC-SPAN のアンインストール

PC-SPAN をアンインストールする場合は、Windows のコントロール・パネル、「プログラムの追加と削除」により、簡単に削除することができます。

第3章 PC-SPAN の基本動作

(1) PC-SPAN の起動

他の Windows のプログラム同様、PC-SPAN は以下の方法で起動することができます。

- 「スタート」メニューから選択して起動。
- デスクトップまたはタスクバーに作成されたショートカットから起動。
- PC-SPAN がインストールされているフォルダの「bin」サブフォルダの span.exe を実行して起動。
- 拡張子「.spn」の SPAN ファイル(このファイルについては、以下で詳しく説明します)を開いて起動。

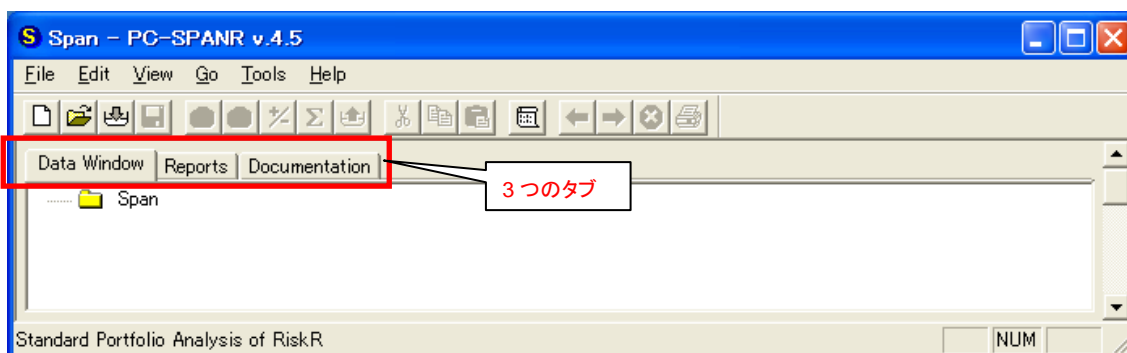
(2) PC-SPAN の基本画面

PC-SPAN を起動すると 3 つのタブを持つメインウィンドウが開きます。

タブはクリックして(またはメニューの「View(表示)」で選択して)、いつでも任意のタブに切り換えることができます。

- 【Data Window(データウィンドウ)】
SPAN リスク・パラメータ・ファイル(以下、「リスクパラメータファイル」といいます。)の読み込み、ポートフォリオとポジションの設定、証拠金所要額の計算を行うためのタブです。
- 【Reports(レポート)】
レポートの確認と印刷を行うためのタブです。
- 【Documentation(ドキュメンテーション)】
PC-SPAN のオンライン・ドキュメンテーションを表示するタブです。

[PC-SPAN の基本画面]



(3) SPAN ドキュメントのコンセプト

PC-SPAN を起動するとデータウインドウに空白の SPAN ドキュメントが表示されます。リスクパラメータファイルの読み込み、ポートフォリオポジションの入力、証拠金所要額の計算等の作業を行うと、SPAN ドキュメントが編集されます。

マイクロソフト社の Word や Excel あるいは他の Windows アプリケーションと同じように、この SPAN ドキュメントもメモリ(RAM)上に読み込まれています。しかし、その内容が自動的にハードディスクやフロッピーディスクに保存されることはありません。保存の操作を行った場合に限り保存されます。

ディスクに保存する場合、SPAN ドキュメントには任意のファイル名を付けることができますが、最後の「拡張子」は「.spn」になります。SPAN ドキュメントのデフォルトのファイル名は「span.spn」になっています(変更せずにこのままの名前で利用することもできます)。

(PC-SPAN をインストールすると、Windows に「.spn」というファイルタイプが「登録」され、「.spn」という拡張子が付いたファイルは SPAN ドキュメントであると認識されます。エクスプローラで SPAN ドキュメントをダブルクリックすると、PC-SPAN が自動的に起動して、ダブルクリックした SPAN ドキュメントが開きます。)

SPAN ドキュメントは、任意の名前でいくつでもディスクに保存することができます。ディスクに保存してある SPAN ドキュメントについて作業を再開したいときは、次のように行なうことができます。

- エクスプローラ(またはそれに相当するプログラム)を使用して開始する場合、SPAN ドキュメントを探し出して実行します。既に説明したように PC-SPAN が起動し、選択した SPAN ドキュメントが開きます。
- PC-SPAN が起動した状態で、メニューから「File Open(ファイルを開く)」を選択、またはツールバーの「Open (開く)」ボタンをクリックすると「Open (開く)」ダイアログボックスが表示されます。希望の SPAN ドキュメントをダブルクリック、または選択して「Open (開く)」ボタンをクリックしてください。デフォルトでは、SPAN ドキュメントは PC-SPAN がインストールされているフォルダの「Data (データ)」フォルダ配下に保存されるようになっていますが、任意の場所に保存することが可能です。PC-SPAN では「シングル・ドキュメント・インターフェイス」を採用しており、一度に開くことができる SPAN ドキュメントは 1 つに限られています。ただし、同時に複数の PC-SPAN を起動することができるようになっていますので、現在作業中の SPAN ドキュメントを開いたまま別の SPAN ドキュメントの作業を新たに行う場合には、もう一つ PC-SPAN を起動してください。この場合、最初に開いた SPAN ドキュメントの内容を保存後、そのドキュメントに変更を行った状態で、新規の SPAN ドキュメントを開こうとすると、変更を保存するかどうかの確認メッセージが表示されます。

(4) Data Window(データウインドウ)での作業

データウインドウでは SPAN データがツリー構造で表示されます。この機能は、Windows のエクスプローラや他のソフトウェアと同様に、階層的にデータを見ることができるようになっています。ノードと呼ばれるデータエレメントの左側に「+」マークが表示されている時は、そのノードを展開することができることを示しています。「+」マークをクリックしてノードを展開すると、その下の階層のデータを見ることができます。ノードが展開されているときは「+」マークが「-」マークに変わります。「-」マークをクリックするとノードは折りたたまれて、先ほどまで表示されていた下の階層のデータは見えなくなります。

キーボードからもツリービューを操作することができます。「↑」または「↓」キーを使ってノードを上下に移動します。展開可能なノードで「→」キーを押すとそのノードが展開されます。折りたたむときは「←」キーを押します。

Portfolio(ポートフォリオ)や contract(商品)等、ツリー状のデータ項目の中にはプロパティを持つものもあります。プロパティを表示させるには、いくつかの方法があります。そのデータ項目が選択された状態であれば、「Enter」または「Alt」+「Enter」で開くことができます。データ項目をダブルクリックしても開くことができます。あるいは、シングルクリックでそのデータ項目を選択した後、右クリックで「コンテキスト」メニューを出して「プロパティ」を選択する方法もあります。ツリービューで表示されるデータの構造は次のようになっています。

- 一番上のレベルには SPAN ドキュメント全体を示すノードが表示されます。
- その下にはデータが読み込まれた各 point in time(ポイント・イン・タイム)のノードが表示されます。
- point in time(ポイント・イン・タイム)のノード毎に二つの項目が表示されます。一つは、その point in time に定義されたポートフォリオ、もう一つは、point in time に関して読み込まれた exchange complexes(取引所グループ)が表示されます。

(5) 基本操作

① リスクパラメータファイルを開く

SPAN ドキュメントに読み込むツールバーの「Load (読み込み)」をクリック、またはメニューから「File Load (ファイルの読み込み)」を選択、またはキーボードで「Ctrl」+「L」を押すと「Load File (ファイルの読み込み)」ダイアログボックスが開きます。読み込むファイルを選択してから「Open (開く)」ボタンをクリックしてください。

② ディスクに保存されている SPAN ドキュメントを開く

ツールバーの「Open(開く)」をクリック、またはメニューから「File Open (ファイルを開く)」を選択、またはキーボードで「Ctrl」+「O」を押すと「Open(開く)」ダイアログボックスが開きます。開きたいファイル(拡張子「.spn」が付いたファイル)を選択してから「Open(開く)」をクリックしてください。

注意

変更した SPAN ドキュメント(未保存)が開いているときに別の SPAN ドキュメントを開く操作を行うと、新しいドキュメントを開く前に、現在開かれている変更済ドキュメントを保存するかどうかの確認メッセージが表示されます。

③ SPAN ドキュメントの保存

ツールバーの「Save(保存)」をクリック、またはメニューから「File Save(保存)」を選択、またはキーボードで「Ctrl」+「S」を押してください。当該 SPAN ドキュメントが初めて保存するものである場合は「Save As(名前を付けて保存)」ダイアログボックスが開きます。ドキュメントに名前を付けてから任意のディスク、フォルダに保存してください。

注意

SPAN ドキュメントのデフォルトの保存先は、PC-SPAN がインストールされているフォルダの下にある「Data(データ)」サブフォルダですが、それ以外に、任意の場所に保存することが可能です。

以前から既に存在していた SPAN ドキュメントの場合も、「Save As(名前を付けて保存)」を使って新しい名前で保存、または新しい場所に保存することができます。

④ 現在の SPAN ドキュメントをクリアし、新しい SPAN ドキュメントを開く

ツールバーの「New (新規作成)」ボタンをクリック、またはメニューから「File New(新しいファイル)」を選択、またはキーボードで「Ctrl」+「N」を押してください。

⑤ 現在の SPAN ドキュメントから特定の point in time(ポイント・イン・タイム)のデータを削除する

ツリー上で削除したい point in time(ポイント・イン・タイム)を選択し、そこで右クリックしてコンテキストメニューを出してから、「Delete(削除)」を選択してください。

(6) ログビュー(Log View)を使用する

「View(表示)」メニューの「Log(ログ)」をクリックすると「Log View(ログビュー)」の表示と非表示を切り換えることができます。これまでの PC-SPAN の「calculation log(計算ログ)」と「load log(読み込みログ)」と同じ機能を持っていますが、更に改善を加えています。ログビューの一番上を上下にドラッグすると、「Log View(ログビュー)」の大きさを変更できるようになっています。

第4章 SPAN リスク・パラメータ・ファイル

(1) リスクパラメータファイルの入手

PC-SPAN でポートフォリオを作成するためには、事前にリスクパラメータファイル入手し、PC-SPAN に読み込まなくてはなりません。リスクパラメータファイルは、JCCH システム会員画面、以下の JCCH の Web サイト、および CME の Web サイトからダウンロードすることができます。

【JCCH】<http://www.jcch.co.jp/span/>

【CME】<ftp://ftp.cmegroup.com/span/data/jcch/>

(2) リスクパラメータファイルの種類

PC-SPAN に取り込み可能なリスクパラメータファイルには以下3つのフォーマットが存在し、通常は圧縮ファイル(zip ファイル)で提供されています。JCCH では、下記②「pa2」の形式のリスクパラメータファイルに対応しています。

- ①unpacked(標準フォーマット):*.par (例)jcch1222.par
- ②expanded unpacked(拡張フォーマット):*.pa2 (例)jcch1222s.pa2
- ③XML-based SPAN file format (XML フォーマット):*.spn (例)jcch.20101222.s.cust.spn

● リスクパラメータファイル名について:

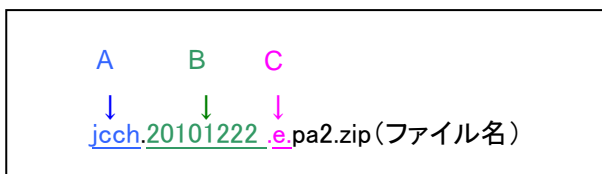
通常、リスクパラメータファイル名は以下のように識別されます。

<2010年12月22日の JCCH の拡張形式のリスクパラメータファイルファイル名の例>

A は清算機構の略称、B はファイルの発行日、C はファイルのサイクルコード(発行タイミング)を示します。サイクルコードには主に以下の種類がありますが、取引所によっては独自のサイクルコードを用いている場合もあります。

<サイクルコードの表示例>

”e”(アーリーファイル)、“f”(ファイナルファイル)



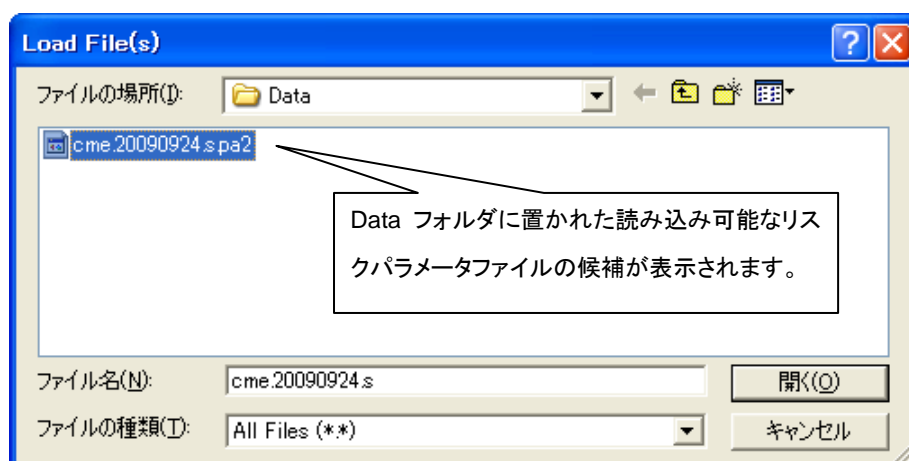
注)B は、YYYYMMDD の形式となります。

(3) リスクパラメータファイルの読み込み

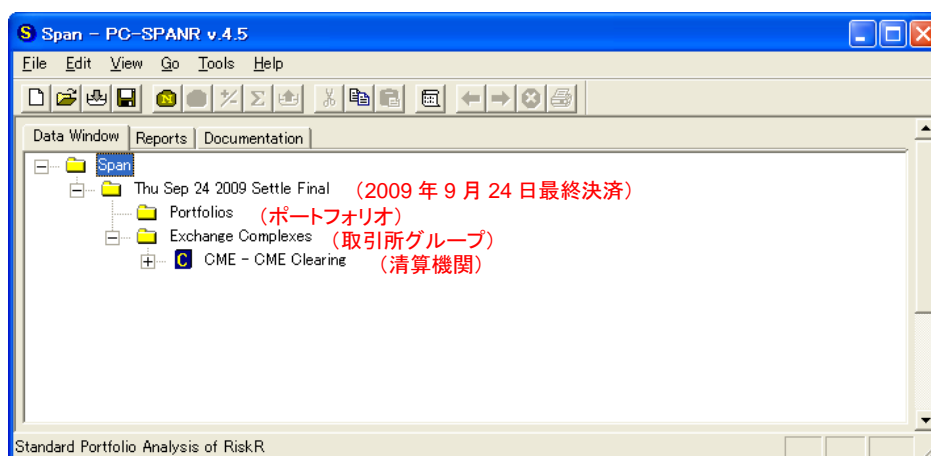
PC-SPAN にリスクパラメータファイルを読み込む前に、入手したリスクパラメータファイルを解凍し、「C:\¥Span4¥Data」(または任意のフォルダでも可)に保存します。

- PC-SPAN を起動し、「File(ファイル)」→「Load File(s)(ファイルの読み込み)」を選択するか、メニューバーの Load アイコンを選択しクリックすると、読み込むリスクパラメータファイルを選択する以下の画面が表示されます。次に、読み込むリスクパラメータファイルを指定し、「開く(O)」を選択するとリスクパラメータファイルが読み込まれます。
- このとき、「C:\¥Span4¥Data」にリスクパラメータファイルを保存しておくことを選択する画面が表示されますが、任意のフォルダに保存していた場合は開くファイルの場所を指定する必要があります。

[リスクパラメータファイルの選択画面]



読み込み完了後、Span フォルダをクリックすると、以下のように読み込んだリスクパラメータファイルの清算機関名が、下記基本画面の作業エリアに Exchange Complexes(取引所グループ)配下に表示されます。



第5章 ポートフォリオの作成

PC-SPAN でポートフォリオを作成するには、PC-SPAN のポートフォリオ入力画面から直接作成する方法とファイルから PC-SPAN に読み込み作成する方法との2種類があります。

入力が必要となるポートフォリオの画面タブには、以下の2つがあります。

- 「Portfolio Data(ポートフォリオ・データ)」タブ
ポートフォリオの名称、アカウントタイプ、通貨など基本的な情報が入力できます。
- 「Positions(ポジション)」タブ
当該ポートフォリオが保有する商品、限月ごとのネット・ポジションの情報が入力できます。

(1) PC-SPAN のポートフォリオ入力画面から直接作成する方法

① ポートフォリオ入力画面を開く

リスクパラメータファイルを PC-SPAN に読み込んだ後(P.16(3)を参照)、基本画面のメニュータブ「File(ファイル)」→「New Portfolio(新しいポートフォリオ)」を選択するか、メニューバーの **N** アイコンを選択しクリックすると、以下のように Portfolio Data(ポートフォリオ・データ)の入力画面がポップアップで表示されます。

The screenshot shows a dialog box titled "New Portfolio" with the following fields and options:

- Parent Account: (None) (親アカウント)
- Clearing Firm: (クリアリング・ファーム(ポートフォリオ名))
- Account: *** New Portfolio *** (アカウント)
- Account Type: S - Speculator - Customer (アカウントタイプ)
- Seg Type: N/A (セグメントタイプ)
- Portfolio Currency: USD - USD (ポートフォリオ通貨)
- Ledger Balance: 0.00
- Open Trade Equity: 0.00
- Securities On Deposit: 0.00
- Locked-Up Equity: 0.00
- Checkboxes: Qualified Institutional Buyer, Normal for GSCIER

Buttons at the bottom: OK, キャンセル, 適用(A)

※JCCH における SPAN 計算を行う場合に、必須または任意で入力する項目のみ日本語翻訳を併記しています。

②「Portfolio Data(ポートフォリオ・データ)」タブの入力

「Portfolio Data(ポートフォリオ・データ)」タブには、証拠金所要額の計算のために入力が必要となる項目と、オプションの項目(入力がなくても計算結果に影響しない項目)があります。

必須項目の入力

- Clearing Firm(クリアリング・ファーム)
当該ポートフォリオを特定するための任意で一意の名前を入力します。
(例)JCCH
- Account Type(アカウントタイプ)
Customer(顧客)、Clearing(清算機関)、Omnibus(オムニバス)の中から該当するアカウントタイプを選択します。このとき、親ポートフォリオの場合は、Omnibus(オムニバス)アカウントの中から選択します。
- Portfolio Currency(ポートフォリオ通貨)
ポートフォリオで表示させる通貨を選択します。通常は「JPY-JAPANESE YEN(日本円)」を選択します。

参考

オプション項目の入力

以下に示すオプション項目は、JCCH での証拠金所要額の計算には直接必要のない項目ですので、通常は、以下のデフォルト設定のままにしてください。

- Parent Account(親アカウント)

Parent Account(親アカウント)で特定のポートフォリオを指定すると、指定したポートフォリオが作成中のポートフォリオの上位に親ポートフォリオとして設定されます。親ポートフォリオを指定すると、親ポートフォリオを指定した複数のポートフォリオを親ポートフォリオ配下の1つのグループとして管理することができます。ただし、Parent Account(親アカウント)で親ポートフォリオを指定するには、Account Type(アカウントタイプ)に”Omnibus Speculator(オムニバス・スペキュレータ)”が設定された親となるポートフォリオが先に作成されていなければなりません。(親ポートフォリオの作成方法は、Parent Account(親アカウント)に何も設定しない以外は、通常のポートフォリオの作成方法と同じです。)

特に親ポートフォリオを指定しない場合は、デフォルト設定「None(該当なし)」とします。

- Account(アカウント)

上記の Clearing Firm(クリアリング・ファーム)で入力した同じポートフォリオ名で複数アカウントに分けてポートフォリオを作成したい場合に、ここに任意の名前を指定します。特に指定しない場合は、デフォルト設定「New Portfolio(新しいポートフォリオ)」とします。

- Seg Type(セグメント・タイプ)

通常、デフォルト設定「N/A(該当なし)」を選択してください。

- Qualified Institutional Buyer(適格機関投資家) / Normal for GSCIER(ノーマル・フォー・GSCIER)

CMEのみ利用しますので、デフォルト設定(両方にチェックを入れた状態)とします。

- Ledger Balance(レジャー・バランス)

顧客が証拠金として差し入れている金銭の額。

通常、デフォルト設定「0.00」としてください。

- Open Trade Equity(オープン・トレード・イクイティ)

顧客の先物取引についての計算上の損益額(すべての先物取引について約定値段と清算値段の差に相当する金額を合計した額)。

通常、デフォルト設定「0.00」としてください。

- Securities on Deposit(充用有価証券評価額)

顧客が証拠金の代用として参加者に差し入れている充用有価証券の評価総額。

通常、デフォルト設定「0.00」としてください。

以上で「Portfolio Data(ポートフォリオ・データ)」タブの入力は完了です。

③「Position(ポジション)」タブの入力

次に、基本画面の「Portfolio Data(ポートフォリオ・データ)」タブの横にある「Positions(ポジション)」タブをクリックし、ポジション情報を入力します。

i) 必須項目

Exchange(取引所)、Product(商品)、Product Type(商品タイプ)、Option Series(オプション・シリーズ)の各項目から、当該ポートフォリオに入力する項目を選択し、商品契約ごとにネット・ポジションの数を手動で入力します。

[先物入力例]

先物の場合は、限月ごとのネット・ポジションを、買い越しの場合は正の値として、売り越しの場合は負の値として入力します。

Contract	Net	Trades
200910	30	
200912		
201001	-40	
201003		
201005		
201007		
201008		
201009		
201010		

CME-CBOT 大豆ミール先物 ネット・ポジション
2009年10月限30枚買い、2010年1月限40枚売り

[オプション入力例]

オプションは、Call(コール)/Put(プット)に分けてネット・ポジションを、買い越しの場合は正の値として、売り越しの場合は負の値として入力します。

Contract	Net	Trades
Call at 100	30	
Put at 100	40	
Put at 200		
Put at 220	40	
Call at 230		
Put at 230		
Call at 240		
Put at 240		
Call at 250		

Put(プット)の40買い

ii) その他表示機能

「Contract With Position(ポジション有りの商品)」をチェックすると、以下の通り、選択している Product(商品)にネット・ポジションが入力されている行のみが表示されます。

The screenshot shows the 'Positions' tab in the 'JCCH - a - N/A - (USD)' window. The 'Contracts With Positions' checkbox is checked, and the 'All Positions for Selected Exchange Complex' checkbox is unchecked. The 'Exchange' is set to 'CME - CBT' and the 'Product' is '06 - SOYBEAN MEAL FL'. The table below shows the following data:

Contract	Net	Trades
200910	30	
201001	-40	

また、「All Positions for Selected Exchange Complex(選択された取引所に存在する全てのポジション)」をチェックすると、選択した取引所の当該ポートフォリオが持つ全てのネット・ポジション情報が表示されます。

The screenshot shows the 'Positions' tab in the 'JCCH - a - N/A - (USD)' window. The 'Contracts With Positions' checkbox is checked, and the 'All Positions for Selected Exchange Complex' checkbox is checked. The 'Exchange' is set to 'CME - CBT' and the 'Product' is '06 - SOYBEAN MEAL FL'. The table below shows the following data:

Contract	Net	Trades
CBT 06 Future 200910	30	
CBT 06 Future 201001	-40	
CBT 06 200910 Call at 100 on CBT 06 Future 200910	30	
CBT 06 200910 Put at 100 on CBT 06 Future 200910	40	
CBT 06 200910 Put at 220 on CBT 06 Future 200910	40	

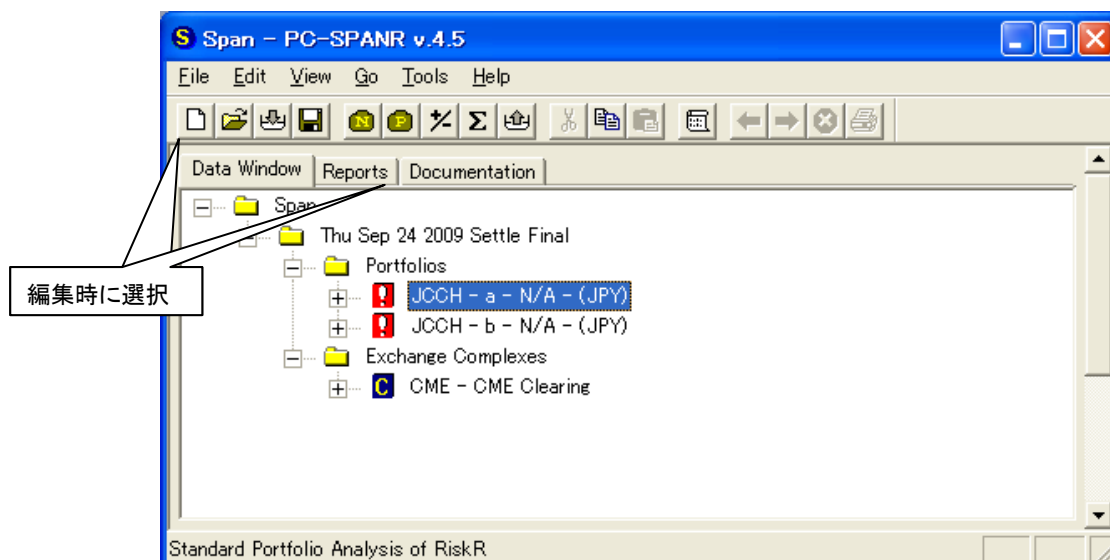
③ポートフォリオの保存

ポジション情報を入力したら、「OK」ボタンを押下し、ポートフォリオを保存します。保存したポートフォリオは、基本画面で以下のように赤色で表示されます。(赤色は証拠金計算を行う前の状態にあるポートフォリオであることを意味します。)



④ポートフォリオ・データの編集

上記に示すようにポートフォリオを保存した状態で、編集したい場合は、当該ポートフォリオ上にカーソルを置いた上で、メニューバーアイコンの **P** を押下するか、「File(ファイル)」→「Edit Positions(ポジションの編集)」を選択し、ポジション入力画面を開くことができます。



⑤ポートフォリオ・データの削除

作成したポートフォリオ・データを削除する場合は、当該ポートフォリオ上にカーソルを置いた状態で、右クリック→「Delete (削除)」から削除するか、メニューバーの「Edit (編集)」→「Delete Del (削除)」を選択すると、当該ポートフォリオを削除することができます。

(2) ファイルから PC-SPAN に読み込みポートフォリオを作成する方法

①PC-SPAN ユーティリティ(*SpanPosConv.exe*)のダウンロード

ファイルから PC-SPAN にポートフォリオ作成に必要なデータを読み込んでポートフォリオを作成するには、PC-SPAN ユーティリティプログラム (*SpanPosConv.exe*)が必要になります。

SpanPosConv.exe を入手するには、PC-SPAN の購入後、PC-SPAN をダウンロードするために通知される URL にログオンし、*SpanPosConv.exe* (ユーティリティプログラム本体) および *SpanPosConv Utility Documentation* (利用解説書) をダウンロードします。

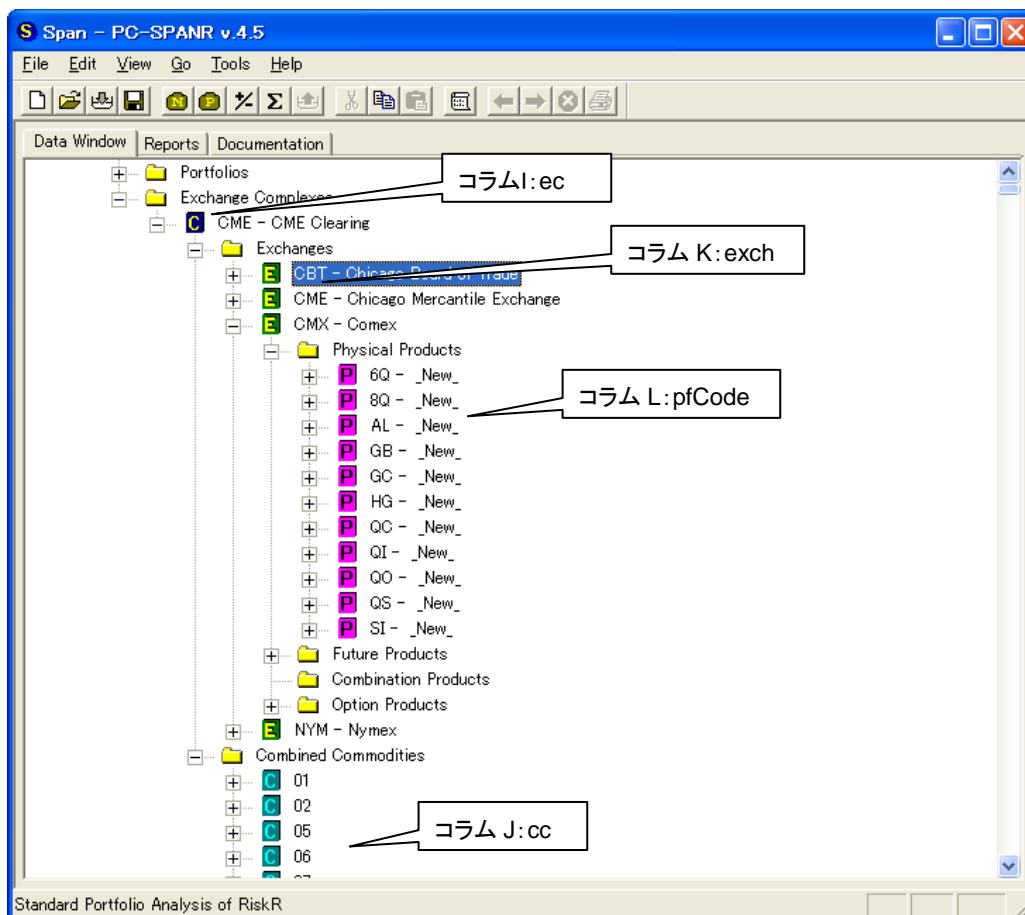
なお、*SpanPosConv.exe* を起動するには、PC-SPAN がダウンロードされている PC にあらかじめ Microsoft .NET Framework をインストールしておく必要があります。

② CSV ポートフォリオ・データ・ファイルの作成

ポートフォリオの作成に必要な以下のデータ項目を Excel シートに入力し、csv 形式で保存することにより、PC-SPAN に読み込むデータファイルを作成します。(入力するデータ項目は、取引所の単位に1行空けて作成します。)

- コラム A : date: 日付 (yyyymmdd)
- コラム B : isSetl: 帳入または日中フラグ (通常、デフォルト"1"を入力)
- コラム C : firm: ポートフォリオ名 (ポートフォリオの Clearing Firm に該当する情報)
- コラム D : acctid: アカウント番号 (ポートフォリオの Account に該当する情報)
- コラム E : acctType: アカウントタイプ (ポートフォリオの Account Type に該当する情報。
例えば"Member"であれば"M"、"Speculator"であれば"S"、"Hedger"であれば"H")
- コラム F : isCust: 通常"1"
- コラム G : seg: 通常"CUST"
- コラム H : currency: 通常"JPY"
- コラム I : ec: ポートフォリオ取引所の略称名でリスクパラメータファイル読み込み時に PC-SPAN Data Window 画面の Exchange Complexes 配下に **C**として表示されている取引所の略称名。(例)25 ページ画面例では"CME"
- コラム J : cc: 商品グループコードで、リスクパラメータファイル読み込み時に PC-SPAN Data Window 画面の Combined Commodities 配下の **C**として表示されている略称名。(例)25 ページ画面例では"01"
- コラム K : exch: 取引所の略称名で、リスクパラメータファイル読み込み時に PC-SPAN Data Window 画面の Exchanges 配下の **E**として表示されている取引所の略称名。(例)25 ページ画面例では"CBT"
- コラム L : pfCode: プロダクトファミリーコードで、リスクパラメータファイル読み込み時に PC-SPAN Data Window 画面の各取引所配下の Physical Products /Future Products/Combination Products /Option Products 配下の **P**として表示されているプロダクトの略称名。(例)25 ページ画面例では"6Q"
- コラム M : pfType: プロダクトファミリータイプで、先物は"FUT"、オプションは"OOF"
- コラム N : pe: 当該商品の限月 (YYYYMM)
- コラム O : undPe: 当該オプションの原商品限月 (YYYYMM)。先物の場合は空欄。
- コラム P : o: オプション権利コードで、"C"(コール)または"P"(プット)
- コラム Q : k: オプション権利行使価格
- コラム R : net: ネット・ポジション数
- コラム S : coupon: 未使用

[リスクパラメータファイル読み込み時 Data Window(データウインドウ)表示画面]



以上の項目を Excel ファイルに入力し、csv ファイル形式で保存すれば、ポートフォリオ作成に必要な PC-SPAN4 への読み込みデータファイルの作成は完了です。

[PC-SPAN ポートフォリオ作成用データファイル作成イメージ]

	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M	N	O	P	Q	R	S
1	date	isSetl	firm	acctId	acctType	isCust	seg	currency	ec	cc	exch	pfCode	pfType	pe	undPe	o	k	net	coupon
2	20081112	1	JCCH1	1	S	1	CUST	JPY	CME	GC	CMX	8Q	FUT	200812					40
3	20081112	1	JCCH1	1	S	1	CUST	JPY	CME	GC	CMX	8Q	FUT	201001					-25
4	20081112	1	JCCH1	1	S	1	CUST	JPY	CME	GC	CMX	GC	FUT	200812					40
5	20081112	1	JCCH1	1	S	1	CUST	JPY	CME	GC	CMX	GC	FUT	201001					-25
6	20081112	1	JCCH1	1	S	1	CUST	JPY	CME	GC	CMX	QO	FUT	200812					40
7	20081112	1	JCCH1	1	S	1	CUST	JPY	CME	GC	CMX	QO	FUT	201002					-25
8	20081112	1	JCCH1	1	S	1	CUST	JPY	CME	GC	CMX	QS	FUT	200812					40
9	20081112	1	JCCH1	1	S	1	CUST	JPY	CME	GC	CMX	QS	FUT	201003					-25
10	20081112	1	JCCH1	1	S	1	CUST	JPY	CME	GC	CMX	OG	OOF	200812	200812	C	300	40	
11	20081112	1	JCCH1	1	S	1	CUST	JPY	CME	GC	CMX	OG	OOF	200812	200812	P	430	-30	
12	20081112	1	JCCH1	1	S	1	CUST	JPY	CME	HG	CMX	HG	FUT	200812					25
13	20081112	1	JCCH1	1	S	1	CUST	JPY	CME	HG	CMX	HG	FUT	201001					-25
14	20081112	1	JCCH1	1	S	1	CUST	JPY	CME	HG	CMX	HX	OOF	200812	200812	C	112	20	
15	20081112	1	JCCH1	1	S	1	CUST	JPY	CME	HG	CMX	HX	OOF	200812	200812	P	200	-30	
16	20081112	1	JCCH1	1	S	1	CUST	JPY	CME	SI	CMX	6Q	FUT	200812					25
17	20081112	1	JCCH1	1	S	1	CUST	JPY	CME	SI	CMX	6Q	FUT	201003					-25
18	20081112	1	JCCH1	1	S	1	CUST	JPY	CME	SI	CMX	QI	FUT	201005					25
19	20081112	1	JCCH1	1	S	1	CUST	JPY	CME	SI	CMX	QI	FUT	201003					-25
20	20081112	1	JCCH1	1	S	1	CUST	JPY	CME	SI	CMX	SI	FUT	200812					25
21	20081112	1	JCCH1	1	S	1	CUST	JPY	CME	SI	CMX	SI	FUT	201003					-25
22	20081112	1	JCCH1	1	S	1	CUST	JPY	CME	SI	CMX	S/O	OOF	200812	200812	C	1000	10	
23	20081112	1	JCCH1	1	S	1	CUST	JPY	CME	SI	CMX	S/O	OOF	200812	200812	P	3000	-40	

③XML ファイルへの変換

②で作成したデータファイルを PC-SPAN に読み込むようにするために、PC-SPAN のユーティリティプログラム (*SpanPosConv.exe*) を使って、csv ファイルから XML 形式のファイル (*.pos) に変換します。

以下に、コマンド実行例を示します。

【コマンド例】

```
c:¥span4¥util¥SpanPosConv c:¥span4¥Data¥*.csv c:¥span4/Data/*.pos ¥np
```

(注) 上記は、*SpanPosConv.exe* を PC-SPAN がインストールされているフォルダ配下の "util" フォルダに、データファイル (*.csv) および変換後の XML ファイル (*.pos) を同じく PC-SPAN がインストールされているフォルダ配下の "Data" に置いて実行した例になります。(*は任意のファイル名)

④XML ファイルの読み込み

XML ファイルを PC-SPAN に読み込む前に、ファイルに入力した "date" と同じ日付で JCCH が発行しているリスクパラメータファイルを読み込みます。

次に、上記③で作成したポートフォリオを作成するための XML ファイル (*.pos) を PC-SPAN に読み込むと、ポートフォリオが自動的に作成されます。

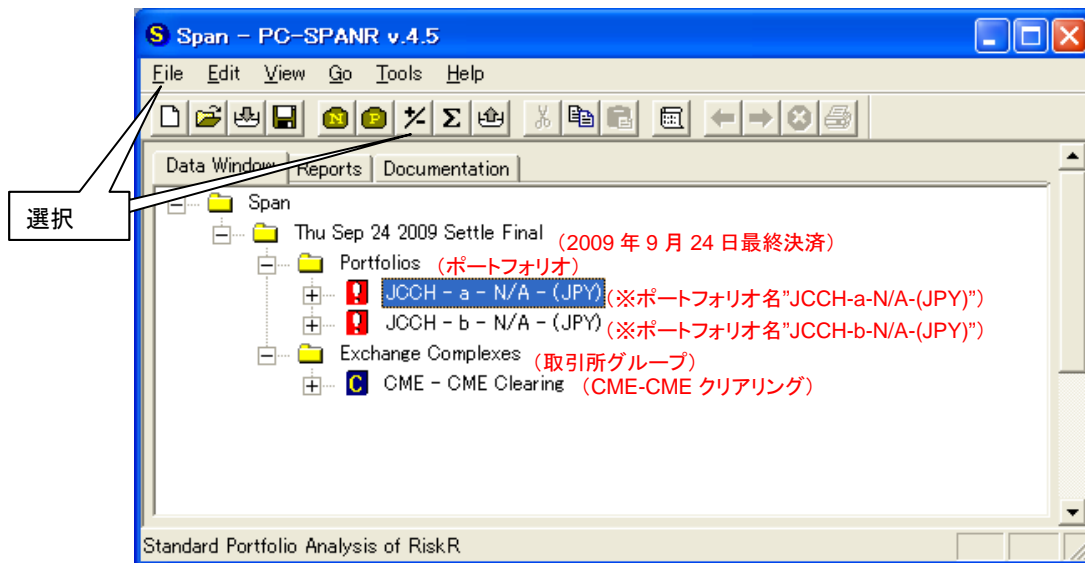
なお、リスクパラメータファイルおよび XML ファイルの PC-SPAN への読み込み方法は、本マニュアル第 4 章(3)(16 ページ)に記載されている手順と同じです。

第6章 証拠金所要額の計算

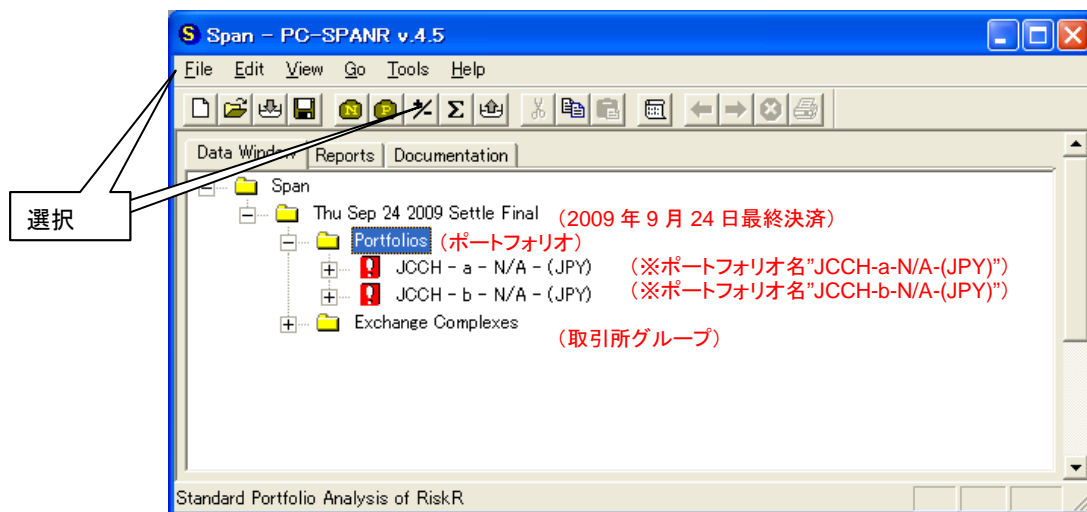
(1) 証拠金の計算方法

① 特定のポートフォリオについて証拠金計算を行う場合

特定のポートフォリオだけを選び証拠金計算を行う場合は、証拠金計算を行うポートフォリオの上にカーソルを置き、メニューバーアイコンの **+/-** を押下するか、あるいは「File(ファイル)」→「Calculate Portfolio(s) Requirements(ポートフォリオの証拠金計算)」を選択して、証拠金計算を実行します。



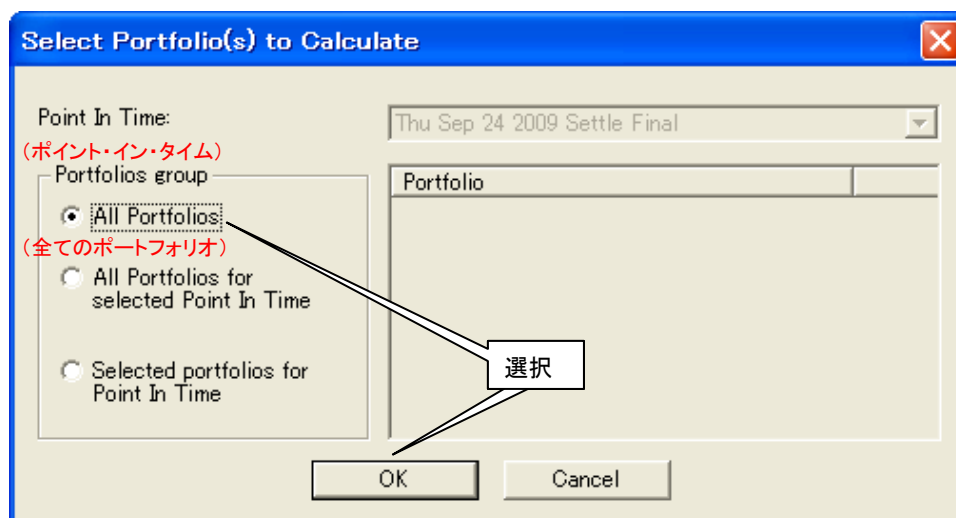
同じ日付のリスクパラメータファイルについて作成された「Portfolios(ポートフォリオ)」配下全てのポートフォリオの証拠金計算をする場合、作成したポートフォリオの上位フォルダ、「Portfolios(ポートフォリオ)」上にカーソルを置き、メニューバーアイコンの **+/-** を押下するか、「File(ファイル)」→「Calculate Portfolio(s) Requirements(ポートフォリオの証拠金計算)」を選択し、実行します。



②複数日付のポートフォリオの証拠金計算を行う場合

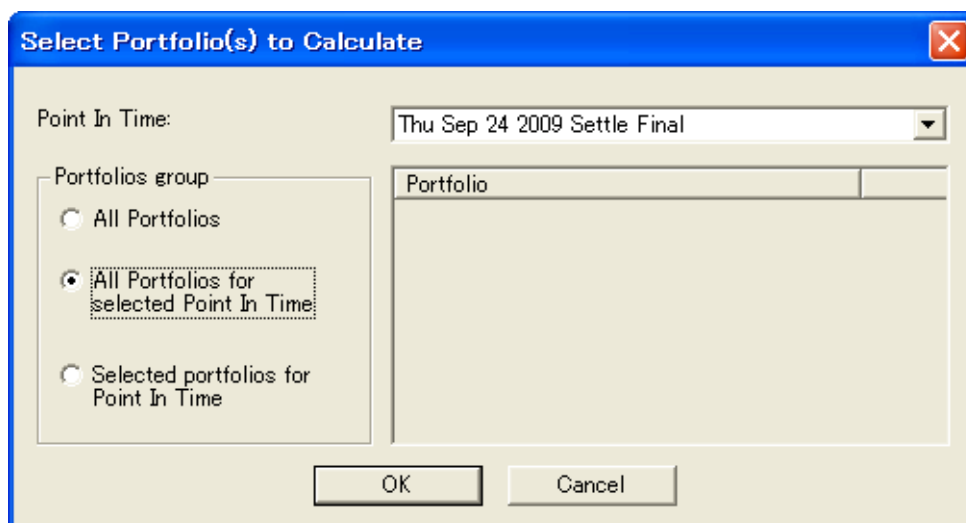
最上位の SPAN フォルダの上にカーソルを置き、メニューバーアイコンの **+/-** を押下するか、あるいは「File(ファイル)」→「Calculate Portfolio(s) Requirements(ポートフォリオの証拠金計算)」を選択すると以下の画面が表示されます。

ここで、「All Portfolios(全てのポートフォリオ)」を選択し「OK」ボタンを押下すると、PC-SPAN に作成されている全てのリスクパラメータファイルについて作成されている全てのポートフォリオの証拠金計算を行います。



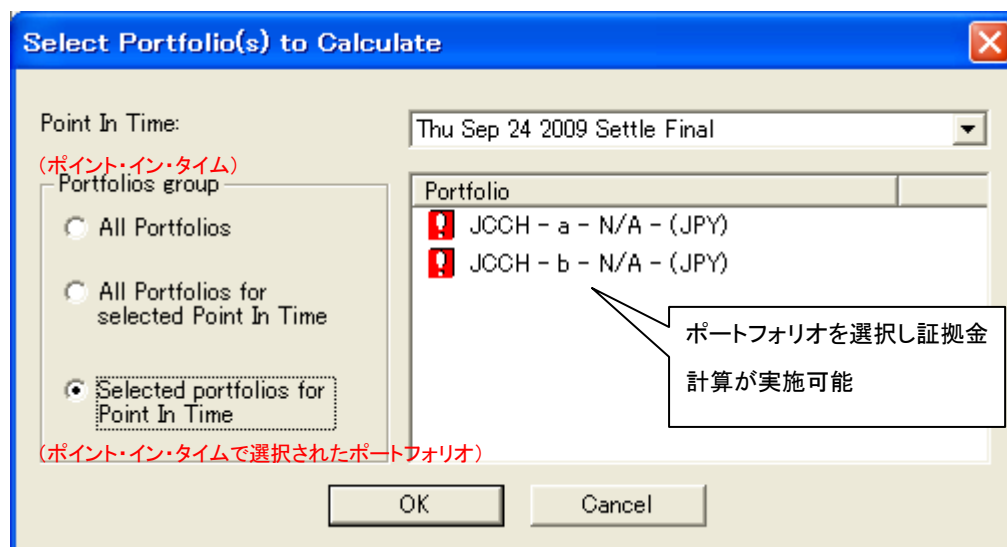
また、「All Portfolios for selected Point In Time(選択したポイント・イン・タイムの全てのポートフォリオ)」を選択し「OK」ボタンを押下すると、「Point In Time(ポイント・イン・タイム)」で選択した日付のリスクパラメータファイルについて作成されている全てのポートフォリオについて証拠金計算を行います。

(以下は、2009年9月24日の最終決済時のリスクパラメータファイルについて作成された全てのポートフォリオについて証拠金計算を行う場合の例です。)




「Selected portfolios for Point In Time(ポイント・イン・タイムで選択されたポートフォリオ)」を選択し「OK」ボタンを押下すると、Point In Time(ポイント・イン・タイム)で選択した日付のリスクパラメータファイルについて作成されているポートフォリオのうち、ここで選択されたポートフォリオについてのみ証拠金計算を行います。

(次の例は、2009年9月24日のリスクパラメータファイルについて作成されたポートフォリオ”JCCH-a-N/A-(JPY)”についてのみ証拠金計算を行う場合の例です。)

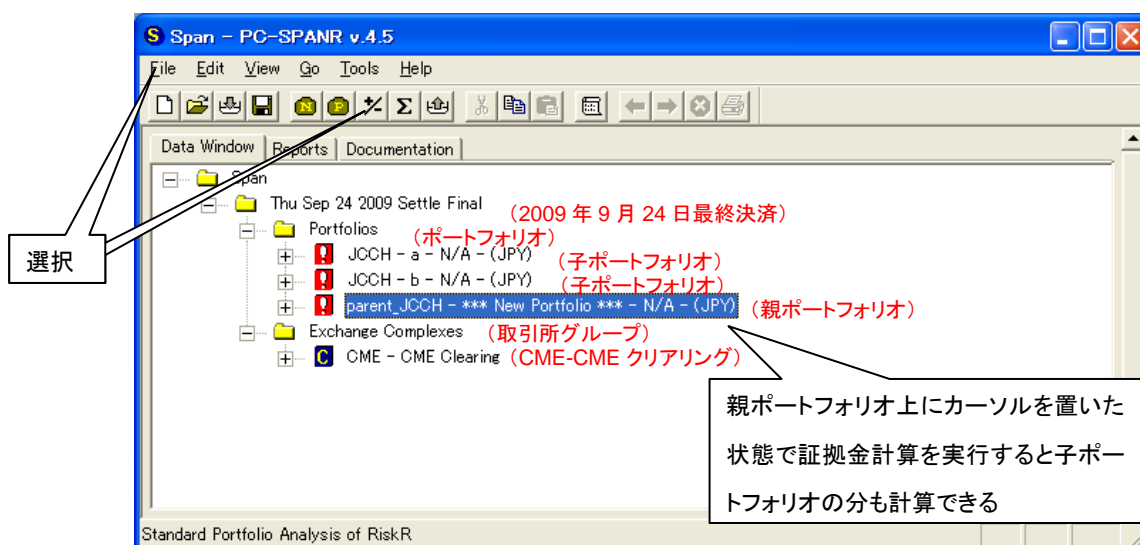


③親ポートフォリオの計算

親ポートフォリオを設定した場合は、親ポートフォリオの上にカーソルを置き、メニューバーアイコンのを押下するか、「File(ファイル)」→「Calculate Portfolio(s) Requirements(ポートフォリオの証拠金計算)」を選択して、証拠金計算を実行します。

親ポートフォリオの証拠金計算を実行すると、その配下に設定された全ての子ポートフォリオの証拠金計算をまとめて実行することができます。

例えば、ポートフォリオ”JCCH-a”と”JCCH-b”の親ポートフォリオに”parent_JCCH”が指定されている場合、”parent_JCCH”を選択して証拠金計算を実行すると、配下にある子ポートフォリオの”JCCH-a”と”JCCH-b”の証拠金計算も実行されます。



(2) 証拠金計算結果の確認

証拠金計算結果は、ポートフォリオ入力画面の「Performance Bond Requirements(証拠金計算結果)」タブで確認することができます。

「Maintenance Requirements(維持証拠金)」および「Initial Requirements(当初証拠金)」について、「SPAN Risk(スパンリスク額)」から「Available Net Option(ネット・オプション価値の総額)」を差し引いた額が、「Total Requirement(証拠金所要額)」として表示されます。

① 特定のポートフォリオを選択し証拠金計算を実行した場合

特定のポートフォリオを選択して証拠金結果を実行した場合は、以下のとおり証拠金計算結果が表示されます。

Category	Item	Value
Maintenance Requirements (維持証拠金)	SPAN Risk (SPAN リスク額)	3,352,705,831.79
	- Available Net Option (ネット オプション価値の総額)	1,403,426,739.49
	= Total Requirement (証拠金所要額)	1,949,279,092.30
Initial Requirements (当初証拠金)	SPAN Risk (SPAN リスク額)	4,526,152,918.55
	- Available Net Option (ネット オプション価値の総額)	1,403,426,739.49
	= Total Requirement (証拠金所要額)	3,122,726,179.06

(注)上記例では、CME が提供するリスクパラメータファイルにおいて当初/維持証拠金比率が設定されているため、当初証拠金が維持証拠金より多くなっていますが、当該比率が設定されていない場合(1 が設定されている場合)は、当初証拠金と維持証拠金は同額になります。

複数のポートフォリオをまとめて証拠金計算を実行した場合

複数のポートフォリオをまとめて証拠金計算を実行した場合は、計算結果は以下のようなプレッド・シートで表示されます。また表示したデータは、「Export Data(データ出力)」ボタンを押下することにより、csv ファイルで出力することができます。

Point In Time: Thu Sep 24 2009 Settle Final

Portfolio	Long Fut.Value	Short Fut.Value	Net Fut.Value	Long Opt.Value	Short Opt.Value	Net Opt.Value
JCCH - a - N/A - (JPY)	551,761,279.17	48,628,737,777.14	-48,076,976,497.97	1,403,426,742.75	0.00	1,403,426,742.75
JCCH - b - N/A - (JPY)	0.00	1,815,112,275,924.68	-1,815,112,275,924.68	105,544,809,142.46	0.00	105,544,809,142.46

(買い先物価値) (売り先物価値) (ネット・先物価値) (買いオプション価値) (売りオプション価値) (ネット・オプション価値)

Export Data OK

②親ポートフォリオの証拠金計算を実施した場合

親ポートフォリオの証拠金計算を実行した場合は、計算結果は以下のように、親ポートフォリオの計算結果は全ての子ポートフォリオの証拠金所要額を合算した額となります。

[子ポートフォリオ”JCCH-a”の証拠金計算結果]

JCCH - a - N/A - (JPY)

Performance Bond Class: Core

Maintenance Requirements

SPAN Risk: 256,570,545.60

- Available Net Option: 228,143,825.00

= Total Requirement: **a1** 28,426,720.60

Initial Requirements

SPAN Risk: 346,370,236.55

- Available Net Option: 228,143,825.00

= Total Requirement: **a2** 118,226,411.55

OK キャンセル 適用(A)

〔子ポートフォリオ”JCCH-b”の証拠金計算結果〕

Performance Bond Class: Core

Maintenance Requirements

SPAN Risk: 550,293,889,656.31

- Available Net Option: 2,843,281,659.80

= Total Requirement: **b1** 547,450,607,996.51

Initial Requirements

SPAN Risk: 742,896,764,177.10

- Available Net Option: 2,843,281,659.80

= Total Requirement: **b2** 740,053,482,517.30

OK キャンセル 適用(A)

〔親ポートフォリオ”parent_JCCH”の証拠金計算結果〕

Performance Bond Class: Core

Maintenance Requirements

SPAN Risk: 550,550,460,201.91

- Available Net Option: 3,071,425,484.80

= Total Requirement: 547,479,034,717.11

Initial Requirements

SPAN Risk: 743,243,134,413.65

- Available Net Option: 3,071,425,484.80

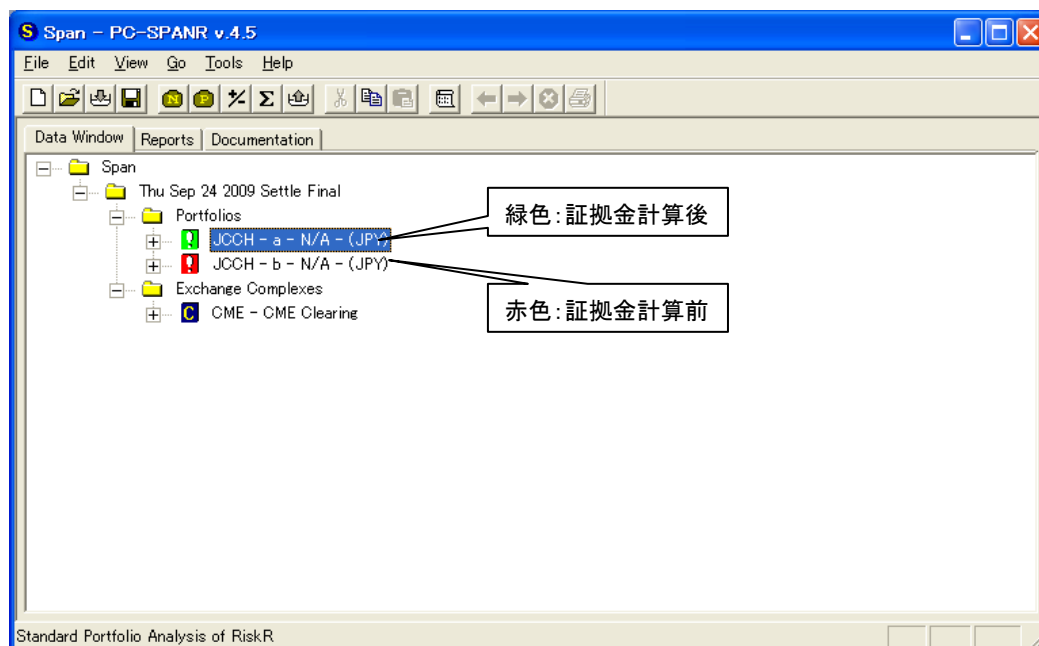
= Total Requirement: 740,171,708,928.85

OK キャンセル 適用(A)

子ポートフォリオの合算額 (a1+b1)になります。

子ポートフォリオの合算額 (a2+b2)になります。

証拠金計算実行後、証拠金計算画面の「OK」ボタンを押下しポートフォリオを閉じると、証拠金計算を実施済の当該ポートフォリオのアイコンは、赤色から緑色に変わります。



証拠金計算結果を取り消したい場合は、計算済(緑色)のポートフォリオ上にカーソルを置いた状態で右クリックし、「Clear Calculation Results(計算結果のクリア)」を選択すると、計算結果が取り消され、アイコンが計算前の赤色の状態に戻ります。「Portfolios(ポートフォリオ)」配下の全ての計算済(緑色)ポートフォリオの計算結果を計算前の状態に戻したい場合は、「Portfolios(ポートフォリオ)」の上にカーソルを置いた状態で右クリックし、「Clear Calculation Results(計算結果のクリア)」を選択します。

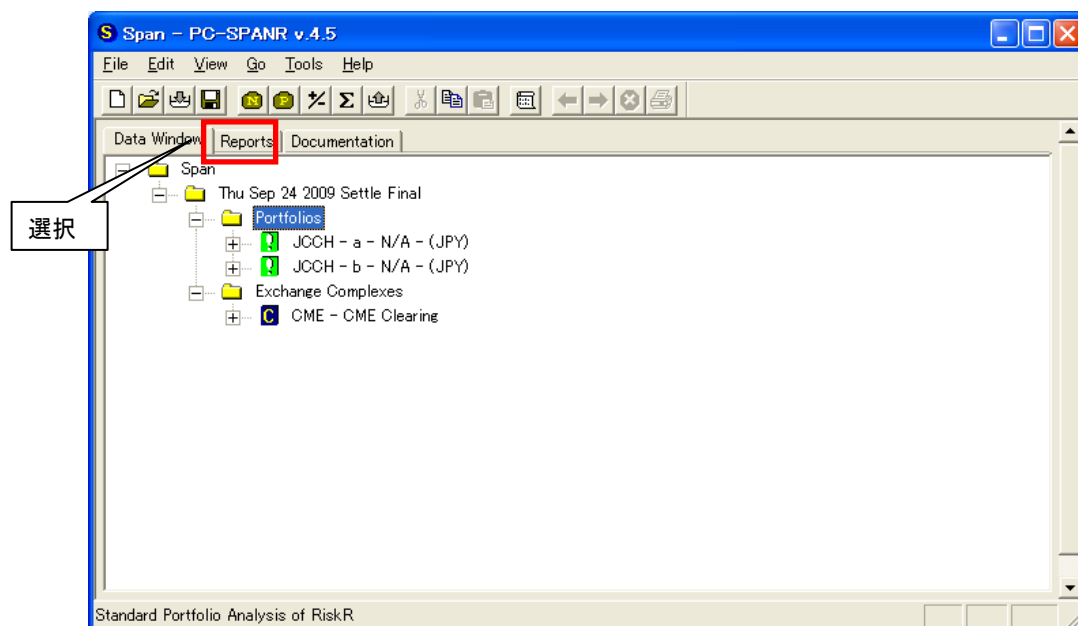
第7章 PC-SPAN のレポート機能

PC-SPAN でポートフォリオの所要額計算を実行すると、レポートが作成できるようになります。PC-SPAN でレポートを作成するには、PC-SPAN の基本画面「Reports(レポート)」タブを選択し画面から直接作成する方法と、PC-SPAN のユーティリティを利用して作成する方法との2種類があります。

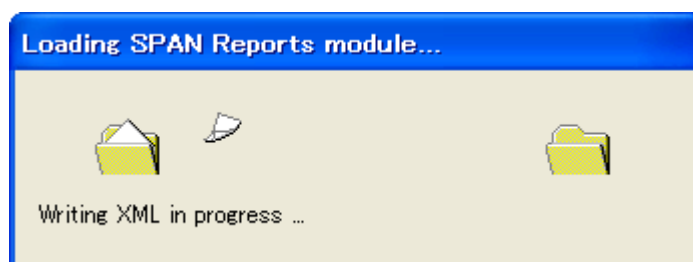
(1) PC-SPAN の「Reports(レポート)」タブから作成する方法

①「Reports(レポート)」タブの表示

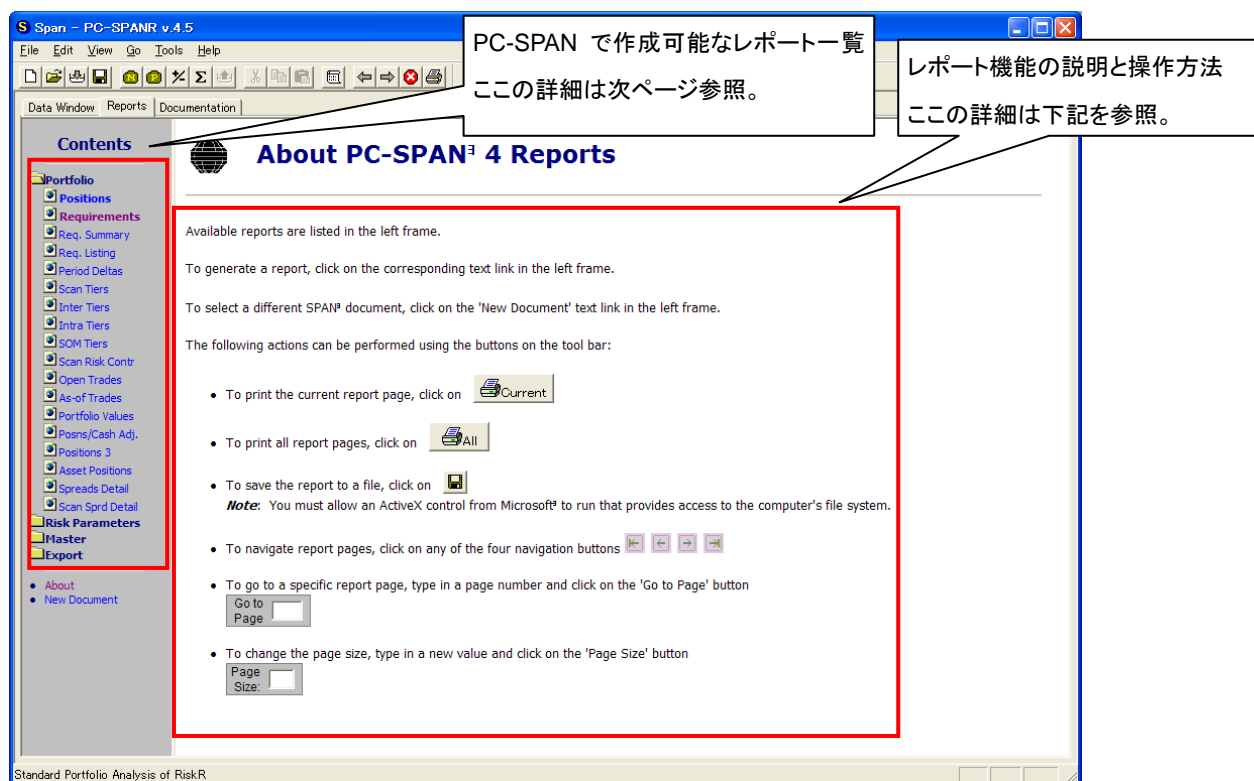
PC-SPAN でレポートを表示するには、PC-SPAN の「Reports(レポート)」タブを選択します。



「Reports(レポート)」タブを押下すると、以下のポップアップ画面が表示されます。



左側の「Contents (目次)」に作成可能なレポート一覧が表示されますので、表示したいレポートをメニューから選びクリックします。



※上図、About PC-SPAN4 Reports の内容 [レポートの基本操作方法]

左側の「Contents (目次)」に一覧表示されているレポートを作成することができます。

レポートを作成するには、左側の該当するテキストをクリックします。

別の SPAN ドキュメントを選択するには、左側の「New Document(新規ドキュメント)」をクリックします。

ツールバーのボタンを使って、以下の操作を行うことができます。

- 現在のページを印刷するときは、[Current] アイコンをクリックします。
- 全てのページを印刷するときは、[All]アイコンをクリックします。
- レポートをファイルに保存するときは、[FD の記号]アイコンをクリックします。
注意: コンピュータのファイルシステムにアクセスするためには、ActiveX コントロールを実行できるようにする必要があります。
- レポートページを移動するときは、[<] [←] [→] [>]のいずれかのボタンを使います。
- 特定のレポートページに移動するときは、ページ番号を入力して「Go to Page (ページに移動)」をクリックします。
- ページの大きさを変更するときは、新規の値を入力して、「Page Size(ページサイズ)」をクリックします。

(2) PC-SPAN で作成されるレポートの種類

PC-SPAN で作成できる主なレポートには、Portfolio (ポートフォリオ) レポートと Risk Parameters (リスク・パラメータ) レポートの2種類があります。

なお、ここでは主なものについて解説します。

① Portfolio (ポートフォリオ) レポート

Portfolio (ポートフォリオ) レポートには以下の種類があります。

i) 「Positions (ポジション・レポート)」

「Contents (目次)」の「Positions (ポジション)」を選択すると、ポートフォリオに含まれる商品について、詳細レポートが表示されます。

ii) 「Requirements (証拠金レポート)」

このレポートでは、選択したポートフォリオの証拠金計算結果の全体を表示します。

「Core Initial Requirements (当初証拠金額)」および「Core Maintenance Requirements (維持証拠金額)」などが表示され、後半部分では、清算機関または取引所単位の証拠金計算結果の詳細が表示されます。

(注) 当初／維持証拠金調整比率が設定されていない場合(1 が設定されている場合)は、当初証拠金と維持証拠金は同額になります。

iii) 「Req. Summary (証拠金サマリー・レポート)」

このレポートでは、前半部分には Requirement (証拠金レポート) と同じ内容が表示され、後半部分では、証拠金計算結果のサマリーが表示されます。

iv) 「Req. Listing (証拠金リスト・レポート)」

このレポートでは、ポートフォリオで設定した「Firm (ファーム)」、「Account (アカウント)」、「Currency (通貨)」ごとに SPAN により算出された証拠金所要額の一覧を表示します。

v) 「Period Deltas (デルタ・レポート)」

このレポートでは、商品グループの各限月ごとのポートフォリオのネットおよびグロスの元デルタ、商品内および商品間スプレッド後に残るデルタなどが表示されます。

vi) 「Scan Tier (スキャン・ティア・レポート)」

このレポートでは、商品グループごとのスキャン・リスク・シナリオの損益が表示され、最も大きな損害シナリオが特定されます。

vii) 「**Inter Tiers(商品間ティア・レポート)**」

このレポートでは、各商品グループの商品間スプレッド割引額が表示されます。さらに、スキャン・リスク、時間、ボラティリティ、価格、加重プライス・リスクごとの詳細も表示されます。

viii) 「**Intra Tiers(商品内ティア・レポート)**」

このレポートでは、各商品グループの商品内スプレッド・クレジット額が表示されます。さらに、Original(オリジナル・デルタ)および Remaining(残余デルタ)ごとの詳細も表示されます。

ix) 「**SOM Tiers(売りオプション最低証拠金額レポート)**」

このレポートでは、各商品グループの売りオプション最低証拠金額が表示されます。ポジションが売りポジションを含む場合は、売りオプション最低証拠金額を表示し、さらにコールおよびプットごとの売りオプションも表示します。

x) 「**Scan Risk Contr(ポジションレベルの証拠金所要額レポート)**」

このレポートでは、ポジションごとのアクティブ・シナリオの損益を表示しますので、ポジションレベルで証拠金所要額を見たい場合に役立ちます。なお、SPAN では、利益が負の値、損失が正の値で表示されますのでご注意ください。

②リスクパラメータ・レポート

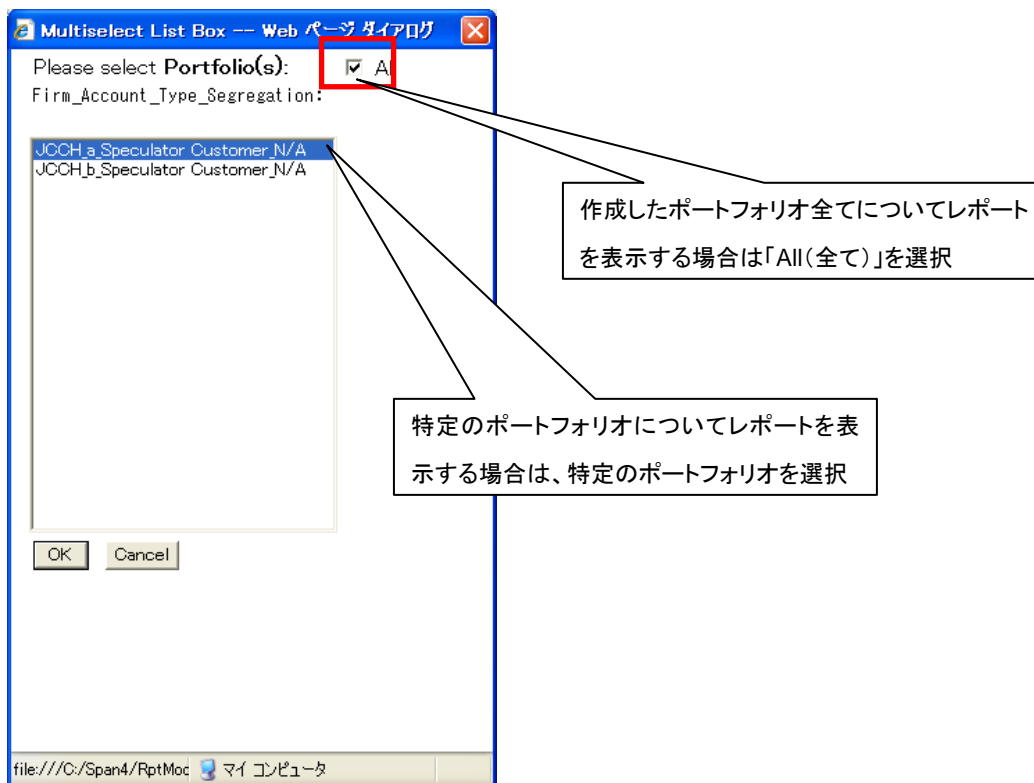
「Report(レポート)」タブの Risk Parameters Reports を選択すると、PC-SPANに読み込んだリスクパラメータファイルに設定されている各パラメータの内容を表示するレポート一覧が表示されます。

③レポートを作成するポートフォリオの選択

PC-SPAN に複数のポートフォリオが作成されている場合は、どのポートフォリオについてレポートを表示するかを問い合わせるポップアップ画面が表示されますので、全てのポートフォリオについて表示したい場合は「All(全て)」、特定のポートフォリオを表示したい場合は表示したいポートフォリオを選択して「OK」ボタンを押下します。

なお、PC-SPAN に1つのポートフォリオしか作成されていない場合は、表示したいレポートをメニューから選びクリックすると、ポップアップ画面が表示されずに、そのまま選択したレポートが表示されます。

〔複数のポートフォリオが作成されている場合〕



(3) スクリプトを実行してレポートを作成する方法

PC-SPAN には、画面からレポートを表示、作成する以外に、インタラクティブ・モードまたはバッチ・モードでレポートを作成するためのユーティリティプログラムが提供されています。

① PC-SPAN ユーティリティ (*SpanReporter*) のダウンロード

インタラクティブ・モードまたはバッチ・モードでレポートを作成するためには、PC-SPAN のユーティリティプログラム (*SpanReporter*) が必要になります。

SpanReporter を入手するには、PC-SPAN の購入後、PC-SPAN をダウンロードするために通知される URL にログオンし、PC-SPAN のユーティリティプログラム、*SpanReporter* をダウンロードします。

なお、*SpanReporter* を実行するには、あらかじめ Microsoft .NET Framework をインストールしておく必要があります。

② インタラクティブ・モードで作成できるレポート

インタラクティブ・モードでは、PC-SPAN のブラウザ画面で表示可能な以下のレポートなどを作成することが可能です。

- ポートフォリオ・レポート (XML ベースのレポート)。
 - Requirements (証拠金レポート)
 - Positions (ポジション・レポート)
- リスクパラメータ・レポート (XML ベースのレポート)
 - Exchange Rates (通貨変換レポート):
(PC-SPAN のブラウザで表示するレポートと同じ)

③ バッチ・モードで作成できるレポート

バッチ・モードでは、PC-SPAN のブラウザ画面で表示可能な以下の PDF / CSV フォーマットのいずれか1つまたはそれ以上のレポートを作成することができます。

- Requirements (証拠金レポート)
- Positions (ポジション・レポート)

④ 実行コマンド例

以下にインタラクティブ・モードまたはバッチ・モードでレポートを作成する場合のコマンド例を示します。

ユーティリティプログラムの *Risk Reporter*、入力ファイル(*.spn のファイル)、出力ファイル(レポートとして表示したいファイル名)が置かれたフォルダパスをそれぞれ指定し実行します。

【インタラクティブ・モードのコマンド例】

※Requirements(証拠金レポート)を CSV ファイルで作成する場合

```
C:\Span4\util\SpanReporter C:\Span4\Data\MySpan02.spn /PbReq
```

※Requirements(証拠金レポート)を PDF ファイルで作成する場合

```
C:\Span4\util\SpanReporter C:\Span4\Data\MySpan02.spn /PbReq_PDF
```

【バッチ・モードのコマンド例】

※Requirements(証拠金レポート)および Positions(ポジション・レポート)を作成する場合

```
C:\Program Files\CME\RiskReporter\RiskReporter.exe
```

```
C:\Span4\Data\MySpanDoc.spn /PbReq /NetPos
```

⑤ Risk Reporter 起動時の注意事項

- バッチ・モードでは、少なくとも1つの入力ファイルとレポートを特定する必要があります。
- 実行コマンドは、環境に応じて特定してください。
- バッチ・レポートは同時に複数作成することができます。
- インタラクティブ・モードでは、作成したレポートは全て Excel または PDF フォーマットにエクスポートすることができます。

(4) レポートの印刷および保存

PC-SPAN で作成したレポートは印刷、および保管先を指定して保存することができます。

① レポートの印刷

表示されているレポートを印刷する場合は、メニューバーの **Current** アイコンをクリックし印刷します。レポートが複数ページに渡る場合で全てのページを印刷する場合はメニューバーの **All** アイコンをクリックし、印刷します。


(レポートの全ページ数は、メニューバーの「Page(ページ)」欄に表示されます。)


②レポートの保存


レポートを保存する場合は、メニューバーの FD アイコンをクリックし、保存します。デフォルトでは、PC-SPAN がインストールされている「C:\¥Span4¥Reports」フォルダに html ファイルとして保存されますが、任意の場所または名前を指定することもできます。


③複数ページに渡るレポートの表示

作成したレポートが複数ページに渡る場合、メニューバーの矢印アイコンをクリックすると、以下のとおりページを移動することができます。

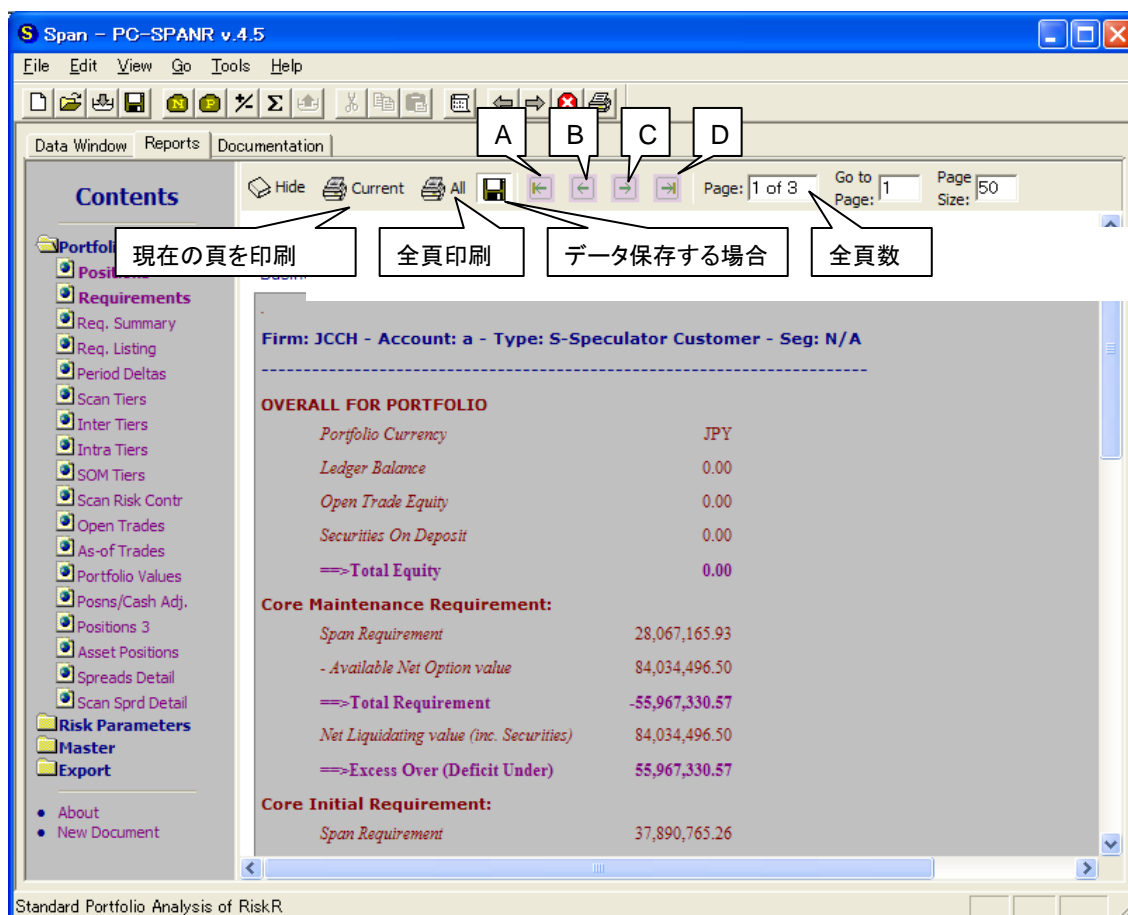
“A”の  アイコンをクリックすると、最初のページに移動します。

“B”の  アイコンをクリックすると、前のページを表示します。

“C”の  アイコンをクリックすると、次のページを表示します。

“D”の  アイコンをクリックすると、最後のページを表示します。

[レポートメニュー画面]



第8章 ポートフォリオ・データの保存

作成したポートフォリオ・データは保存することができます。また、保存したデータはリスクパラメータファイルを読み込む方法と同じ方法で、PC-SPAN に読み込み、保存した状態から再び利用することもできます。ポートフォリオ・データの保存には、SPANドキュメントとして全データを保存する方法と、ポジション・データのみを保存する方法の2つの方法があります。

(1) SPANドキュメントとして全データを保存する方法

SPANドキュメントとして作成したポートフォリオ・データを保存するには、メニューバーの「File (ファイル)」→「Save (保存)」または「Save As (~として保存)」をクリックするか、メニューバーのFDアイコンをクリックします。(前者の操作で初めてSPANドキュメントとして保存する場合は、「Save As (~として保存)」を選択してください。)

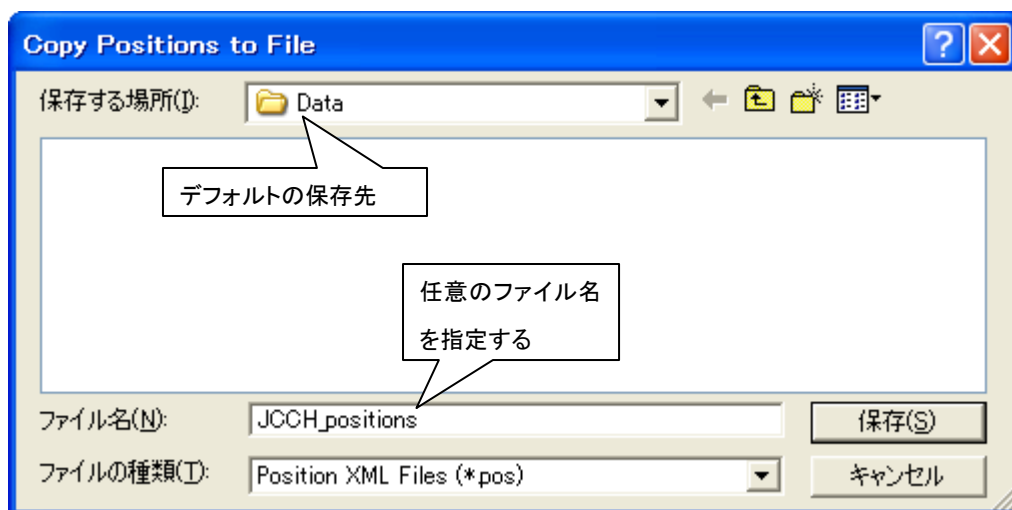
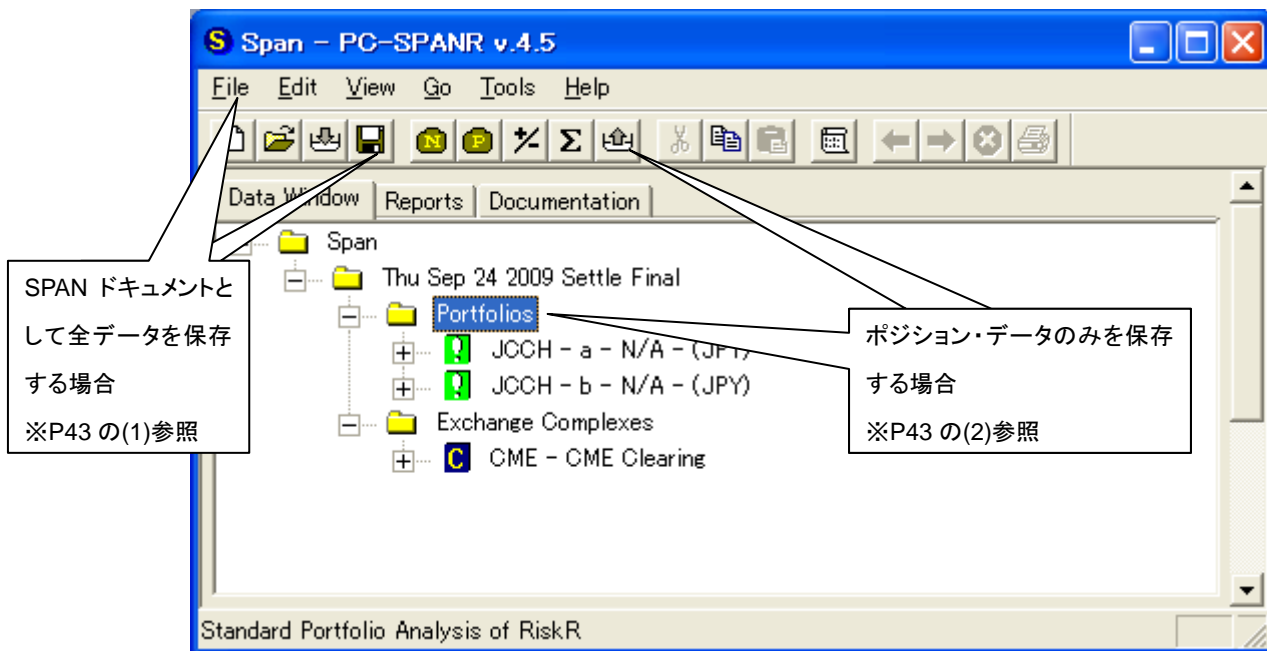
デフォルトのファイル名は”SPAN.spn”、デフォルトの保存先はPC-SPANがインストールされているフォルダ配下の”Data”となっていますが、任意の名称および保存先を指定することもできます。

この方法で保存したデータは、再びPC-SPANに読み込むだけですぐに利用することができますが、保存するデータ量は増大します。

(2) ポジション・データのみを保存する方法

ポジション・データだけを保存するには、配下に作成したポートフォリオのポジション・データを全て保存する場合は「Portfolios (ポートフォリオ)」を選択、または「Portfolios (ポートフォリオ)」配下のポジション・データを保存したい任意のポートフォリオ上にカーソルを置いた状態で右クリックし、「Copy Positions to File (ポジションをファイルにコピーする)」を選択するか、メニューバーの保存アイコンをクリックし、任意のファイル名を入力して「保存(s)」ボタンを押下します。デフォルトの保存先は、PC-SPANがインストールされているフォルダ配下の”Data”となっていますが、任意の保存先を指定することもできます。

この方法で保存したデータをPC-SPANに読み込み利用するには、データを読み込む前にあらかじめ当該ポートフォリオを作成した時点のリスクパラメータファイルを読み込んでおく必要がありますが、SPANドキュメントとして全データを保存する場合に比べて、保存するデータ量は減少します。



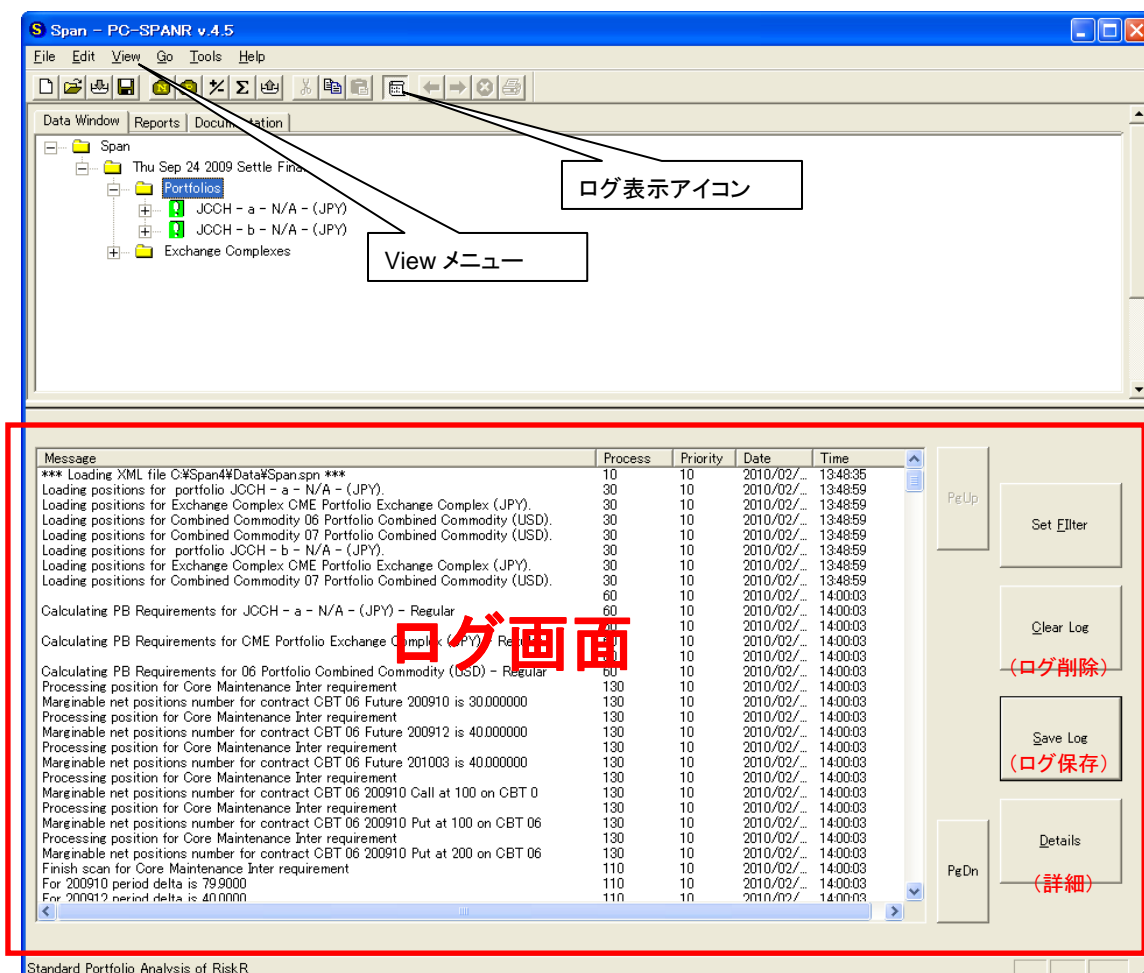
第9章 その他の機能

これまで本マニュアルで説明してきた機能のほかに、PC-SPAN には以下の機能があります。

(1) ログの参照および保存機能

PC-SPAN の操作ログを見るためには、メニューバー「View(閲覧)」→「Log(ログ)」を選択するか、メニューバーのログ表示アイコンをクリックすると、PC-SPAN の画面下に操作ログが表示されます。操作ログ画面の右側にある「Save Log(ログ保存)」をクリックすると、ログファイルとして任意のファイル名で保存することができます。デフォルトの保存先は PC-SPAN がインストールされているフォルダ配下の「Data」となっていますが、任意の名称および保存先を指定することもできます。

操作ログ画面の右側にある「Clear Log(ログ削除)」をクリックすると表示されているログが削除され、「Details(詳細)」をクリックするとログの詳細が表示されます。



操作ログの表示を消す場合は、メニューバー「View(閲覧)」→「Log(ログ)」のチェックをはずすか、メニューバーのログ表示アイコンをクリックすると、表示画面が解除されます。

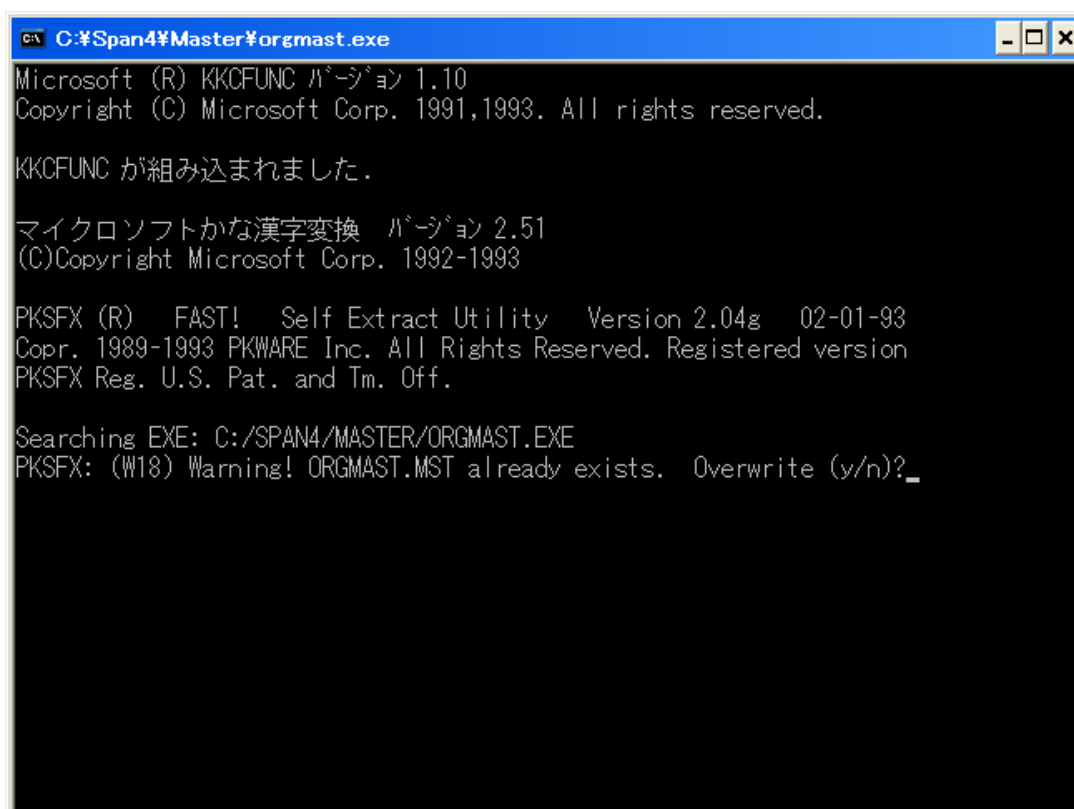
(2) オーガニゼーション・マスタ・ファイルの編集および更新

PC-SPAN をインストールすると、通常「C:¥SPAN4¥Master」にオーガニゼーション・マスタ・ファイル (orgmast.mst) ができます。オーガニゼーション・マスタ・ファイルには、アカウントタイプ情報や通貨などポートフォリオの作成に必要となる基礎データが含まれています。

オーガニゼーション・マスタ・ファイルは、以下の CME Web サイトをクリックすると、exe ファイル (orgmast.exe) のダウンロード画面が表示されますので、「保存」を選択し、現在オーガニゼーション・マスタ・ファイルが置かれているフォルダに保存します。

- ・ CME Web サイト (ftp://ftp.cme.com/pub/span/util)

orgmast.exe ファイルを実行すると以下の画面が表示されます。「Warning! ORGMAST.MST already exists. Overwrite (y/n)? (警告！オーガニゼーション・マスタ・ファイルは既に存在します。上書きしますか?)」と聞かれますので、更新する場合は「y(はい)」を入力します。



```
C:\Span4\Master\orgmast.exe
Microsoft (R) KKCFUNC バージョン 1.10
Copyright (C) Microsoft Corp. 1991,1993. All rights reserved.

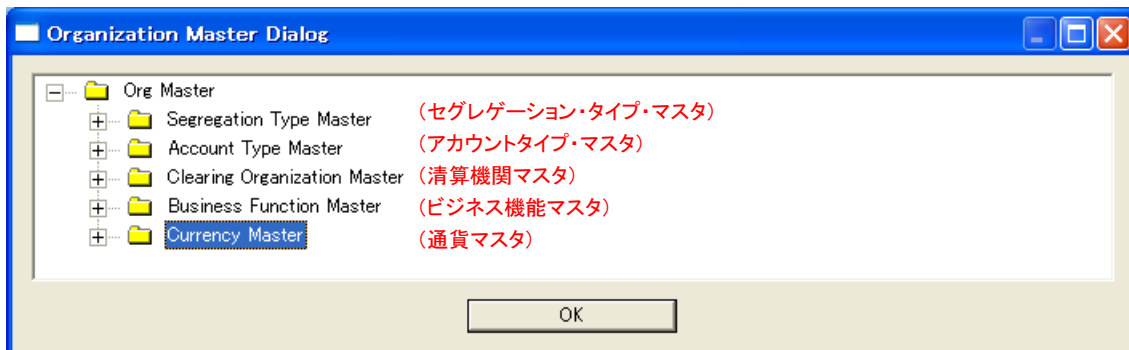
KKCFUNC が組み込まれました。

マイクロソフトかな漢字変換 バージョン 2.51
(C)Copyright Microsoft Corp. 1992-1993

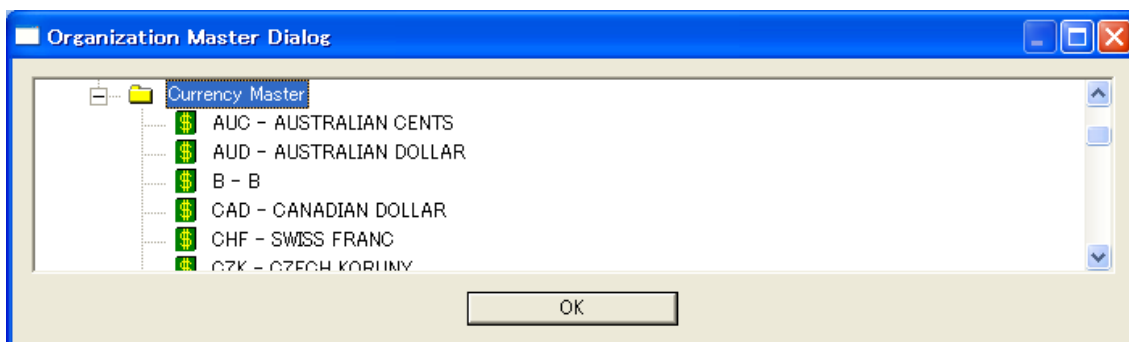
PKSFX (R) FAST! Self Extract Utility Version 2.04g 02-01-93
Copr. 1989-1993 PKWARE Inc. All Rights Reserved. Registered version
PKSFX Reg. U.S. Pat. and Tm. Off.

Searching EXE: C:/SPAN4/MASTER/ORGMAST.EXE
PKSFX: (W18) Warning! ORGMAST.MST already exists. Overwrite (y/n)?_
```

オーガニゼーション・マスタ・ファイルの内容は手動で変更することもできます。例えば、英語の通貨表示を日本語にする場合は、メニューバーから「Tools(ツール)」→「Organization Master (オーガニゼーション・マスタ)」を選択すると、Org Master フォルダが表示されます。



「Currency Master(通貨マスタ)」フォルダを開くと、その配下に通貨一覧が表示されます。



次に、変更したい通貨名をダブルクリックします。



変更したい通貨名をダブルクリックすると以下のとおり変更画面が表示されますので、変更したい表示名を入力し、「OK」ボタンを押下します。

The screenshot shows a dialog box titled "JPY - JPY" with a close button in the top right corner. The dialog contains the following fields and labels:

- ISO Currency Code: JPY (ISO 通貨コード)
- One Character Currency Code: Y (1文字通貨コード)
- Currency Name: 日本円 (通貨名)
- Number of Decimal Positions: 2 (小数桁数)

Callouts indicate that the "Currency Name" field is selected and that the user should enter the desired name. At the bottom, there are three buttons: "OK", "キャンセル", and "適用(A)".

「Do you want to save changes to the Master database? (変更をマスターデータベースに保存しますか?)」と問い合わせるポップアップ画面が表示されるので、変更を保存する場合は「はい(Y)」を選択します。

The screenshot shows a confirmation dialog box titled "Span 4" with a close button in the top right corner. It features a yellow warning icon and the text: "Do you want to save changes to the Master database?". Below the text are two buttons: "はい(Y)" and "いいえ(N)".

最後に、「Would you like to create a backup copy of the Organization Master database? (オーガニゼーション・マスター・ファイルのバックアップを保存しますか?)」と問い合わせるポップアップ画面が表示されるので、保存する場合は「はい(Y)」、保存しない場合は「いいえ(N)」を選択します。

The screenshot shows a confirmation dialog box titled "Span 4" with a close button in the top right corner. It features a yellow warning icon and the text: "Would you like to create a backup copy of the Organization Master database?". Below the text are two buttons: "はい(Y)" and "いいえ(N)".

(3) Preference(プリファレンス)の設定

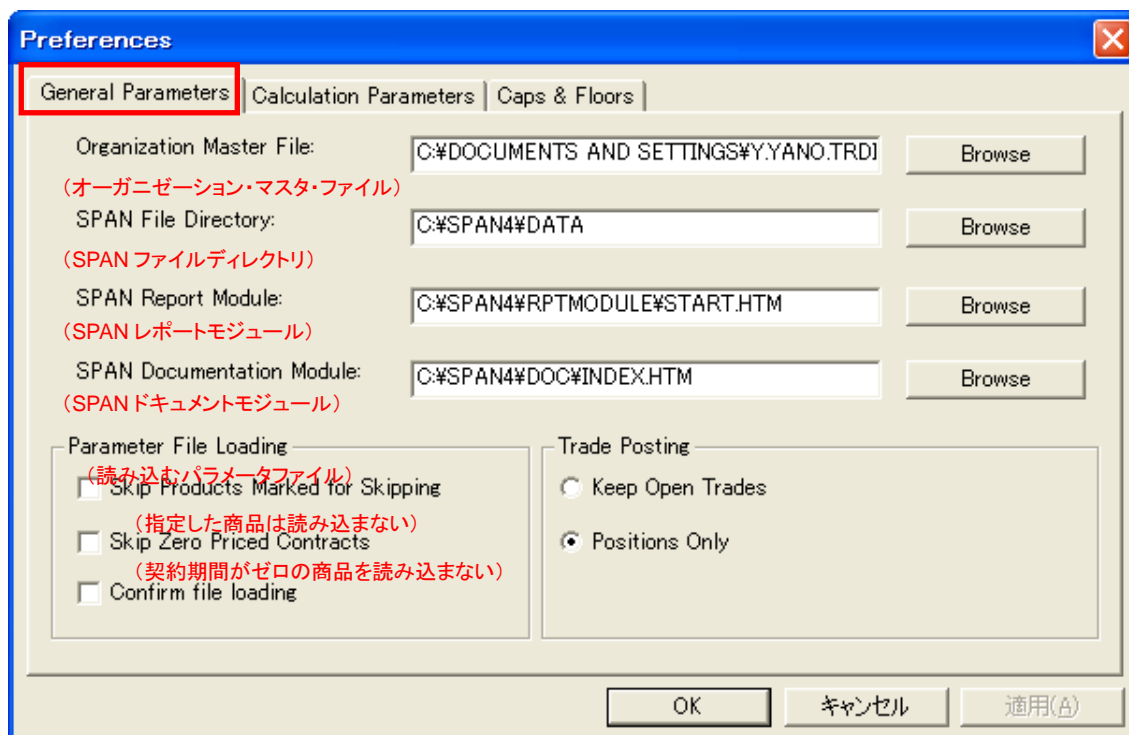
PC-SPAN の「Preference(プリファレンス)」タブには、さらに「General Parameters(共通パラメータ)」および「Calculation parameters(計算パラメータ)」の2つの設定タブがあります。

①「General Parameters(共通パラメータ)」タブの設定

「General Parameters(共通パラメータ)」タブでは以下の内容を設定することができます。(ただし、初めて PC-SPAN をインストールし利用する場合は、通常、デフォルト設定のまま利用できます。)

- Organization Master File (オーガニゼーション・マスタ・ファイル)
オーガニゼーション・マスタ・ファイルのフルパスとファイル名
- SPAN File Directory (SPAN ファイルディレクトリ)
SPAN リスク・パラメータを読み込む際に PC SPAN が参照するデフォルトのディレクトリ
- SPAN Report Module (SPAN レポートモジュール)
SPAN Report Module(SPAN レポートモジュール)のメインページのフルパスとファイル名
- SPAN Documentation Module(SPAN ドキュメントモジュール)
SPAN Documentation Module(SPAN ドキュメントモジュール)のメインページのフルパスとファイル名
- Parameter File Loading (パラメータファイルの読み込み)
 - Skip Product Marked for Skipping(指定した商品は読み込まない)
オーガニゼーションファイルの中で「marked for skipping(読み飛ばす)」とマークされた商品を指定し、リスクパラメータファイルの読み込みの際、指定された商品は無視されます。特定の取引所や清算機関の特定の商品以外のものを無視したい場合などに、この機能を利用することができます。
 - Skip Zero Period Contracts(契約期間が0の商品は読み込まない)
SPAN ファイルの中で、価格がゼロの商品を指定し、SPAN ファイルが読み込まれる際に、指定された商品は無視されます。

[General Parameters(共通パラメータ)設定画面]



※JCCH で使う項目のみ日本語訳を併記しています。

②「Calculation Parameters(計算パラメータ)」タブの設定

「Calculation Parameters(計算パラメータ)」タブでは以下の内容を設定することができます。
(ただし、初めて PC-SPAN をインストールし利用する場合は、デフォルト設定のままで利用できます。)

- Native Currency(自国通貨)
ポートフォリオで使用するデフォルトの値です。各ポートフォリオの証拠金所要額を日本円で表示したければ、「JPY(日本円)」を設定します。
- Conversion Currency(換算通貨)
クロス・レートで使用する単一通貨です。例えば、あるポートフォリオの商品グループの証拠金額が CAD(カナダドル)で、そのポートフォリオの通貨が JPY(日本円)、換算通貨が USD(米ドル)の場合、まず CAD から USD に変換され、USD から JPY に換算されます。

- To Convert to Native Currency (本国通貨に換算)

本国通貨に換算する際に PC-SPAN が使用する換算レートをどのように入手するかを指定します。

-Use Rate from SPAN File (リスクパラメータファイルに含まれるレートを使用)

リスクパラメータファイルの商品グループにある清算機関の通貨換算レートが使用されま

す。

-Use This Rate (このレートを使う)

任意の換算レートを入力すると、その値を適用することが出来ます。

- Logging (ログ取得)

取得したいイベントログを特定します。

-Severity (重要度)

証拠金所要額の計算の間に起きたエラーや警告をどのように処理するかを指定します。

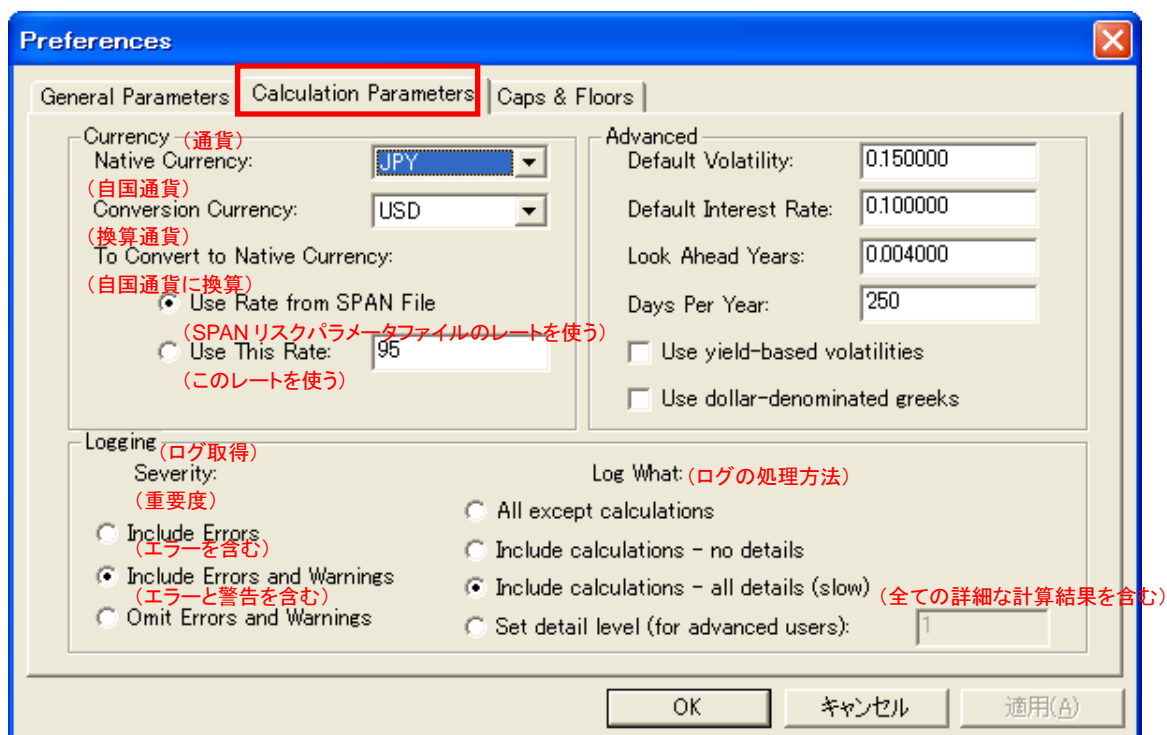
(通常は「Include Errors and Warnings (エラーと警告を含む)」を選択してください。)

-Log What (ログの処理方法)

証拠金所要額の計算時に発生したエラーおよび警告の処理方法を指定できます。

PC-SPAN では、リスクパラメータファイルやポジション・ファイルのダウンロードの間に起きた異常時のイベントを記録します。

(通常は「Include calculations - all details (slow) (全ての詳細な計算結果を含む)」を選択してください。)



※JCCH で使う項目のみ日本語訳を併記しています。

第10章 スクリプト・ユーティリティ

(1) スクリプト・ユーティリティ

PC-SPAN のスクリプト・コンポーネントは **spanit** と呼ばれ、本体とは別の機能として利用できません。このスクリプト・コンポーネントは、以下のコマンドを入力することでコマンドラインまたはバッチファイルから呼び出すことができます。

SPANIT *file Name*

このファイル名 (*file Name*) には、スクリプト・ファイルのフルパス名を指定します。スクリプト・コンポーネントは、スクリプト・ファイルの中でコマンドを実行し、実行成功時には0、実行失敗時には1を返します。

(2) スクリプトの一般的なルール

スクリプトは通常の ASCII ファイルで書かれなくてはなりません。ファイルシステムにより設けられる規制を除いて、ファイル名をつける上で制限はありません。全てのファイルコマンドは、別々の行に記述します。コマンドのパラメータは、コンマで区切ります。パラメータ間の区切りスペースおよびコマンド間の空白行には制限はありません。

コメントは、別の行に記述してください。コマンドキーワード以外で始まる行はコメントとみなされますが、コメント行は“//”で始めるようにしてください。全てのコマンドは本マニュアルの記載どおりに入力することを推奨します。全てのコマンドの最後の有効なパラメータの後にあるテキストは無視されますが、スクリプトの処理速度低下等を招くので、コメントの書き方としては推奨しません。

(3) SPANIT で有効なコマンド

① PC-SPAN に *fileName* で指定したファイルを読み込むコマンド

PC-SPAN にファイルを読み込むためにはこのコマンドを使います。このコマンドは、すべてのファイル形式 (*par, *.pa2, .txt (ポジション・ファイル), XML) をサポートしています。NOREPLACE フラグは PC-SPAN が既にダウンロードされている清算機関をファイルから読み込んだ清算機関に置き換えない場合に使用します。(デフォルト設定では置き換えます。)

ポジション・ファイル(.txt または XML 形式=*pos)を読み込む場合には、任意設定のパラメータを利用できます。Span4 の拡張様式で*.txt ポジション・ファイルを読み込み、この様式 (XML ファイルの中にリスクパラメータファイルを持つ様式) のまま利用したいときには、USEXTLAYOUT フラグが利用できます。

そのほかのパラメータでポジションを読み込む(計算を行う)point in time(ポイント・イン・タイム)を指定します。特にパラメータを指定しなければ、ポジションはファイルの中で指定されている point in time(ポイント・イン・タイム)のデータが適宜読み込まれます。ファイルに point in

time(ポイント・イン・タイム)が指定されていない場合は、最初に使われた point in time(ポイント・イン・タイム)が使われます。なお、多くの場合は、日付だけから point in time(ポイント・イン・タイム)を明確にすることができるので、必ずしも point in time(ポイント・イン・タイム)を全て指定する必要はありません。

```
Load fileName [(,NOREPLACE |,USEXTLAYOUT)][,busDate [,settleFlag [(,finalFlag | ,busTime)[, description]]]]
```

上記コマンドにおける各パラメータの記載項目は以下の通りです。

- *fileName*(ファイル名): 読み込みファイルのフルパス名(必須)
- *busDate*(営業日): YYYYMMDD フォーマット(任意)
- *settleFlag*(決済フラグ): S(=最終)、I(=日中)(任意)
- *finalFlag*(最終フラグ): E(=緊急)、F(=通常)(任意)
- *busTime*(営業時刻): HHMM フォーマット(任意)
- *description*(記述): point in time(ポイント・イン・タイム)(任意)

②PC-SPAN に読み込まれたポートフォリオを計算するコマンド

PC-SPAN に読み込まれたポートフォリオを計算するためにはこのコマンドを使います。パラメータが指定されなければすべてのポートフォリオについて計算を行います。point in time(ポイント・イン・タイム)を指定するパラメータがあれば、指定された point in time(ポイント・イン・タイム)に係るポートフォリオだけが計算されます。多くの場合、point in time(ポイント・イン・タイム)を特定するには日付だけで十分なので、必ずしも point in time(ポイント・イン・タイム)を完全に指定する必要はありません。もし、point in time(ポイント・イン・タイム)に加えて、特定のポートフォリオを指定するパラメータがあれば、指定された point in time(ポイント・イン・タイム)のうち関係のあるポートフォリオについてのみ計算を行います。

```
Calc [busDate [,settleFlag [(,finalFlag | ,busTime)[, description]]]] [(,]PORTFOLIO [,firmCode [,acctCode [,segType]]]]
```

上記コマンドにおける各パラメータの記載項目は以下の通りです。

- *busDate*(営業日): YYYYMMDD フォーマット(任意)
- *settleFlag*(決済フラグ): S(=最終)、I(=日中)(任意)
- *finalFlag*(最終フラグ): E(=緊急)、F(=通常)(任意)
- *busTime*(営業時刻): HHMM フォーマット(任意)
- *description*(記述): point in time(ポイント・イン・タイム)(任意)
- *firmCode*(ファーム・コード): ポートフォリオのファーム・コード(任意)
- *acctCode*(アカウント・コード): ポートフォリオのアカウント・コード(任意)
- *segType*(セグメント・タイプ): ポートフォリオの CUST または HOUS の識別(任意)

③PC-SPAN に読み込まれたポートフォリオを削除するコマンド

PC-SPAN に読み込まれたポートフォリオとリスクパラメータファイルを削除するためにはこのコマンドを使います。もし任意のパラメータが設定されなければ、すべてのポートフォリオとリスクアレイ値が削除されます。point in time(ポイント・イン・タイム)を指定するパラメータがあれば、指定されたpoint in time(ポイント・イン・タイム)に関するものだけが削除されます。ほとんどの場合、日付だけで point in time(ポイント・イン・タイム)が特定されるため、必ずしも point in time(ポイント・イン・タイム)を完全に指定する必要はありません。point in time(ポイント・イン・タイム)のほかに特定のポートフォリオを指定するパラメータがあれば、指定された point in time(ポイント・イン・タイム)のうち、関係のあるポートフォリオについてのみ削除を行います。

```
Delete [busDate [,settleFlag [(,finalFlag | ,busTime)[, description]]]] [[,]PORTFOLIO [,firmCode [,acctCode [,segType]]]]
```

上記コマンドにおける各パラメータの記載項目は以下の通りです。

- *busDate*(営業日):YYYYMMDD フォーマット(任意)
- *settleFlag*(決済フラグ):S(=最終)、I(=日中)(任意)
- *finalFlag*(最終フラグ):E(=緊急)、F(=通常)(任意)
- *busTime*(営業時刻):HHMM フォーマット
- *description*(記述):point in time(ポイント・イン・タイム)(任意)
- *firmCode*(ファーム・コード):ポートフォリオのファーム・コード(任意)
- *acctCode*(アカウント・コード):ポートフォリオのアカウント・コード(任意)
- *segType*(セグメント・タイプ):ポートフォリオの CUST または HOUS の識別(任意)

④PC-SPAN の計算結果をファイルに保存するコマンド

PC-SPAN の計算結果を XML 形式のファイルに保存するために使います。

```
Save fileName
```

fileName には、読み込みファイルの完全なファイル名を指定します。ファイルは XML ファイル形式で保存されます。(ファイル名は必須)

⑤PC-SPAN のログを取得するコマンド

PC-SPAN のログ取得に係るパラメータを指定するためにはこのコマンドを使います。記述する場所は問いません。パラメータとして設定可能な値は、(プロセス・リミットに関して)

```
PROC_ID_LOAD_RISK =10
PROC_ID_LOAD_POS =20
PROC_ID_LOAD_XML =30
PROC_ID_OMNIBUS =40
PROC_ID_CALC_START =51
PROC_ID_CALC_PBOND =60
PROC_ID_CALC_SPREAD =70
PROC_ID_CALC_LIQ_RISK =80
PROC_ID_CALC_DETAIL_START =101
PROC_ID_CALC_SPREAD_DETAIL =110
PROC_ID_CALC_LIQ_RISK_DETAIL =120
PROC_ID_CALC_POS_DETAIL =130
PROC_ID_UPPER =-1
```

(プライオリティ・リミットに関して)

```
PRIORITY_ID_LOW =-1
PRIORITY_ID_NORMAL =10
PRIORITY_ID_WARNING =20
PRIORITY_ID_ERROR =30
```

* デフォルトでは 0 と 30(エラーだけがログ取得されます)。

Log [processLimit][,priorityLimit]

上記コマンドにおける各パラメータの記載項目は以下の通りです。

- *processLimit*(プロセス・リミット) : ログメッセージのプロセス ID の上限(必須)
- *priorityLimit*(プライオリティ・リミット) : ログメッセージ優先度の下限(任意)

⑥取得ログをファイルに保存するコマンド

PC-SPAN ログを保存するのに使います。このコマンドは、スクリプト中の好きな場所に入れることができます。

LogSave fileName

*fileName*には、ログファイルの完全なファイル名を指定します。このコマンドは、スクリプト内であればどこに記述してもかまいません。(ファイル名は必須)