

# 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22年12月30日作成  
第2版

「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、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たレコード・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。

- ・レコードタイプ0
- ・レコードタイプT
- ・レコードタイプ1

以降、商品グループ単位に以下のレコードタイプが続きます。商品グループは名前でソートされます。

- ・レコードタイプ2
- ・レコードタイプS
- ・レコードタイプ3
- ・レコードタイプC(スプレッド単位に複数レコード)
- ・レコードタイプ4(1つのレコードに設定できる決済日は2つまで。それ以上になる場合は複数レコード)
- ・レコードタイプB(商品及び決済日ごとに1レコード。以下の順にソート)
  - ・商品コード
  - ・先物決済月(※)
  - ・オプション決済月
- ・レコードタイプ5(商品グループ群コードでソート)
- ・レコードタイプ6(商品グループコードとスプレッド優先順位でソート)
- ・レコードタイプ81/82(商品コード、先物決済月、オプション決済月、オプション区分及びオプション権利行使価格でソート)

※ 決済月とは、決済日(納会日)が属する暦月です。取引所で定める各商品の「限月」とは異なります。

## 2. 各レコード・タイプにおけるフォーマット記載例

- A - アルファベット(A~Z)
- N - 数字(整数1~9)
- n - 数字(小数点以下0~9)
- X - 英数字

- ・“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。
- ・数字の項目は右寄せ、それ以外の項目は左寄せで表示されます。
- ・最後のレコード項目が終わると、行末文字を除いて、文字は一切表示されません
- ・レコード中の使用しない項目は、“fill”と定義されており、空欄となります。(“fill”項目は、全て空欄です。)
- ・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のリスク・パラメータ・ファイルで使用しない項目は、当該項目がレコードの途中に存在する場合は“fill”(空欄)項目に置き換えられ、当該項目がレコード末にある場合は、その項目以降は全て削除されています。
- ・ある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。

# 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"(数字+スペース)
清算機関略称	Clearing organization acronym	3	6	XXXXXX	"JCCH"
営業日	Business date	9	8	NNNNNNNN	CCYYMMDD(西暦年月日)
取引終了後/日中	Settlement or Intraday	17	1	X	"S"又は"I"
ファイル種別	File identifier	18	2	XX	"E" -アーリーファイル "F" -ファイナルファイル
営業日時刻	Business time	20	4	NNNN	HHMM(時分)
ファイル作成日	File creation date	24	8	NNNNNNNN	CCYYMMDD(西暦年月日)
ファイル作成時刻	File creation time	32	4	NNNN	HHMM(時分)
ファイルフォーマット	File format	36	2	XX	"U2" - 拡張フォーマット
予備	fill	38	13		
清算機関/顧客コード	Clearing or Customer code	51	1	X	"A" - 清算コード "C" - 顧客コード
予備	fill	52	1		
清算機関/顧客略称名	Clearing or Customer Acronym	53	5	XXXXX	"CLR" 清算機関 "CUST" 顧客

# 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" (数字 + スペース)
取引所略称	Exchange acronym	3	3	XXX	"TC"
予備	fill	6	2		
取引所コード	Exchange code	8	2	XX	"TC"

# 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" (数字 + スペース)
取引所略称	Exchange acronym	3	3	XXX	"TC"
予備	fill	6	1		
商品グループコード	Combined commodity code	7	6	XXXXXX	設定値
リスク乗数	Risk exponent	13	1	N	設定値
証拠金通貨	Performance bond currency	14	3	XXX	当該商品グループに使われる通貨(※)
証拠金通貨コード	Performance bond currency code	17	1	X	上記通貨名の略称名(※)
オプション証拠金スタイル	Option Margin Style	18	1	X	"P" – premium (プレミアム) "F" 又は空欄 – futures (先物)
オプション価値制限	Limit option value	19	1	X	"Y" 又は"N"
予備	fill	20	3		
商品コード1	Commodity code 1	23	10	XXX...XXXX	設定値
商品タイプ1	Contract type 1	33	3	XXX	"FUT" – Futures (先物) "PHY" – Physical (Spot) (現物) "OOF" – Option on Future (先物オプション) "OOP" – Option on Physical (現物オプション)
予備	fill	36	3		
商品コード2	Commodity code 2	39	10	XXX...XXXX	
商品タイプ2	Contract type 2	49	3	XXX	"FUT", "PHY", "OOF", "OOP"
予備	fill	52	3		
商品コード3	Commodity code 3	55	10	XXX...XXXX	
商品タイプ3	Contract type 3	65	3	XXX	"FUT", "PHY", "OOF", "OOP"
予備	fill	68	3		
商品コード4	Commodity code 4	71	10	XXX...XXXX	
商品タイプ4	Contract type 4	81	3	XXX	"FUT", "PHY", "OOF", "OOP"
予備	fill	84	3		
商品コード5	Commodity code 5	87	10	XXX...XXXX	
商品タイプ5	Contract type 5	97	3	XXX	"FUT", "PHY", "OOF", "OOP"
予備	fill	100	3		
商品コード6	Commodity code 6	103	10	XXX...XXXX	
商品タイプ6	Contract type 6	113	3	XXX	"FUT", "PHY", "OOF", "OOP"

### 【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。

※ Performance bond currency (証拠金通貨) と Performance bond currency code (証拠金通貨コード) には、レコードタイプTの表の値が設定されます。

# Record Type3 (レコードタイプ3)

## Inter Month Spread(限月間スプレッド)

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	"3"(数字 + スペース)
商品グループコード	Combined commodity code	3	6	XXXXXX	
商品内スプレッド割増額のメソッドコード	Intracommodity spread charge method code	9	2	XX	ティアがない場合"01"、それ以外は"10"(※)
ティア番号-ティア1	Tier number – Tier 1	11	2	NN	
開始月-ティア1	Starting contract month – Tier 1	13	6	NNNNNN	CCYYMM(西暦年月)
終了月-ティア1	Ending contract month – Tier 1	19	6	NNNNNN	CCYYMM(西暦年月)
ティア番号-ティア2	Tier number – Tier 2	25	2	NN	
開始月-ティア2	Starting contract month – Tier 2	27	6	NNNNNN	CCYYMM(西暦年月)
終了月-ティア2	Ending contract month – Tier 2	33	6	NNNNNN	CCYYMM(西暦年月)
ティア番号-ティア3	Tier number – Tier 3	39	2	NN	
開始月-ティア3	Starting contract month – Tier 3	41	6	NNNNNN	CCYYMM(西暦年月)
終了月-ティア3	Ending contract month – Tier 3	47	6	NNNNNN	CCYYMM(西暦年月)
ティア番号-ティア4	Tier number – Tier 4	53	2	NN	
開始月-ティア4	Starting contract month – Tier 4	55	6	NNNNNN	CCYYMM(西暦年月)
終了月-ティア4	Ending contract month – Tier 4	61	6	NNNNNN	CCYYMM(西暦年月)

### 【備考】

・レコードタイプ3は、商品グループ単位に1レコードとなります。

※ 全限月まとめて1つのティアを設定しているため、商品内スプレッド割増額のメソッドコードとしては常に"10"として表示されます。

## Record Type4 (レコードタイプ4)

### Delivery Month Charge (納会月割増額)

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	"4"(数字 + スペース)
商品グループコード	Combined commodity code	3	6	XXXXXX	
納会月割増額のメソッドコード	Delivery (Spot) month charge method code	9	2	XX	"01" – 納会限月割増額不適用(※) "10" – 納会限月割増額適用
対象決済月数	Number of contract months in	11	2	NN	納会限月割増額を定義する限月の数
対象決済月1-決済月番号	Delivery month 1 – Month number	13	2	NN	01, 02, 03 等
対象決済月1-決済月	Delivery month 1 – Contract month	15	6	NNNNNN	CCYYMM(西暦年月)
対象決済月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	
対象決済月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	
対象決済月2-決済月番号	Delivery month 2 – Month number	35	2	NN	01, 02, 03 等
対象決済月2-決済月	Delivery month 2 – Contract month	37	6	NNNNNN	CCYYMM(西暦年月)
対象決済月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	
対象決済月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	
予備	fill	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	設定値
予備	fill	70	9		
売オプション最低証拠金額計算メソッド	Short option minimum calculation method	79	1	X	空欄:Original method(オリジナルメソッド) "1": 最大( Short call, short put)

#### 【備考】

※ Method Code=01の場合、11～62桁までは空欄となります。

・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つのレコードタイプ4に設定できる納会月割増額の対象となる決済月は2つまでです。それを超えて対象となる決済月を設定する場合は、1つの商品グループに複数のレコードタイプ4をもつことがあります。

# 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"(数字 + スペース)
商品グループ群コード	Combined commodity group code	3	3	XXX	設定値
予備	fill	6	7		
商品グループコード1	Combined commodity code 1	13	6	XXXXXX	
商品グループコード2	Combined commodity code 2	19	6	XXXXXX	
商品グループコード3	Combined commodity code 3	25	6	XXXXXX	
商品グループコード4	Combined commodity code 4	31	6	XXXXXX	
商品グループコード5	Combined commodity code 5	37	6	XXXXXX	
商品グループコード6	Combined commodity code 6	43	6	XXXXXX	
商品グループコード7	Combined commodity code 7	49	6	XXXXXX	
商品グループコード8	Combined commodity code 8	55	6	XXXXXX	
商品グループコード9	Combined commodity code 9	61	6	XXXXXX	
商品グループコード10	Combined commodity code 10	67	6	XXXXXX	

### 【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。
- ・各商品グループは1つ及び1つだけの商品グループ群に属します。
- ・1つのレコードタイプ5に設定できる商品グループ群コードの商品グループコード数は最大10までとなります。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。

# Record Type6 (レコードタイプ6)

## Inter Commodity 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"(数字 + スペース)
商品グループコード	Commodity group code	3	3	XXX	
スプレッド優先順位	Spread priority	6	4	NNNN	
スプレッドクレジットレート	Spread credit rate	10	7	NNNnnnn	パーセント
取引所略称 -レグ1	Exchange acronym - Leg 1	17	3	XXX	"TC"
予備	fill	20	1		
商品グループコード-レグ1	Combined commodity code - Leg 1	21	6	XXXXXXX	
デルタ/スプレッド比率 -レグ1	Delta/Spread ratio - Leg 1	27	7	NNNnnnn	
スプレッドサイド -レグ1	Spread side - Leg 1	34	1	X	"A" 又は"B"
取引所略称 -レグ2	Exchange acronym - Leg 2	35	3	XXX	"TC"
予備	fill	38	1		
商品グループコード -レグ2	Combined commodity code - Leg 2	39	6	XXXXXXX	
デルタ/スプレッド比率 -レグ2	Delta/Spread ratio - Leg 2	45	7	NNNnnnn	
スプレッドサイド -レグ2	Spread side - Leg 2	52	1	X	"A" 又は"B"
取引所略称 -レグ3	Exchange acronym - Leg 3	53	3	XXX	"TC"
予備	fill	56	1		
商品グループコード-レグ3	Combined commodity code - Leg 3	57	6	XXXXXXX	
デルタ/スプレッド比率 -レグ3	Delta/Spread ratio - Leg 3	63	7	NNNnnnn	
スプレッドサイド -レグ3	Spread side - Leg 3	70	1	X	"A" 又は"B"
取引所略称 -レグ4	Exchange acronym - Leg 4	71	3	XXX	"TC"
予備	fill	74	1		
商品グループコード-レグ4	Combined commodity code - Leg 4	75	6	XXXXXXX	
デルタ/スプレッド比率 -レグ4	Delta/Spread ratio - Leg 4	81	7	NNNnnnn	
スプレッドサイド -レグ4	Spread side - Leg 4	88	1	X	"A" 又は"B"

### 【備考】

・レコードタイプ6は、商品間スプレッド単位に1レコードとなります。

# Record Type81 (レコードタイプ81)

## Risk Arrays1 (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"(数字)
取引所略称	Exchange acronym	3	3	XXX	"TC"
商品コード	Commodity (product) code	6	10	XXX...XXX	
予備	fill	16	10		
商品タイプコード	Product type code	26	3	XXX	"FUT" – Futures (先物) "PHY" – Physical (Spot) (現物) "OOF" – Option on Future (先物のオプション) "OOP" – Option on Physical (現物オプション)
オプション区分	Option right code	29	1	X	オプションの場合のみ使用 "P" (プット) "C" (コール)
先物決済月	Futures contract month	30	6	NNNNNN	CCYYMM (西暦年月)
予備	fill	36	3		
オプション決済月	Option contract month	39	6	NNNNNN	CCYYMM (西暦年月)、先物の場合は空欄
予備	fill	45	3		
オプション権利行使価格	Option strike price	48	7	NNNNNNN	
シナリオ1のリスクアレイ値	Array value 1 Futures No Change/Volatility Up	55	5	NNNNN	
シナリオ1のリスクアレイ値の符号	Sign for value 1	60	1	X	"+"又は "-"を設定
シナリオ2のリスクアレイ値	Array value 2 Futures No Change/Volatility Down	61	5	NNNNN	
シナリオ2のリスクアレイ値の符号	Sign for value 2	66	1	X	"+"又は "-"を設定
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	
シナリオ3のリスクアレイ値の符号	Sign for value 3	72	1	X	"+"又は "-"を設定
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	
シナリオ4のリスクアレイ値の符号	Sign for value 4	78	1	X	"+"又は "-"を設定
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	
シナリオ5のリスクアレイ値の符号	Sign for value 5	84	1	X	"+"又は "-"を設定
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	
シナリオ6のリスクアレイ値の符号	Sign for value 6	90	1	X	"+"又は "-"を設定

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7のリスクアレイ値	Array value 7 Futures Up 2/3 /Volatility Up	91	5	NNNNN	
シナリオ7のリスクアレイ値の符号	Sign for value 7	96	1	X	"+"又は "-"を設定
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	
シナリオ8のリスクアレイ値の符号	Sign for value 8	102	1	X	"+"又は "-"を設定
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	
シナリオ9のリスクアレイ値の符号	Sign for value 9	108	1	X	"+"又は "-"を設定

**【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。

# Record Type82 (レコードタイプ82)

## Risk Arrays2(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"(数字)
取引所略称	Exchange acronym	3	3	XXX	"TC"
商品コード	Commodity (product) code	6	10	XXX...XXX	
予備	fill	16	10		
商品タイプコード	Product type code	26	3	XXX	"FUT" – Futures (先物) "PHY" – Physical (Spot) (現物) "OOF" – Option on Future (先物のオプション) "OOP" – Option on Physical (現物オプション)
オプション区分	Option right code	29	1	X	オプションの場合のみ使用 "P" (プット) "C" (コール)
先物決済月	Futures contract month	30	6	NNNNNN	CCYYMM (西暦年月)
予備	fill	36	3		
オプション決済月	Option contract month	39	6	NNNNNN	CCYYMM (西暦年月)、先物の場合は空欄
予備	fill	45	3		
オプション権利行使価格	Option strike price	48	7	NNNNNNN	
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	
シナリオ10のリスクアレイ値の符号	Sign for value 10	60	1	X	"+"又は"-を設定
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	
シナリオ11のリスクアレイ値の符号	Sign for value 11	66	1	X	"+"又は"-を設定
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	
シナリオ12のリスクアレイ値の符号	Sign for value 12	72	1	X	"+"又は"-を設定
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	
シナリオ13のリスクアレイ値の符号	Sign for value 13	78	1	X	"+"又は"-を設定
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	
シナリオ14のリスクアレイ値の符号	Sign for value 14	84	1	X	"+"又は"-を設定
シナリオ15のリスクアレイ値	Array value 15 Futures Up Extreme × Cover Fraction	85	5	NNNNN	

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15のリスクアレイ値の符号	Sign for value 15	90	1	X	"+"又は"-を設定
シナリオ16のリスクアレイ値	Array value 16 Futures Down Extreme × Cover Fraction	91	5	NNNNN	
シナリオ16のリスクアレイ値の符号	Sign for value 16	96	1	X	"+"又は"-を設定
コンポジット・デルタ	Composite delta	97	5	Nnnnn	
コンポジット・デルタの符号	Sign for composite delta	102	1	X	"+"又は"-を設定
インプライド・ボラティリティ	Implied Vol. as decimal fraction	103	8	NNnnnnnn	シリーズ自体の個々のボラティリティ
帳入価格	Settlement price	111	7	NNNNNNN	
帳入価格の符号	Sign for settlement price	118	1	X	常に"+

【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。

# 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"(文字 + スペース)
取引所略称	Exchange acronym	3	3	XXX	"TC"
商品コード	Commodity code	6	10	XXX...XXX	
商品タイプコード	Product type code	16	3	XXX	"FUT" – Futures (先物) "PHY" – Physical (Spot) (現物) "OOF" – Option on Future (先物のオプション) "OOP" – Option on Physical (現物オプション)
先物決済月	Futures contract month	19	6	NNNNNN	CCYYMM (西暦年月)
予備	fill	25	3		
オプション決済月	Option contract month	28	6	NNNNNN	CCYYMM (西暦年月)、オプション以外の場合は空欄
予備	fill	34	3		
ベースボラティリティ	Base volatility	37	8	NNnnnnnn	整数2桁 + 小数点以下6桁
ボラティリティ・スキャンレンジ	Volatility scan range	45	8	NNnnnnnn	整数2桁 + 小数点以下6桁
先物プライス・スキャンレンジ	Futures price scan range	53	5	NNNNN	整数5桁
極端な変動率	Extreme move multiplier	58	5	NNnnn	整数2桁 + 小数点以下3桁
極端に変動した場合のカバー率	Extreme move covered fraction	63	5	Nnnnn	整数1桁 + 小数点以下4桁
金利	Interest rate	68	5	Nnnnn	整数1桁 + 小数点以下4桁
残存時間	Time to expiration	73	7	Nnnnnnn	整数1桁 + 小数点以下6桁 決済日までの日数
ルックアヘッドタイム	Lookahead time	80	6	nnnnnn	小数点以下6桁
デルタ・スケーリング係数	Delta scaling factor	86	6	NNnnnn	整数2桁 + 小数点以下4桁
決済日	Expiration (settlement) date	92	8	NNNNNNNN	CCYYMMDD (西暦年月日)、実際の決済日
予備	fill	100	12		
クーポン/配当利回り	Coupon or dividend yield	112	8	NNnnnnnn	設定値

### 【備考】

・レコードタイプBは、商品、決済日、先物/オプション単位に1レコードとなります。

# Record TypeC (レコードタイプC)

## Tier to Tier Intra Commodity ("Inter month") spread(ティア間の商品内スプレッド)

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	"C"(文字 + スペース)
商品グループコード	Combined commodity code	3	6	XXXXXX	
商品内スプレッド割増額のメソッドコード	Intra Commodity spread method code	9	2	XX	"10"
優先順位	Spread priority	11	2	NN	スプレッド番号
レグ数	Number of legs	13	2	NN	
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	
レグ番号 - レグ1	Leg number - Leg 1	22	2	NN	
ティア番号 - レグ1	Tier number - Leg 1	24	2	NN	
商品内デルタ/スプレッド比率 - レグ1	Delta per spread ratio - Leg 1	26	2	NN	
マーケット・サイド - レグ1	Market side - Leg 1	28	1	X	"A" 又は"B"
レグ数 - レグ2	Leg number - Leg 2	29	2	NN	
ティア番号 - レグ2	Tier number - Leg 2	31	2	NN	
商品内デルタ/スプレッド比率 - レグ2	Delta per spread ratio - Leg 2	33	2	NN	
マーケット・サイド - レグ2	Market side - Leg 2	35	1	X	"A" 又は"B"
レグ数 - レグ3	Leg number - Leg 3	36	2	NN	
ティア番号 - レグ3	Tier number - Leg 3	38	2	NN	
商品内デルタ/スプレッド比率 - レグ3	Delta per spread ratio - Leg 3	40	2	NN	
マーケット・サイド - レグ3	Market side - Leg 3	42	1	X	"A" 又は"B"
レグ数 - レグ4	Leg number - Leg 4	43	2	NN	
ティア番号 - レグ4	Tier number - Leg 4	45	2	NN	
商品内デルタ/スプレッド比率 - レグ4	Delta per spread ratio - Leg 4	47	2	NN	
マーケット・サイド - レグ4	Market side - Leg 4	49	1	X	"A" 又は"B"

### 【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。
- ・4レグまで設定可能ですが、レコードは最後に設定されたレグで終わります。

# Record TypeS (レコードタイプS)

## Scanning Tiers (ティアの設定)

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	"S"(文字 + スペース)
商品グループコード	Combined commodity code	3	6	XXXXXX	
スキャン/商品間スプレッド・メソッドコード	Scanning / intercommodity spreading method code	9	2	XX	"01"
予備	fill	11	72		
先物加重プライス・リスク・メソッド	Weighted futures price risk calculation method	83	1	X	"1", "2", "3"のいずれか

### 【備考】

- ・商品グループ単位に1レコードとなります。
- ・Scanning / Intercommodity Spreading Method Code(スキャン/商品間スプレッド・メソッド・コード)は、“01”(non-tiered processing (全限月がスキャン/商品間スプレッドの両方について1つのティアを構成するメソッド))となります。
- ・このレコードは、Weighted futures price risk method (先物加重プライス・リスク・メソッド)に“1”(プライス・リスクを評価し、ネット・デルタで分配する通常の計算メソッド)以外の値が設定される場合のみ使用します。

# 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" (文字 + スペース)
換算元通貨	Convert-from currency	3	3	XXX	設定値(※)
換算元通貨	Convert-from currency	6	1	X	設定値(※)
換算先通貨	Convert-to currency	7	3	XXX	設定値(※)
換算先通貨	Convert-to currency	10	1	X	設定値(※)
換算レート	Conversion multiplier	11	10	NNNNnnnnnn	整数4桁 + 小数点以下6桁

【備考】

※ 換算元通貨(3桁)／換算元通貨(1桁)及び換算先通貨(3桁)／換算先通貨(1桁)には、以下表の値が設定されます。

証拠金通貨	証拠金通貨コード
3 character	1 character
AUD	A
NZD	Z
USD	\$
GBP	L
CAD	C
EUR	E
FRF	F
DEM	D
HKD	H
HUF	U
ITL	I
JPY	Y
MXN	P
NOK	N
SGD	G
ESP	T
ZAR	R
SEK	K
CHF	S
KRW	O
TWD	W
AUC	Q