



J-GATE

オルタナティブデータ提供サービス

J-GATE 注文約定データ

仕様書

第 1.0 版

2021 年 9 月

株式会社 JPX 総研

当社は本書に含まれる情報の利用に伴って発生した不利益や問題について、誰に対しても何ら責任を負うものではありません。

また、本書の内容は予告なく変更される場合があります。

第 1.0 版への変更履歴

項番	変更した日	変更した箇所 (章)	変更内容	備考
1	2021/9/21	-	初版発行	-

目次

1	この仕様書について	1
1.1	はじめに	1
2	サービス内容	2
2.1	データ概要	2
3	注文約定ファイル	3
3.1	ファイル仕様	3
3.2	カラム一覧	3
3.2.1	Flag カラム設定値一覧	5
3.2.2	ChangeReason カラム設定値一覧	6
3.3	板事例	7

1 この仕様書について

1.1 はじめに

本書はオルタナティブデータ提供サービスのデータセットの一つである“J-GATE 注文約定データ”の仕様書であり、主として当該データサービスの利用者がデータセットを扱う上で必要となる情報をまとめた資料である。

本書は再配布禁止である。

2 サービス内容

2.1 データ概要

J-GATE 注文約定データは、マッチングエンジンによって処理された各トランザクションを時系列で記録した CSV ファイルである。

各注文・約定の数量、値段、銘柄といった基本的な情報に加え、トランザクションのリクエストが送信されたプロトコル(OUCH または OMnetAPI)や、注文属性(GFD, GTC, IOC)などの情報を確認することができる。

既存の ITCH フィードでは配信されない主なデータの一例として、下記の情報などを含む

- IOC 注文：FAK(Fill and Kill)や FoK(Fill or Kill)など、即時失効する注文の情報。
- 引け条件付き注文：引けに有効化される注文の情報。
- エラー注文：制限値幅外への発注など、マッチングエンジンでエラーとして処理された注文の情報。

*J-NET 取引に関する情報は収録しない。

*個々の注文執行者を特定可能な情報は含まない。

*当該データは他のいかなる J-GATE のデータフィード(ITCH 相場情報、OMNetAPI ブロードキャスト情報など)との整合性及び一貫性を保証しない。

3 注文約定ファイル

3.1 ファイル仕様

ファイル名	形式	文字コード	改行コード	区切り文字	ヘッダ有無
OrderTradeInfo_OSE_yyyymmdd.csv	CSV	UTF-8-	LF	, (カンマ)	有
OrderTradeInfo_TOCOM_yyyymmdd.csv	CSV	UTF-8-	LF	, (カンマ)	有

当日 6 時のシステム起動時から翌日のナイトセッション取引終了までのデータを OSE 及び TOCOM 毎に 1 ファイルに収録する。

OSE 及び TOCOM それぞれの取引情報を別ファイルで提供する。(2019 年 7 月 1 日から 2021 年 9 月 16 日までは、OSE ファイルのみの提供。)

CSV ファイルの 1 行が、マッチングエンジンで処理されたトランザクションのイベント 1 つの情報に相当する。

3.2 カラム一覧

項番	項目名	ヘッダー名	設定値例	説明
1	日付	Date	20190301	イベント発生日付。
2	時刻	Time	27:21:05.215690342	イベント発生時刻。
3	銘柄	Security	PUT_NK225_190412_19875	イベント発生銘柄。
4	トランザクションタイプ	TransactionType	AMEND	当該イベントのトランザクションタイプ。取りうる値は以下の通り。 <ul style="list-style-type: none">• ENTER: 新規注文• AMEND: 訂正注文• DELET: 取消注文• TRADE: 約定
5	価格	Price	220	注文及び約定値段。 AMEND イベントでは、訂正後の値段が設定される。 成行注文では、0 が設定される。

6	数量	Volume	40	注文及び約定数量。 AMEND イベントでは、訂正後の数量が設定される。
7	取引高	Value	8800000	注文及び約定における取引高。 数量*価格*売買単位に等しい。
8	売買区分	Bid/Ask	Ask	注文の売買区分。 TRADE イベントでは、“Trd”が設定される。
9	注文属性フラグ	Flag	NIG	注文及び約定の属性を示すフラグ情報。 複数のフラグコードがスペースで区切られて羅列される。 詳細は 3.2.1 Flag カラム設定値一覧を参照。
10	注文 ID (売り方)	AskOrderID	623E6E5200F04869	16 進数表記の注文 ID。 AMEND 及び DELET では、ENTER で付与された OrderID が引き継がれて設定される。 当該注文がエラーの場合は、“Error”が設定される。
11	注文 ID (買い方)	BidOrderID	(blank)	同上
12	新規発注日付 (売り方)	AskOriginalEntryDate	20190301	当該注文の新規発注時点の日付 ENTER イベントが発生した日付が設定される
13	新規発注日付 (買い方)	BidOriginalEntryDate	(blank)	同上
14	新規発注時刻(売り方)	AskOriginalEntryTime	27:21:03.047182375	当該注文の新規発注時点の時刻 ENTER イベントが発生した時刻が設定される
15	新規発注時刻 (買い方)	BidOriginalEntryTime	(blank)	同上
16	注文有効期間 (売り方)	AskValidityType	GFD	当該注文の有効期間。下記の値のいずれかが設定される。 <ul style="list-style-type: none"> • Bouncing (FAK または FOK) • GFD • GTC • GTD
17	注文有効期間(買い方)	BidValidityType	(blank)	同上
18	注文種別 (売り方)	AskOrderType	Limit Order	当該注文の注文種別。下記の値のいずれかが設定される。 <ul style="list-style-type: none"> • Limit order • Market order
19	注文種別 (買い方)	BidOrderType	(blank)	同上
20	変更理由 (売り方)	AskChangeReason	Order updated by user	マッチングエンジンで当該イベントが処理された理由。 設定される値は 3.2.2 ChangeReason カラム設定値一覧を参照。 エラー注文の場合は txstat の返り値が設定される。 例) -420131 (The premium is outside the allowed price limits for this instrument.)
21	変更理由(買い方)	BidChangeReason	(blank)	同上
22	DCB 上限値幅	DCBUpperLimit	260	当該イベントが発生した時点における DCB 上限値幅
23	DCB 下限値幅	DCBLowerLimit	160	当該イベントが発生した時点における DCB 下限値幅
24	DCB 基準値段	DCBReferencePrice	210	当該イベントが発生した時点における DCB 基準値段
25	セッション状態	SessionState	N_ZARABA	当該イベントが発生した時点におけるセッション情報(TSS/ISS)。*1

				各 TSS/ISS が示す意味については、大阪取引所が別途配布する J-GATE 接続仕様書を参照すること。
26	Epoch 時間	UnixTime	1551464465215690342	当該イベントのタイムスタンプ。Epoch 時間+ナノ秒で表記される。値は Date カラム及び Time カラムの時刻と一致する。
27	OUCH フラグ	OuchFlag	0	当該注文が OUCH で発注されたかどうかを示すフラグ。 0=OMNetAPI, 1=OUCH

*1 特定の条件下において、実態を正しく反映していない値が設定される可能性があるため、正確なセッション情報の把握には、ITCH またはその他のデータフィードを利用すること。

例：セッション状態が丁度 DCB に遷移する瞬間に、100 マイクロ秒以下などの極めて短い時間間隔で大量のトランザクションが発生した場合、DCB 遷移直後に到来したトランザクションのレコードに関して、本来“DCB”が設定されるべきところが“N_ZARABA”などの値が設定される場合があるため。

3.2.1 Flag カラム設定値一覧

イベント種別	フラグコード	項目名	説明
注文イベント (ENTER, AMEND, DELET)	FoK	Fill or Kill	FOK 注文。
	FaK	Fill and Kill	FAK 注文。
	OV	Reloaded order	GTC/GTD 注文など、前営業日から引き継がれた注文。
	IA	Inactive Order	板上で有効化されておらず取引対象に含まれない注文。
	TS	Trigger on session order	引け条件付き注文。
	ERR	Error order	エラー注文。
	MOR	Morning	前場中に処理された注文。
	AFT	Afternoon	後場中に処理された注文。
	NIG	Night	ナイトセッション中に処理された注文。
約定イベント (TRADE)	Bi	Buyer Initiated	アグレッシブ注文が買いである約定。
	Si	Seller Initiated	アグレッシブ注文が売りである約定。
	Oi	Opening Initiated	寄り付きで発生した約定。
	Ci	Closing Initiated	引けで発生した約定。
	MOR	Morning	前場中に処理された約定。

	AFT	Afternoon	後場中に処理された約定。
	NIG	Night	ナイトセッション中に処理された約定。
	COM	Combo	コンボ板で発生した約定。
	CTL	Combo to Leg	コンボ約定によって形成された建値情報。

3.2.2 ChangeReason カラム設定値一覧

設定文字列
Order cancelled by the trader
Order traded
Order inactivated when a user lost connection to the exchange (configurable)
Order updated by user
New order
Market order converted to a Limit order (MTL)
Order cancelled by system
Order cancelled on behalf
Trigger order triggered and converted to an active order
Reserved order refreshed
Order cancelled by system due to a price limit change
Order removed or changed by remove day or date orders flag
Order cancelled due to that trading is halted
Order inactivated due to that trading is halted
ReloadedStartOfDay
Order cancelled after opening action
Trigger on session order (SSO) triggered due to session change
Quote Cancelled Delta MM protection
Quote Cancelled Abs MM protection
Crossing order deleted *1
Order cancelled by the trader

Order traded
Order inactivated when a user lost connection to the exchange (configurable)
Order updated by user
New order
Market order converted to a Limit order (MTL)
Order cancelled by system

*1: STP(Selt Trade Prevention)機能によって注文が取り消されたことを意味する。

3.3 板事例

各板事例における CSV ファイルへの出力のされ方については、別紙”OrderTradeData _case_examples.xlsx”を参照すること。