

歩み値データ説明書

平成 22年9月1日

株式会社 東京証券取引所

1. 提供情報の概要

東京証券取引所における各種証券の歩み値データを提供する。
提供可能な証券種類及びデータ提供可能開始時期等については、下表のとおりである。

証券種類	提供可能開始時期	備考
内国株	1982年02月01日	優先出資証券、内国投資信託受益証券、内国投資証券を含む。
転換社債	1981年01月05日	現、転換社債型新株予約権付社債(以下、同じ)外貨建外国転換社債、円貨建外国転換社債、国内発行外国転換社債を除く。
新株引受権証券	1986年03月03日	現、新株予約権証券(以下、同じ)
国債先物取引		
長期国債先物取引 ※	1985年10月19日	
超長期国債先物取引	1988年07月08日	2002年12月限月から休止中
中期国債先物取引 ※	1996年02月16日	
ミニ長期国債先物取引 ※	2009年03月23日	
指数先物取引		
東証株価指数先物取引 ※	1988年09月03日	
業種別株価指数先物取引	1998年01月23日	東証輸送用機器株価指数先物取引 2003年06月限月から休止中
S&P/TOPIX150先物取引	2001年06月11日	2005年06月限月から休止中
ミニTOPIX先物取引 ※	2008年06月16日	
東証REIT指数先物取引 ※	2008年06月16日	
TOPIX Core30先物取引 ※	2008年06月16日	
国債先物オプション取引		
長期国債先物オプション取引	1990年05月11日	
中期国債先物オプション取引	2000年11月20日	2002年07月限月から休止中
指数オプション取引		
東証株価指数オプション取引	1989年10月20日	
S&P/TOPIX150オプション取引	2001年06月11日	2002年11月限月から休止中

※:スプレッド取引分は除く。

<備考>

- ・ 立会外取引は収録対象外
- ・ 普通取引のみ対象
- ・ 以下の内国株式については、提供対象外とする。

日付	銘柄コード
1982年11月11日	40050
1983年7月18日	64710
1983年7月18日	64720
1987年5月28、29日	67030

2. 様式及び収録方法

次表の様式に従い、証券種類(項番1の表参照)ごとに収録

様式	DOSVフォーマット(CSVファイル)
レコードサイズ	可変長レコード

項番	項目	バイト数	内容等
			<p>オプション取引</p> <p>①特殊取引識別 : 1</p> <p>②プット/コール、現先識別 先物プット : 1 現物プット : 3(及び8) 先物コール : 2 現物コール : 4(及び9)</p> <p>③限月識別 年 : (西暦年-5)の下1桁 1989年の場合は「4」 月 : 限月1月の場合は「01」</p> <p>④権利行使価格識別 国債先物オプション取引 権利行使価格を0.5で除した商の下2桁を示す 120円の場合「40」 東証株価指数オプション取引 権利行使価格の百の位と十の位を示す 2,150ポイントの場合「15」</p> <p>⑤取引対象識別 長期国債先物オプション取引 : 01 中期国債先物オプション取引 : 04 東証株価指数オプション取引 : 05 S&P/TOPIX150オプション取引 : 09</p>
3	場区分	2	歩み値の約定が成立した時の前後場区分を収録 00:イブニング、01:前場、02:後場
4	成立時刻	4	歩み値の約定が成立した時の成立時刻を収録(ゼロ埋め、24H) [例] '0900', '1020', '1230', '1305'
5	歩み値	19	歩み値を次の単位で収録 株式 円(符号+整数13桁+小数点+小数4桁) 転換社債 円(符号+整数13桁+小数点+小数4桁) 新株引受権証券 円(符号+整数13桁+小数点+小数4桁) 国債先物取引 ミニ長期国債 厘(符号+整数18桁) ミニ長期国債以外 銭(符号+整数18桁) 指数先物取引 0.01ポイント(符号+整数18桁) 国債先物オプション取引 銭(符号+整数18桁) 指数オプション取引 0.01ポイント(符号+整数18桁) ※正の数の(+)場合、符号なし(18桁)

項番	項目	バイト数	内容等
			<p>オプション取引</p> <p>①特殊取引識別 : 1</p> <p>②プット/コール、現先識別 先物プット : 1 現物プット : 3(及び8) 先物コール : 2 現物コール : 4(及び9)</p> <p>③限月識別 年 : (西暦年-5)の下1桁 1989年の場合は「4」 月 : 限月1月の場合は「01」</p> <p>④権利行使価格識別 国債先物オプション取引 権利行使価格を0.5で除した商の下2桁を示す 120円の場合「40」 東証株価指数オプション取引 権利行使価格の百の位と十の位を示す 2,150ポイントの場合「15」</p> <p>⑤取引対象識別 長期国債先物オプション取引 : 01 中期国債先物オプション取引 : 04 東証株価指数オプション取引 : 05 S&P/TOPIX150オプション取引 : 09</p>
3	場区分	2	歩み値の約定が成立した時の前後場区分を収録 00:イブニング、01:前場、02:後場
4	成立時刻	4	歩み値の約定が成立した時の成立時刻を収録(ゼロ埋め、24H) [例] '0900', '1020', '1230', '1305'
5	歩み値	19	歩み値を次の単位で収録 株式 円(符号+整数13桁+小数点+小数4桁) 転換社債 円(符号+整数13桁+小数点+小数4桁) 新株引受権証券 円(符号+整数13桁+小数点+小数4桁) 国債先物取引 ミニ長期国債 厘(符号+整数18桁) ミニ長期国債以外 銭(符号+整数18桁) 指数先物取引 0.01ポイント(符号+整数18桁) 国債先物オプション取引 銭(符号+整数18桁) 指数オプション取引 0.01ポイント(符号+整数18桁) ※正の数(+)の場合符号なし(18桁)
6	取引高	18	取引高を次の単位で収録 株式 株(符号+整数17桁) 転換社債 交換社債:口数(符号+整数17桁) その他 :万円(符号+整数17桁) 新株引受権証券 証券(符号+整数17桁) 国債先物取引 単位(符号+整数17桁) 指数先物取引 単位(符号+整数17桁) 国債先物オプション取引 単位(符号+整数17桁) 指数オプション取引 単位(符号+整数17桁) ※正の数(+)の場合符号なし(17桁)

※ファイル容量によっては、次の点が変わることがありますのでご注意ください。

- ・数値項目は0埋めされず左詰で収録される(マイナス符号があった場合は、マイナス符号が付加される)。
- ・ヘッダは付加されない。

(3)収録データ

東京証券取引所における各種証券の歩み値データ

a.レベル1データ

- ・ 銘柄毎に、1日の値段の変化をとらえたものであり、図中の○印を採用したものである。
- ・ 前場終了・後場開始で同値の場合は歩み値とせず(図2)、前日と当日で同値の場合は歩み値とする。(図3)
- ・ 場区分がイブニングのデータについては、日付が翌日扱いとなるが、該当日の歩み値データとして、イブニング・前場・後場の順に取り扱う。(図4)

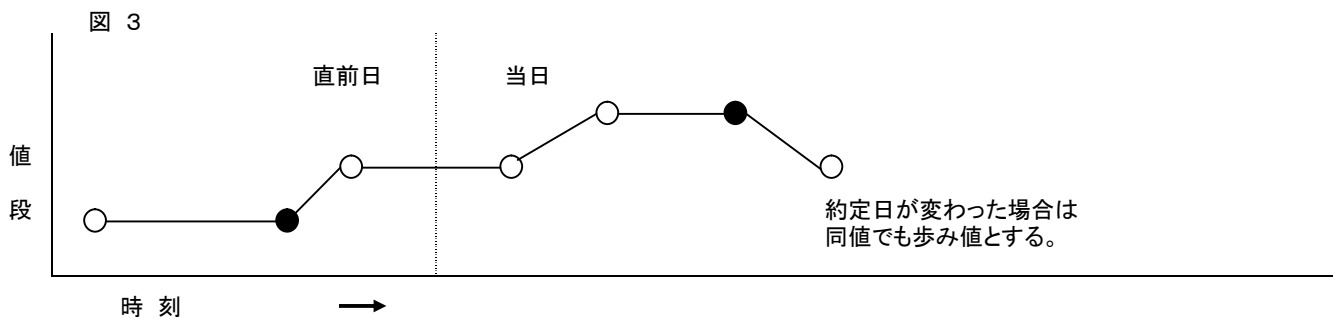
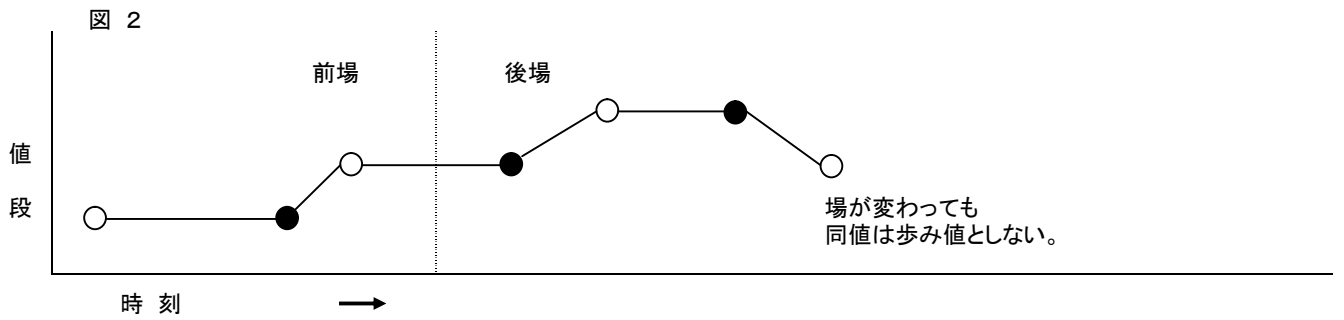
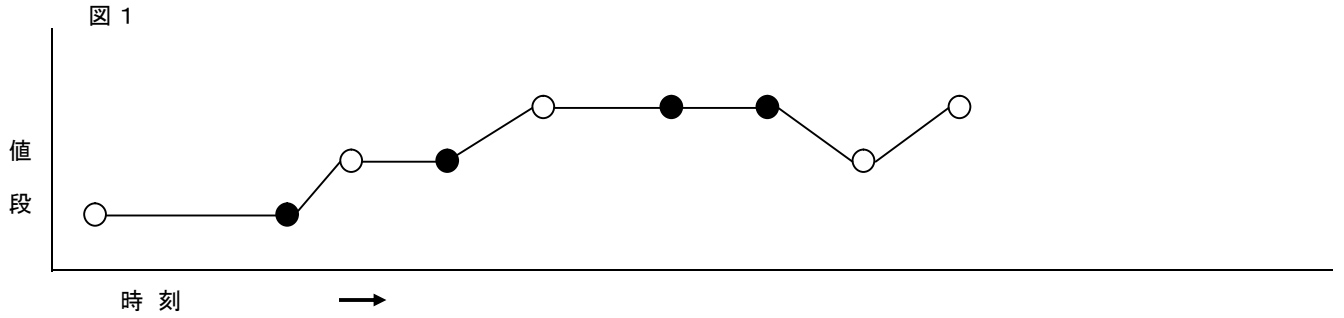
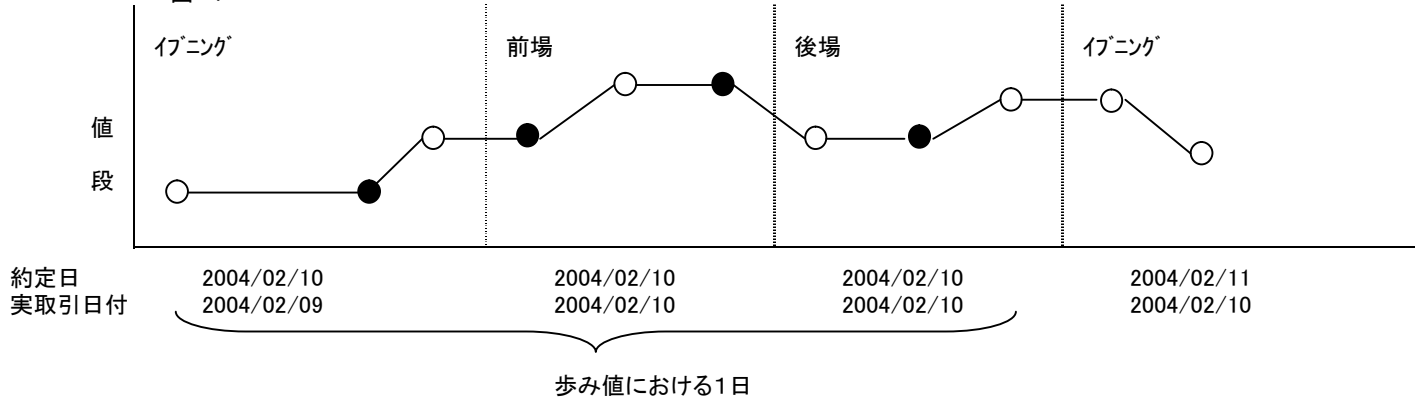
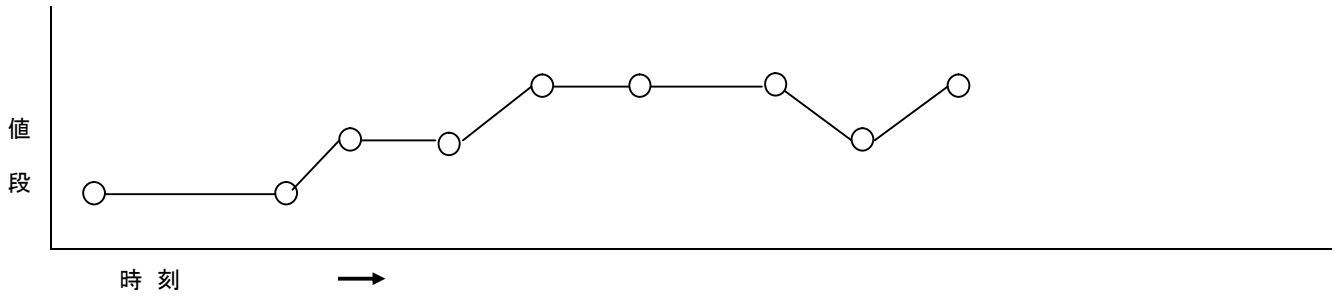


図 4



b. レベル2データ

- ・ 銘柄毎に、1日の値段の変化をとらえたものであり、図中の○印を採用したものである。
(同一銘柄でも時刻(分単位)が異なる場合、各データが収録される)
- ・ 場区分がイブニングのデータの扱いについては、前記「レベル1データ」と同様とする。
- ・ 収録されている取引高は売数量である。
- ・ 同一値段で複数の売約定が成立した場合、同一時刻であっても複数のデータが収録されることがある。



データレイアウトフォーム(歩み値)

a.レベル1データ

10								20								30								40									
約定日								(株 銘柄コード 式は5桁)								場区分		成立時刻				歩み値											
8								1	9								1	2		1	4				1	19							

40										48									
歩み値										改行コード									
19										2									

b.レベル2データ

10								20								30								40									
約定日								(株 銘柄コード 式は5桁)								場区分		成立時刻				歩み値											
8								1	9								1	2		1	4				1	19							

40										50										60																		
歩み値										取引高										改行コード																		
19										1	18																		2									

※ 部分には「,」(カンマ)が入る