

TOCOM 新取引システム稼働に伴う SPAN パラメータの設定方法の変更点について

TOCOM 新取引システム稼働日から、SPAN パラメータの設定方法を以下のとおり変更しました。

1. 次期向け SPAN パラメータに記載される商品名は、取引所における各商品名の呼称と同一にする。(例：原油→ドバイ原油、ガソリン→東京バージガソリン)
2. 商品間スプレッド割引に係る商品グループの組合せ及び優先順位は、下表のとおりとする。
3. 商品間デルタ/スプレッド比率は、現行の 100 分の 1 の値とする。
4. 金オプションについては、(株)東京商品取引所による商品設計の変更に併せ、「取引単位」、「デルタ・スケーリング係数」、「金利」、「売オプション 1 単位当たりの最低証拠金額」を変更。
 - (1) 取引単位は、100、金オプションのデルタ・スケーリング係数は、0.1 とする。
 - (2) 金利は、TOCOM と同様、TIBOR12 か月物を利用する。(月末最終最終日から起算して 6 営業日前に全銀協が公表する TIBOR12 か月物 (小数第 3 位以下切り捨て) を翌月第 1 営業日から月末最終営業日まで全限月に適用する。マイナス金利になった場合は、「0」とする。)
 - (3) 売オプション 1 単位当たりの最低証拠金額は、当該商品グループのプライス・スキャンレンジにデルタ・スケーリング係数を乗じた額の 2.5% に相当する額 (100 円の整数倍となるように切り上げ) とする。

株式会社東京商品取引所

優先順位	商品グループの組合せ
1	東京ゴールドスポット 100 : 金
2	ドバイ原油 : 東京バージ灯油
3	中京ローリーガソリン : 東京バージガソリン
4	ドバイ原油 : 東京バージガソリン
5	中京ローリーガソリン : ドバイ原油
6	東京バージガソリン : 東京バージ灯油
7	中京ローリーガソリン : 東京バージ灯油
8	中京ローリー灯油 : 東京バージ灯油
9	中京ローリー灯油 : ドバイ原油
10	中京ローリーガソリン : 中京ローリー灯油
11	中京ローリー灯油 : 東京バージガソリン
12	パラジウム : 白金

大阪堂島商品取引所

優先順位	商品グループの組合せ
1	東京コメ : 大阪コメ