

SPANパラメータ (適用 : 2016年10月3日 ~ 10月14日)

1. 株式会社東京商品取引所

(1)先物

商品グループ	プライス・スキャンレンジ	納会月割増額		1ネット・デルタ当たりの商品内スプレッド割増額
		アウトライト・チャージ	スプレッド・チャージ	
金	¥90,000	¥0	¥0	¥15,000
東京ゴールドスポット100	¥9,000	-	-	-
銀	¥40,000	¥0	¥0	¥25,000
白金	¥66,000	¥0	¥0	¥15,000
パラジウム	¥65,000	¥0	¥0	¥50,000
東京バージガソリン	¥120,000	¥0	¥0	¥25,000
東京バージ灯油	¥140,000	¥0	¥0	¥35,000
ドバイ原油	¥155,000	¥0	¥0	¥20,000
東京バージ軽油	¥120,000	¥0	¥0	¥65,000
中京ローリーガソリン	¥30,000	¥0	¥0	¥15,000
中京ローリー灯油	¥30,000	¥0	¥0	¥25,000
ゴム	¥45,000	¥0	¥0	¥40,000
とうもろこし	¥35,000	¥0	¥0	¥35,000
一般大豆	¥20,000	¥5,000	¥5,000	¥15,000
小豆	¥55,000	¥0	¥0	¥50,000

・プライス・スキャンレンジは、単一商品の単一限月取引において1単位買い(又は売り)建てた場合の証拠金額に相当する。

・金(ミニ)に係るSPANパラメータは、上記金グループに係るSPANパラメータの10分の1とする。

・白金(ミニ)に係るSPANパラメータは、上記白金グループに係るSPANパラメータの5分の1とする。

・1限月のみの商品については、納会月割増額及び商品内スプレッド割増額は適用除外となるため、“-”で表示する。

(2)オプション

商品グループ	ボラティリティ・スキャンレンジ(%)	売オプション1単位当たりの最低証拠金額
金オプション	3.0	¥300

・売オプション1単位当たりの最低証拠金額=プライス・スキャンレンジ×デルタ・スケーリング係数×2.5% (100円単位に切り上げ)

(3)商品間スプレッド割引

優先順位	商品間スプレッド	商品間デルタ/スプレッド比率	商品間スプレッド・クレジット・レート(%)
1	東京ゴールドスポット100 : 金	1.00 : 0.10	91
2	ドバイ原油 : 東京バージ灯油	1.17 : 1.00	50
3	中京ローリーガソリン : 東京バージガソリン	5.83 : 1.00	50
4	ドバイ原油 : 東京バージガソリン	1.00 : 1.05	50
5	中京ローリーガソリン : ドバイ原油	5.25 : 1.00	50
6	東京バージガソリン : 東京バージ灯油	1.65 : 1.00	30
7	中京ローリーガソリン : 東京バージ灯油	5.53 : 1.00	50
8	中京ローリー灯油 : 東京バージ灯油	4.76 : 1.00	20
9	中京ローリー灯油 : ドバイ原油	3.02 : 1.00	20
10	中京ローリーガソリン : 中京ローリー灯油	2.62 : 1.00	20
11	中京ローリー灯油 : 東京バージガソリン	2.05 : 1.00	20
12	パラジウム : 白金	1.00 : 1.44	30

2. 大阪堂島商品取引所

(1)先物

商品グループ	プライス・ スキャンレンジ	納会月割増額		1ネット・デルタ当たりの 商品内スプレッド割増額
		アウトライト・チャージ	スプレッド・チャージ	
冷凍えび	¥10,000	¥0	¥0	¥5,000
コーン75指数	¥60,000	¥0	¥0	¥5,000
とうもろこし	¥35,000	¥0	¥0	¥5,000
米国産大豆	¥25,000	¥0	¥0	¥5,000
小豆	¥20,000	¥0	¥0	¥5,000
大阪コメ	¥15,000	¥0	¥0	¥15,000
東京コメ	¥60,000	¥0	¥0	¥30,000
粗糖	¥25,000	¥0	¥0	¥5,000

・プライス・スキャンレンジは、単一商品の単一限月取引において1単位買い(又は売り)建てた場合の証拠金額に相当する。

(2)オプション

対象商品なし

(3)商品間スプレッド割引

優先順位	商品間スプレッド	商品間デルタ/スプレッド比率	商品間スプレッド クレジット・レート (%)
1	東京コメ : 大阪コメ	1.00 : 3.86	20