

## SPANパラメータ(適用:2017年3月16日~17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          | ¥102,000     | ¥0          | ¥0         | ¥25,000                 |
| ゴールドスポット   | ¥10,200      | -           | -          | -                       |
| 銀          | ¥45,000      | ¥0          | ¥0         | ¥45,000                 |
| 白金         | ¥66,000      | ¥0          | ¥0         | ¥30,000                 |
| パラジウム      | ¥100,000     | ¥0          | ¥0         | ¥100,000                |
| バージガソリン    | ¥140,000     | ¥0          | ¥0         | ¥45,000                 |
| バージ灯油      | ¥140,000     | ¥0          | ¥0         | ¥40,000                 |
| ドバイ原油      | ¥145,000     | ¥0          | ¥0         | ¥30,000                 |
| バージ軽油      | ¥150,000     | ¥0          | ¥0         | ¥65,000                 |
| 中京ローリーガソリン | ¥40,000      | ¥0          | ¥0         | ¥40,000                 |
| 中京ローリー灯油   | ¥40,000      | ¥0          | ¥0         | ¥40,000                 |
| ゴム         | ¥100,000     | ¥0          | ¥0         | ¥50,000                 |
| とうもろこし     | ¥45,000      | ¥0          | ¥0         | ¥40,000                 |
| 一般大豆       | ¥45,000      | ¥0          | ¥0         | ¥45,000                 |
| 小豆         | ¥40,000      | ¥0          | ¥0         | ¥40,000                 |

・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    | ゴールドスポット : 金          | 1.00 : 0.10    | 93                    |
| 2    | 金 : 白金                | 1.00 : 2.00    | 66                    |
| 3    | ゴールドスポット : 白金         | 5.00 : 1.00    | 65                    |
| 4    | パラジウム : 白金            | 1.00 : 1.00    | 64                    |
| 5    | ドバイ原油 : バージガソリン       | 1.00 : 1.00    | 93                    |
| 6    | ドバイ原油 : バージ灯油         | 1.00 : 1.00    | 84                    |
| 7    | バージガソリン : バージ灯油       | 1.00 : 1.00    | 79                    |
| 8    | 中京ローリーガソリン : バージ灯油    | 5.00 : 1.00    | 69                    |
| 9    | 中京ローリーガソリン : バージガソリン  | 5.00 : 1.00    | 69                    |
| 10   | 中京ローリーガソリン : ドバイ原油    | 5.00 : 1.00    | 65                    |
| 11   | 中京ローリーガソリン : 中京ローリー灯油 | 1.00 : 1.00    | 60                    |
| 12   | 中京ローリー灯油 : バージ灯油      | 5.00 : 1.00    | 55                    |
| 13   | 中京ローリー灯油 : ドバイ原油      | 5.00 : 1.00    | 51                    |
| 14   | 中京ローリー灯油 : バージガソリン    | 5.00 : 1.00    | 50                    |

## 2. 大阪堂島商品取引所

### (1)先物

| 商品グループ  | プライス・<br>スキャンレンジ | 納会月割増額      |            | 1ネット・デルタ当たりの<br>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         | ¥35,000                     |
| 新潟コシ    | ¥10,000          | ¥0          | ¥0         | ¥10,000                     |
| 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・<br>クレジット・レート(%) |
|------|-------------|----------------|---------------------------|
| 1    | 東京コメ : 大阪コメ | 1.00 : 4.00    | 39                        |