

SPANパラメータ(適用:2017年3月21日~31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
プラチナスポット	¥13,200	-	-	-
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	白金 : プラチナスポット	1.00 : 5.00	79
3	金 : 白金	1.00 : 2.00	66
4	ゴールドスポット : プラチナスポット	1.00 : 1.00	63
5	金 : プラチナスポット	0.10 : 1.00	64
6	ゴールドスポット : 白金	5.00 : 1.00	65
7	パラジウム : 白金	1.00 : 1.00	64
8	ドバイ原油 : バージガソリン	1.00 : 1.00	93
9	ドバイ原油 : バージ灯油	1.00 : 1.00	84
10	バージガソリン : バージ灯油	1.00 : 1.00	79
11	中京ローリーガソリン : バージ灯油	5.00 : 1.00	69
12	中京ローリーガソリン : バージガソリン	5.00 : 1.00	69
13	中京ローリーガソリン : ドバイ原油	5.00 : 1.00	65
14	中京ローリーガソリン : 中京ローリー灯油	1.00 : 1.00	60
15	中京ローリー灯油 : バージ灯油	5.00 : 1.00	55
16	中京ローリー灯油 : ドバイ原油	5.00 : 1.00	51
17	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・ 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	¥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・ クレジット・レート(%)
1	東京コメ : 大阪コメ	1.00 : 4.00	39