

## SPANパラメータ(適用:2018年3月1日~15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	¥66,000	¥0	¥0	¥20,000
ゴールドスポット	¥6,600	-	-	-
銀	¥30,000	¥0	¥0	¥30,000
白金	¥48,000	¥0	¥0	¥15,000
プラチナスポット	¥9,600	-	-	-
パラジウム	¥100,000	¥0	¥0	¥100,000
バージガソリン	¥90,000	¥0	¥0	¥25,000
バージ灯油	¥90,000	¥0	¥0	¥35,000
プラッツドバイ原油	¥95,000	¥0	¥0	¥15,000
バージ軽油	¥125,000	¥0	¥0	¥65,000
中京ローリーガソリン	¥50,000	¥0	¥0	¥50,000
中京ローリー灯油	¥50,000	¥0	¥0	¥50,000
バージガソリンスワップ	¥90,000	¥0	¥0	¥90,000
プラッツバージ灯油スワップ	¥90,000	¥0	¥0	¥90,000
プラッツバージ軽油スワップ	¥125,000	¥0	¥0	¥90,000
ローリーガソリンスワップ	¥50,000	¥0	¥0	¥50,000
プラッツローリー灯油スワップ	¥50,000	¥0	¥0	¥50,000
プラッツローリー軽油スワップ	¥25,000	¥0	¥0	¥25,000
ゴム*	¥50,000	¥25,000	¥25,000	¥15,000
とうもろこし	¥30,000	¥20,000	¥20,000	¥20,000
一般大豆	¥60,000	¥0	¥0	¥60,000
小豆	¥45,000	¥0	¥0	¥45,000

・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。

※ゴムの納会月割増額については、納会日の夜間取引から月末最終営業日の日中立会の期間、上記に関わらず「¥0」とする。

## (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	¥200

・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	91
2	白金 : プラチナスポット	1.00 : 5.00	87
3	金 : 白金	1.00 : 2.00	59
4	ゴールドスポット : プラチナスポット	1.00 : 1.00	53
5	金 : プラチナスポット	0.10 : 1.00	54
6	ゴールドスポット : 白金	5.00 : 1.00	58
7	パラジウム : 白金	1.00 : 1.00	52
8	プラッツドバイ原油 : バージガソリン	1.00 : 1.00	85
9	プラッツドバイ原油 : バージ灯油	1.00 : 1.00	73
10	バージガソリン : バージ灯油	1.00 : 1.00	71
11	中京ローリーガソリン : バージ灯油	5.00 : 1.00	46
12	中京ローリーガソリン : バージガソリン	5.00 : 1.00	44
13	中京ローリーガソリン : プラッツドバイ原油	5.00 : 1.00	42
14	中京ローリーガソリン : 中京ローリー灯油	1.00 : 1.00	44
15	中京ローリー灯油 : バージ灯油	5.00 : 1.00	31
16	中京ローリー灯油 : プラッツドバイ原油	5.00 : 1.00	33
17	中京ローリー灯油 : バージガソリン	5.00 : 1.00	31
18	バージガソリン : バージガソリンスワップ	1.00 : 1.00	62
19	バージガソリン : ローリーガソリンスワップ	1.00 : 5.00	71
20	バージガソリンスワップ : ローリーガソリンスワップ	1.00 : 5.00	89
21	バージ灯油 : プラッツバージ灯油スワップ	1.00 : 1.00	61
22	バージ灯油 : プラッツローリー灯油スワップ	1.00 : 5.00	60
23	プラッツバージ灯油スワップ : プラッツローリー灯油スワップ	1.00 : 5.00	79
24	プラッツドバイ原油 : バージガソリンスワップ	1.00 : 1.00	67
25	プラッツドバイ原油 : ローリーガソリンスワップ	1.00 : 5.00	72
26	プラッツドバイ原油 : プラッツバージ灯油スワップ	1.00 : 1.00	57
27	プラッツドバイ原油 : プラッツローリー灯油スワップ	1.00 : 5.00	63
28	バージガソリン : プラッツバージ灯油スワップ	1.00 : 1.00	60
29	バージガソリン : プラッツローリー灯油スワップ	1.00 : 5.00	65
30	バージ灯油 : バージガソリンスワップ	1.00 : 1.00	52
31	バージ灯油 : ローリーガソリンスワップ	1.00 : 5.00	64
32	バージガソリンスワップ : プラッツバージ灯油スワップ	1.00 : 1.00	80
33	プラッツバージ灯油スワップ : ローリーガソリンスワップ	1.00 : 5.00	72
34	バージガソリンスワップ : プラッツローリー灯油スワップ	1.00 : 5.00	81
35	ローリーガソリンスワップ : プラッツローリー灯油スワップ	1.00 : 1.00	77

## 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	¥20,000	¥0	¥0	¥20,000
東京コメ	¥60,000	¥0	¥0	¥50,000
新潟コシ	¥10,000	¥0	¥0	¥10,000
粗糖	¥25,000	¥0	¥0	¥5,000

### (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	71
2	新潟コシ : 大阪コメ	2.00 : 1.00	68
3	新潟コシ : 東京コメ	8.00 : 1.00	55