

2018年12月25日

各 位

株式会社 日本商品清算機構

SPAN パラメータの臨時見直しの実施に係る判定結果について

SPAN パラメータの臨時見直しの実施に係る判定の結果、(株)東京商品取引所のバージガソリン、バージ灯油、プラッツドバイ原油について、以下のとおり 2018 年 12 月下旬適用及び 2019 年 1 月上旬適用予定の SPAN パラメータの臨時見直しを実施することとしましたのでお知らせいたします。

・ 変更後パラメータ適用期間：**2018年12月27日～2019年1月15日**

(12月26日の夜間取引～2019年1月15日の日中取引の計算区域にかかる取引及び建玉が対象)

1 (株)東京商品取引所 バージガソリン

	プライス・ スキャンレンジ	商品内 スプレッド割増額	納会月割増額 アウトライトチャージ	納会月割増額 スプレッドチャージ
変更前	100,000 円	35,000 円	0 円	0 円
変更後	150,000 円	変更なし	変更なし	変更なし

2 (株)東京商品取引所 バージ灯油

	プライス・ スキャンレンジ	商品内 スプレッド割増額	納会月割増額 アウトライトチャージ	納会月割増額 スプレッドチャージ
変更前	110,000 円	35,000 円	0 円	0 円
変更後	165,000 円	変更なし	変更なし	変更なし

3 (株)東京商品取引所 プラッツドバイ原油

	プライス・ スキャンレンジ	商品内 スプレッド割増額	納会月割増額 アウトライトチャージ	納会月割増額 スプレッドチャージ
変更前	120,000 円	(12月下旬) 20,000 円 (1月上旬) 15,000 円	0 円	0 円
変更後	180,000 円	変更なし	変更なし	変更なし

※バージガソリンスワップにつきましては、臨時見直し判定基準に該当しましたが、市場状況を勘案し、臨時見直しは行ないません。

※上記以外のパラメータに関しては、変更ございません。

以 上

連絡先 業務部 リスク管理課

(問合せ先 03-5847-7523)