

2020年3月9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 金グループ、ゴールドスポット、バージガソリン、バージ灯油、プラッツドバイ原油、バージ軽油、とうもろこしについて、以下のとおり2020年3月上旬適用の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：**3月11日～3月13日**

(3月10日の夜間取引～3月13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 金グループ

	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	114,000 円	25,000 円	0 円	0 円
変更後	174,000 円	変更なし	変更なし	変更なし

	売オプション1単位 当たりの最低証拠金額
変更前	300 円
変更後	500 円

2 (株)東京商品取引所 ゴールドスポット

	プライス・ スキャンレンジ
変更前	11,400 円
変更後	17,400 円

3 (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	120,000 円	30,000 円	5,000 円	5,000 円
変更後	240,000 円	45,000 円	変更なし	変更なし

4 株式会社東京商品取引所 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	125,000 円	60,000 円	0 円	0 円
変更後	240,000 円	90,000 円	変更なし	変更なし

5 株式会社東京商品取引所 プラツトバイ原油

	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	115,000 円	35,000 円	0 円	0 円
変更後	240,000 円	55,000 円	変更なし	変更なし

6 株式会社東京商品取引所 バージ軽油

	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	100,000 円	15,000 円	0 円	0 円
変更後	240,000 円	変更なし	変更なし	変更なし

7 株式会社東京商品取引所 とうもろこし

	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	30,000 円	30,000 円	5,000 円	5,000 円
変更後	45,000 円	変更なし	変更なし	変更なし

※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 リスク管理部 リスク管理課
(問合せ先 03-5847-7686)