

## SPANパラメータ(適用:2018年10月16日~19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	¥15,000
ゴールドスポット	¥6,600	-	-	-
銀	¥25,000	¥5,000	¥5,000	¥25,000
白金	¥54,000	¥0	¥0	¥15,000
プラチナスポット	¥10,800	-	-	-
パラジウム	¥85,000	¥0	¥0	¥85,000
バージガソリン	¥110,000	¥10,000	¥10,000	¥25,000
バージ灯油	¥105,000	¥0	¥0	¥30,000
プラッツドバイ原油	¥125,000	¥0	¥0	¥20,000
バージ軽油	¥105,000	¥0	¥0	¥45,000
中京ローリーガソリン	¥60,000	¥0	¥0	¥60,000
中京ローリー灯油	¥55,000	¥0	¥0	¥55,000
バージガソリンスワップ	¥110,000	¥0	¥0	¥110,000
プラッツバージ灯油スワップ	¥105,000	¥0	¥0	¥105,000
プラッツバージ軽油スワップ	¥105,000	¥0	¥0	¥105,000
ローリーガソリンスワップ	¥60,000	¥0	¥0	¥60,000
プラッツローリー灯油スワップ	¥55,000	¥0	¥0	¥55,000
プラッツローリー軽油スワップ	¥25,000	¥0	¥0	¥25,000
ゴム RSS3 <sup>※</sup>	¥40,000	¥20,000	¥20,000	¥25,000
ゴム TSR20	¥40,000	¥20,000	¥20,000	¥25,000
とうもろこし	¥40,000	¥20,000	¥20,000	¥35,000
一般大豆	¥70,000	¥0	¥0	¥70,000
小豆	¥50,000	¥0	¥0	¥50,000

・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 RSS3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	89
2	白金 : プラチナスポット	1.00 : 5.00	83
3	金 : 白金	1.00 : 2.00	63
4	ゴールドスポット : プラチナスポット	1.00 : 1.00	50
5	金 : プラチナスポット	0.10 : 1.00	48
6	ゴールドスポット : 白金	5.00 : 1.00	61
7	パラジウム : 白金	1.00 : 1.00	57
8	プラッツドバイ原油 : バージガソリン	1.00 : 1.00	88
9	プラッツドバイ原油 : バージ灯油	1.00 : 1.00	90
10	バージガソリン : バージ灯油	1.00 : 1.00	88
11	中京ローリーガソリン : バージ灯油	5.00 : 1.00	49
12	中京ローリーガソリン : バージガソリン	5.00 : 1.00	54
13	中京ローリーガソリン : プラッツドバイ原油	5.00 : 1.00	60
14	中京ローリーガソリン : 中京ローリー灯油	1.00 : 1.00	49
15	中京ローリー灯油 : バージ灯油	5.00 : 1.00	34
16	中京ローリー灯油 : プラッツドバイ原油	5.00 : 1.00	38
17	中京ローリー灯油 : バージガソリン	5.00 : 1.00	34
18	バージガソリン : バージガソリンスワップ	1.00 : 1.00	67
19	バージガソリン : ローリーガソリンスワップ	1.00 : 5.00	64
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	79
21	バージ灯油 : プラッツバージ灯油スワップ	1.00 : 1.00	51
22	バージ灯油 : プラッツローリー灯油スワップ	1.00 : 5.00	57
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	81
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	66
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	70
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	58
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	61
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	56
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	59
30	バージ灯油 : バージガソリンスワップ	1.00 : 1.00	64
31	バージ灯油 : ローリーガソリンスワップ	1.00 : 5.00	63
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	73
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	75
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	76
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	81
36	ゴム RSS3 : ゴム TSR20	1.00 : 1.00	20

## 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	
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	¥55,000
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	17
2	新潟コシ : 大阪コメ	2.00 : 1.00	44
3	新潟コシ : 東京コメ	8.00 : 1.00	57