

SPANパラメータ(適用:2019年10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 | ¥108,000 | ¥0 | ¥0 | ¥25,000 |
| ゴールドスポット | ¥10,800 | - | - | - |
| 銀 | ¥30,000 | ¥0 | ¥0 | ¥25,000 |
| 白金 | ¥60,000 | ¥0 | ¥0 | ¥15,000 |
| プラチナスポット | ¥18,000 | - | - | - |
| パラジウム | ¥175,000 | ¥0 | ¥0 | ¥175,000 |
| バージガソリン | ¥150,000 | ¥30,000 | ¥30,000 | ¥25,000 |
| バージ灯油 | ¥140,000 | ¥0 | ¥0 | ¥40,000 |
| プラッツドバイ原油 | ¥135,000 | ¥0 | ¥0 | ¥30,000 |
| バージ軽油 | ¥110,000 | ¥0 | ¥0 | ¥15,000 |
| 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 |
| バージガソリンスワップ | ¥150,000 | ¥0 | ¥0 | ¥150,000 |
| プラッツバージ灯油スワップ | ¥140,000 | ¥0 | ¥0 | ¥140,000 |
| プラッツバージ軽油スワップ | ¥110,000 | ¥0 | ¥0 | ¥110,000 |
| ローリーガソリンスワップ | ¥40,000 | ¥0 | ¥0 | ¥40,000 |
| プラッツローリー灯油スワップ | ¥40,000 | ¥0 | ¥0 | ¥40,000 |
| プラッツローリー軽油スワップ | ¥25,000 | ¥0 | ¥0 | ¥25,000 |
| 東エリア・ベースロード電力 | ¥100,000 | ¥0 | ¥0 | ¥200,000 |
| 西エリア・ベースロード電力 | ¥90,000 | ¥0 | ¥0 | ¥180,000 |
| 東エリア・日中ロード電力 | ¥50,000 | ¥0 | ¥0 | ¥100,000 |
| 西エリア・日中ロード電力 | ¥50,000 | ¥0 | ¥0 | ¥100,000 |
| ゴム RSS3 [※] | ¥50,000 | ¥25,000 | ¥25,000 | ¥50,000 |
| ゴム TSR20 | ¥70,000 | ¥35,000 | ¥35,000 | ¥65,000 |
| とうもろこし | ¥60,000 | ¥0 | ¥0 | ¥60,000 |
| 一般大豆 | ¥80,000 | ¥0 | ¥0 | ¥80,000 |
| 小豆 | ¥105,000 | ¥0 | ¥0 | ¥105,000 |

・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 | ¥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・スケール係数×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 | 88 |
| 2 | 白金 : プラチナスポット | 1.00 : 5.00 | 86 |
| 3 | 金 : 白金 | 1.00 : 2.00 | 37 |
| 4 | ゴールドスポット : プラチナスポット | 1.00 : 1.00 | 37 |
| 5 | 金 : プラチナスポット | 0.10 : 1.00 | 45 |
| 6 | ゴールドスポット : 白金 | 5.00 : 1.00 | 30 |
| 7 | パラジウム : 白金 | 1.00 : 1.00 | 44 |
| 8 | プラッツドバイ原油 : バージガソリン | 1.00 : 1.00 | 87 |
| 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 | 84 |
| 11 | 中京ローリーガソリン : バージ灯油 | 5.00 : 1.00 | 64 |
| 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 : プラッツドバイ原油 | 5.00 : 1.00 | 67 |
| 14 | 中京ローリーガソリン : 中京ローリー灯油 | 1.00 : 1.00 | 39 |
| 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 | 20 |
| 17 | 中京ローリー灯油 : バージガソリン | 5.00 : 1.00 | 18 |
| 18 | バージガソリン : バージガソリンスワップ | 1.00 : 1.00 | 35 |
| 19 | バージガソリン : ローリーガソリンスワップ | 1.00 : 5.00 | 20 |
| 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 | 64 |
| 21 | バージ灯油 : プラッツバージ灯油スワップ | 1.00 : 1.00 | 41 |
| 22 | バージ灯油 : プラッツローリー灯油スワップ | 1.00 : 5.00 | 46 |
| 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 | 63 |
| 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 | 36 |
| 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 | 26 |
| 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 | 38 |
| 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 | 36 |
| 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 | 43 |
| 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 | 37 |
| 30 | バージ灯油 : バージガソリンスワップ | 1.00 : 1.00 | 47 |
| 31 | バージ灯油 : ローリーガソリンスワップ | 1.00 : 5.00 | 35 |
| 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 | 60 |
| 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 | 57 |
| 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 | 58 |
| 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 | 51 |
| 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 |
| 東京コメ | ¥50,000 | ¥0 | ¥0 | ¥50,000 |
| 新潟コシ | ¥10,000 | ¥0 | ¥0 | ¥10,000 |
| 秋田こまち | ¥50,000 | ¥0 | ¥0 | ¥50,000 |
| 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 | 新潟コシ : 東京コメ | 8.00 : 1.00 | 45 |