

## SPANパラメータ(適用:2020年1月16日~31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	¥35,000	¥5,000	¥5,000	¥35,000
白金	¥78,000	¥0	¥0	¥15,000
プラチナスポット	¥16,800	-	-	-
パラジウム	¥220,000	¥0	¥0	¥220,000
バージガソリン	¥140,000	¥10,000	¥10,000	¥30,000
バージ灯油	¥150,000	¥0	¥0	¥40,000
ブラッドバイ原油	¥145,000	¥0	¥0	¥25,000
バージ軽油	¥105,000	¥0	¥0	¥20,000
中京ローリーガソリン	¥35,000	¥0	¥0	¥35,000
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	¥140,000	¥0	¥0	¥140,000
ブラッドバージ灯油スワップ	¥150,000	¥0	¥0	¥150,000
ブラッド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	¥35,000	¥0	¥0	¥35,000
ブラッドローリー灯油スワップ	¥40,000	¥0	¥0	¥40,000
ブラッド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	¥90,000	¥0	¥0	¥180,000
西エリア・ベースロード電力	¥80,000	¥0	¥0	¥160,000
東エリア・日中ロード電力	¥40,000	¥0	¥0	¥80,000
西エリア・日中ロード電力	¥40,000	¥0	¥0	¥80,000
ゴム RSS3 <sup>※</sup>	¥60,000	¥30,000	¥30,000	¥55,000
ゴム TSR20	¥80,000	¥40,000	¥40,000	¥80,000
とうもろこし	¥60,000	¥0	¥0	¥60,000
一般大豆	¥80,000	¥0	¥0	¥80,000
小豆	¥100,000	¥0	¥0	¥100,000

・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	88
2	白金 : プラチナスポット	1.00 : 5.00	89
3	金 : 白金	1.00 : 2.00	58
4	ゴールドスポット : プラチナスポット	1.00 : 1.00	54
5	金 : プラチナスポット	0.10 : 1.00	59
6	ゴールドスポット : 白金	5.00 : 1.00	56
7	パラジウム : 白金	1.00 : 1.00	62
8	ブラツッドバイ原油 : バージガソリン	1.00 : 1.00	87
9	ブラツッドバイ原油 : バージ灯油	1.00 : 1.00	85
10	バージガソリン : バージ灯油	1.00 : 1.00	85
11	中京ローリーガソリン : バージ灯油	5.00 : 1.00	59
12	中京ローリーガソリン : バージガソリン	5.00 : 1.00	66
13	中京ローリーガソリン : ブラツッドバイ原油	5.00 : 1.00	65
14	中京ローリーガソリン : 中京ローリー灯油	1.00 : 1.00	31
15	中京ローリー灯油 : バージ灯油	5.00 : 1.00	42
16	中京ローリー灯油 : ブラツッドバイ原油	5.00 : 1.00	32
17	中京ローリー灯油 : バージガソリン	5.00 : 1.00	35
18	ゴム RSS3 : ゴム TSR20	1.00 : 1.00	19

## 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 商品間スプレッド割増額
		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	¥30,000	¥0	¥0	¥30,000
新潟コシ	¥15,000	¥0	¥0	¥15,000
秋田こまち	¥30,000	¥0	¥0	¥30,000
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	34