

2020年7月

株式会社日本証券クリアリング機構

商品デリバティブに係る SPAN パラメーターの取扱い（別紙）

「商品デリバティブに係る SPAN パラメーターの取扱い」におけるⅡ 1 ③で定める商品グループに係るプライス・スキャンレンジの設定方法について、備考欄に記載の乗数 Y% を下表のとおり定めるものとする。

取引所	商品グループ	乗数 Y%
大阪取引所	とうもろこしグループ	4%
大阪取引所	一般大豆グループ	7%
大阪取引所	小豆グループ	4%
東京商品取引所	東エリア・ベースロード先物グループ	10%
東京商品取引所	西エリア・ベースロード先物グループ	10%
東京商品取引所	東エリア・日中ロード先物グループ	10%
東京商品取引所	西エリア・日中ロード先物グループ	10%
大阪堂島取引所	とうもろこし 50 グループ	3%
大阪堂島取引所	米国産大豆グループ	5%
大阪堂島取引所	小豆グループ	4%
大阪堂島取引所	東京コメグループ	2%
大阪堂島取引所	新潟コシグループ	3%
大阪堂島取引所	秋田こまちグループ	2%
大阪堂島取引所	秋田こまち 17 グループ	2%
大阪堂島取引所	宮城ひとめ 18 グループ	2%
大阪堂島取引所	粗糖グループ	6%

以 上