

## SPANパラメータ (適用：平成28年1月18日～1月29日)

## 1. 先物

取引所	商品グループ	プライス・スキャンレンジ(円)	Delivery Month Charge(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(円)
			アウトライト・チャージ	スプレッド・チャージ	
東京商品取引所	金	¥96,000	¥0	¥0	¥15,000
東京商品取引所	金限日取引	¥9,600	-	-	-
東京商品取引所	銀	¥30,000	¥0	¥0	¥25,000
東京商品取引所	白金	¥78,000	¥0	¥0	¥10,000
東京商品取引所	パラジウム	¥90,000	¥0	¥0	¥75,000
東京商品取引所	ガソリン	¥100,000	¥0	¥0	¥20,000
東京商品取引所	灯油	¥100,000	¥0	¥0	¥25,000
東京商品取引所	原油	¥100,000	¥0	¥0	¥15,000
東京商品取引所	軽油	¥100,000	¥0	¥0	¥65,000
東京商品取引所	中京石油 ガソリン	¥25,000	¥0	¥0	¥20,000
東京商品取引所	中京石油 灯油	¥25,000	¥0	¥0	¥40,000
東京商品取引所	ゴム	¥35,000	¥0	¥0	¥10,000
東京商品取引所	とうもろこし	¥35,000	¥0	¥0	¥25,000
東京商品取引所	一般大豆 25t (16年4月限以降) 10t (16年2月限)	¥25,000	¥10,000	¥10,000	¥25,000
		¥10,000			
東京商品取引所	小豆	¥25,000	¥5,000	¥5,000	¥25,000
大阪堂島商品取引所	冷凍えび	¥10,000	¥0	¥0	¥5,000
大阪堂島商品取引所	コーン75指数	¥60,000	¥0	¥0	¥5,000
大阪堂島商品取引所	とうもろこし	¥35,000	¥0	¥0	¥5,000
大阪堂島商品取引所	米国産大豆	¥25,000	¥0	¥0	¥5,000
大阪堂島商品取引所	小豆	¥20,000	¥0	¥0	¥5,000
大阪堂島商品取引所	大阪コメ	¥15,000	¥0	¥0	¥10,000
大阪堂島商品取引所	東京コメ	¥60,000	¥0	¥0	¥60,000
大阪堂島商品取引所	粗糖	¥25,000	¥0	¥0	¥5,000

・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限月のみとなった商品については、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。

## 2. オプション

取引所	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(円)
東京商品取引所	金	0.5	¥3,000

・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×2.5% (千円単位に切上げ)

## 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	東商取 金限日取引 : 東商取 金	100:10	92
2	東商取 原油 : 東商取 中京石油 ガソリン	100:546	50
3	東商取 原油 : 東商取 ガソリン	100:114	50
4	東商取 ガソリン : 東商取 中京石油 ガソリン	100:487	50
5	東商取 灯油 : 東商取 原油	100:131	50
6	東商取 灯油 : 東商取 中京石油 ガソリン	100:704	50
7	東商取 灯油 : 東商取 ガソリン	100:156	50
8	東商取 灯油 : 東商取 中京石油 灯油	100:520	30
9	東商取 原油 : 東商取 中京石油 灯油	100:386	30
10	東商取 中京石油 灯油 : 東商取 中京石油 ガソリン	100:145	30
11	東商取 ガソリン : 東商取 中京石油 灯油	100:338	30
12	大阪取 東京コメ : 大阪取 大阪コメ	100:581	20
13	東商取 金 : 東商取 銀	100:480	20
14	東商取 白金 : 東商取 金	100:112	20