

SPANパラメータ(適用:2017年7月18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	¥72,000	¥0	¥0	¥15,000
ゴールドスポット	¥7,200	-	-	-
銀	¥30,000	¥0	¥0	¥30,000
白金	¥54,000	¥0	¥0	¥20,000
プラチナスポット	¥10,800	-	-	-
パラジウム	¥110,000	¥0	¥0	¥85,000
バージガソリン	¥105,000	¥0	¥0	¥30,000
バージ灯油	¥105,000	¥0	¥0	¥30,000
プラッツドバイ原油	¥105,000	¥0	¥0	¥25,000
バージ軽油	¥105,000	¥0	¥0	¥65,000
中京ローリーガソリン	¥35,000	¥0	¥0	¥35,000
中京ローリー灯油	¥35,000	¥0	¥0	¥35,000
バージガソリンスワップ	¥105,000	¥0	¥0	¥105,000
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	¥55,000
ローリーガソリンスワップ	¥35,000	¥0	¥0	¥35,000
プラッツローリー灯油スワップ	¥35,000	¥0	¥0	¥35,000
プラッツローリー軽油スワップ	¥25,000	¥0	¥0	¥15,000
ゴム	¥80,000	¥0	¥0	¥50,000
とうもろこし	¥30,000	¥0	¥0	¥25,000
一般大豆	¥45,000	¥5,000	¥5,000	¥45,000
小豆	¥30,000	¥0	¥0	¥30,000

・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。

(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	90
2	白金 : プラチナスポット	1.00 : 5.00	82
3	金 : 白金	1.00 : 2.00	51
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	57
6	ゴールドスポット : 白金	5.00 : 1.00	52
7	パラジウム : 白金	1.00 : 1.00	59
8	ブラツツドバイ原油 : バージガソリン	1.00 : 1.00	84
9	ブラツツドバイ原油 : バージ灯油	1.00 : 1.00	82
10	バージガソリン : バージ灯油	1.00 : 1.00	71
11	中京ローリーガソリン : バージ灯油	5.00 : 1.00	61
12	中京ローリーガソリン : バージガソリン	5.00 : 1.00	58
13	中京ローリーガソリン : ブラツツドバイ原油	5.00 : 1.00	59
14	中京ローリーガソリン : 中京ローリー灯油	1.00 : 1.00	59
15	中京ローリー灯油 : バージ灯油	5.00 : 1.00	51
16	中京ローリー灯油 : ブラツツドバイ原油	5.00 : 1.00	42
17	中京ローリー灯油 : バージガソリン	5.00 : 1.00	45
18	バージガソリン : バージガソリンスワップ	1.00 : 1.00	20
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	20
21	バージ灯油 : プラツツバージ灯油スワップ	1.00 : 1.00	20
22	バージ灯油 : プラツツローリー灯油スワップ	1.00 : 5.00	20
23	プラツツバージ灯油スワップ : プラツツローリー灯油スワップ	1.00 : 5.00	20
24	ブラツツドバイ原油 : バージガソリンスワップ	1.00 : 1.00	20
25	ブラツツドバイ原油 : ローリーガソリンスワップ	1.00 : 5.00	20
26	ブラツツドバイ原油 : プラツツバージ灯油スワップ	1.00 : 1.00	20
27	ブラツツドバイ原油 : プラツツローリー灯油スワップ	1.00 : 5.00	20
28	バージガソリン : プラツツバージ灯油スワップ	1.00 : 1.00	20
29	バージガソリン : プラツツローリー灯油スワップ	1.00 : 5.00	20
30	バージ灯油 : バージガソリンスワップ	1.00 : 1.00	20
31	バージ灯油 : ローリーガソリンスワップ	1.00 : 5.00	20
32	バージガソリンスワップ : プラツツバージ灯油スワップ	1.00 : 1.00	20
33	プラツ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	20
34	バージガソリンスワップ : プラツツローリー灯油スワップ	1.00 : 5.00	20
35	ローリーガソリンスワップ : プラツツローリー灯油スワップ	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	
冷凍えび	¥10,000	¥0	¥0	¥5,000
コーン75指数	¥60,000	¥0	¥0	¥5,000
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	¥10,000
東京コメ	¥60,000	¥0	¥0	¥35,000
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	56