

SPANパラメータ(適用:2020年5月18日～29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	¥222,000	¥0	¥0	¥45,000
ゴールドスポット	¥22,200	-	-	-
銀	¥60,000	¥0	¥0	¥95,000
白金	¥174,000	¥0	¥0	¥60,000
プラチナスポット	¥33,000	-	-	-
パラジウム	¥495,000	¥30,000	¥30,000	¥480,000
バージガソリン	¥395,000	¥25,000	¥25,000	¥150,000
バージ灯油	¥355,000	¥10,000	¥10,000	¥365,000
プラツツバイ原油	¥400,000	¥0	¥0	¥140,000
バージ軽油	¥285,000	¥0	¥0	¥100,000
中京ローリーガソリン	¥50,000	¥5,000	¥5,000	¥35,000
中京ローリー灯油	¥40,000	¥15,000	¥15,000	¥35,000
バージガソリンスワップ	¥395,000	¥0	¥0	¥395,000
プラツツバージ灯油スワップ	¥355,000	¥0	¥0	¥355,000
プラツツバージ軽油スワップ	¥285,000	¥0	¥0	¥285,000
ローリーガソリンスワップ	¥50,000	¥0	¥0	¥50,000
プラツツローリー灯油スワップ	¥40,000	¥0	¥0	¥40,000
プラツツローリー軽油スワップ	¥60,000	¥0	¥0	¥60,000
東エリア・ベースロード電力	¥70,000	¥0	¥0	¥140,000
西エリア・ベースロード電力	¥60,000	¥0	¥0	¥120,000
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	¥30,000	¥0	¥0	¥60,000
ゴム RSS3※	¥50,000	¥25,000	¥25,000	¥20,000
ゴム TSR20	¥80,000	¥40,000	¥40,000	¥80,000
とうもろこし	¥50,000	¥10,000	¥10,000	¥40,000
一般大豆	¥80,000	¥0	¥0	¥80,000
小豆	¥55,000	¥0	¥0	¥65,000

・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	¥600

・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	89
2	白金 : プラチナスポット	1.00 : 5.00	79
3	金 : 白金	1.00 : 2.00	69
4	ゴールドスポット : プラチナスポット	1.00 : 1.00	63
5	金 : プラチナスポット	0.10 : 1.00	58
6	ゴールドスポット : 白金	5.00 : 1.00	65
7	パラジウム : 白金	1.00 : 1.00	46
8	ブラツッドバイ原油 : バージガソリン	1.00 : 1.00	93
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	89
11	中京ローリーガソリン : バージ灯油	5.00 : 1.00	43
12	中京ローリーガソリン : バージガソリン	5.00 : 1.00	48
13	中京ローリーガソリン : ブラツッドバイ原油	5.00 : 1.00	48
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	26
16	中京ローリー灯油 : ブラツッドバイ原油	5.00 : 1.00	39
17	中京ローリー灯油 : バージガソリン	5.00 : 1.00	37
18	ゴム RSS3 : ゴム TSR20	1.00 : 1.00	16

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50	¥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	¥5,000	¥5,000	¥50,000
新潟コシ	¥10,000	¥0	¥0	¥10,000
秋田こまち	¥40,000	¥5,000	¥5,000	¥45,000
秋田こまち17	¥5,000	¥0	¥0	¥5,000
宮城ひとめ18	¥5,000	¥0	¥0	¥5,000
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	43