

SPANパラメータ(適用:2020年3月2日~13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              | ¥114,000     | ¥0          | ¥0         | ¥25,000                 |
| ゴールドスポット       | ¥11,400      | -           | -          | -                       |
| 銀              | ¥35,000      | ¥5,000      | ¥5,000     | ¥35,000                 |
| 白金             | ¥84,000      | ¥0          | ¥0         | ¥20,000                 |
| プラチナスポット       | ¥18,000      | -           | -          | -                       |
| パラジウム          | ¥380,000     | ¥5,000      | ¥5,000     | ¥360,000                |
| バージガソリン        | ¥120,000     | ¥5,000      | ¥5,000     | ¥30,000                 |
| バージ灯油          | ¥125,000     | ¥0          | ¥0         | ¥60,000                 |
| ブラツドバイ原油       | ¥115,000     | ¥0          | ¥0         | ¥35,000                 |
| バージ軽油          | ¥100,000     | ¥0          | ¥0         | ¥15,000                 |
| 中京ローリーガソリン     | ¥35,000      | ¥0          | ¥0         | ¥40,000                 |
| 中京ローリー灯油       | ¥35,000      | ¥0          | ¥0         | ¥40,000                 |
| バージガソリンスワップ    | ¥120,000     | ¥0          | ¥0         | ¥120,000                |
| ブラツツバージ灯油スワップ  | ¥125,000     | ¥0          | ¥0         | ¥125,000                |
| ブラツツバージ軽油スワップ  | ¥100,000     | ¥0          | ¥0         | ¥100,000                |
| ローリーガソリンスワップ   | ¥35,000      | ¥0          | ¥0         | ¥35,000                 |
| ブラツツローリー灯油スワップ | ¥35,000      | ¥0          | ¥0         | ¥35,000                 |
| ブラツツローリー軽油スワップ | ¥20,000      | ¥0          | ¥0         | ¥20,000                 |
| 東エリア・ベースロード電力  | ¥80,000      | ¥0          | ¥0         | ¥160,000                |
| 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※       | ¥50,000      | ¥25,000     | ¥25,000    | ¥30,000                 |
| ゴム TSR20       | ¥80,000      | ¥40,000     | ¥40,000    | ¥105,000                |
| とうもろこし         | ¥30,000      | ¥5,000      | ¥5,000     | ¥30,000                 |
| 一般大豆           | ¥80,000      | ¥0          | ¥0         | ¥80,000                 |
| 小豆             | ¥55,000      | ¥10,000     | ¥10,000    | ¥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                | ¥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<br>順位 | 商品間スプレッド               | 商品間デルタ/<br>スプレッド比率 | 商品間<br>スプレッド・<br>クレジット・<br>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        | 84                                 |
| 3        | 金 : 白金                 | 1.00 : 2.00        | 54                                 |
| 4        | ゴールドスポット : プラチナスポット    | 1.00 : 1.00        | 56                                 |
| 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        | 53                                 |
| 7        | パラジウム : 白金             | 1.00 : 1.00        | 51                                 |
| 8        | ブラツッドバイ原油 : バージガソリン    | 1.00 : 1.00        | 90                                 |
| 9        | ブラツッドバイ原油 : 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        | 85                                 |
| 11       | 中京ローリーガソリン : バージ灯油     | 5.00 : 1.00        | 50                                 |
| 12       | 中京ローリーガソリン : バージガソリン   | 5.00 : 1.00        | 61                                 |
| 13       | 中京ローリーガソリン : ブラツッドバイ原油 | 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        | 26                                 |
| 15       | 中京ローリー灯油 : バージ灯油       | 5.00 : 1.00        | 31                                 |
| 16       | 中京ローリー灯油 : ブラツッドバイ原油   | 5.00 : 1.00        | 23                                 |
| 17       | 中京ローリー灯油 : バージガソリン     | 5.00 : 1.00        | 29                                 |
| 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・<br>スキャンレンジ | 納会月割増額      |            | 1ネット・デルタ当たりの<br>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   | ¥10,000          | ¥0          | ¥0         | ¥15,000                     |
| 秋田こまち  | ¥45,000          | ¥5,000      | ¥5,000     | ¥65,000                     |
| 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<br>順位 | 商品間スプレッド    | 商品間デルタ/<br>スプレッド比率 | 商品間<br>スプレッド・<br>クレジット・<br>レート (%) |
|----------|-------------|--------------------|------------------------------------|
| 1        | 新潟コシ : 東京コメ | 8.00 : 1.00        | 34                                 |