

お客様へのお知らせ



VaR証拠金

大阪取引所

銘柄	価格変動リスク (BPL)	スプレッド変動リスク (SFR)	サーキット ブレーカー	係数
金	247,000 円	6,000 円	前日の清算値の5% (最大15%)	1
金ミニ	24,700 円	600 円	前日の清算値の5% (最大15%)	0.1
金(限日)	21,600 円	—	前日の清算値の5% (最大15%)	0.1008
銀(2024年4月限まで)	78,000 円	34,000 円	前日の清算値の10% (最大30%)	0.15984
銀(2024年6月限以降)	234,000 円	102,000 円	前日の清算値の10% (最大30%)	0.48
白金	80,000 円	8,500 円	前日の清算値の10% (最大30%)	0.37
白金ミニ	16,000 円	1,700 円	前日の清算値の10% (最大30%)	0.074
白金(限日)	20,400 円	—	前日の清算値の10% (最大30%)	0.074
パラジウム(2024年4月限まで)	153,500 円	100,000 円	前日の清算値の10% (最大20%)	0
パラジウム(2024年6月限以降)	921,000 円	600,000 円	前日の清算値の10% (最大20%)	0
ゴム(RSS3)	66,000 円	9,000 円	前日の清算値の10%	1
ゴム(TSR20)	42,000 円	5,000 円	前日の清算値の10%	0.433
とうもろこし	81,000 円	34,500 円	前日の清算値の8%	
一般大豆	112,000 円	250 円	前日の清算値の10%	
小豆	40,000 円	800 円	前日の清算値の8%	
CME原油等指数先物	158,500 円	58,000 円	前日の清算値の10% (最大30%)	

東京商品取引所

銘柄	価格変動リスク (BPL)	スプレッド変動リスク (SFR)	サーキット ブレーカー	係数
ガソリン	233,000 円	500 円	前日の清算値の30% (最大60%)	0.054
灯油	236,000 円	500 円	前日の清算値の30% (最大60%)	0.051
原油	338,000 円	12,500 円	前日の清算値の30% (最大60%)	1
軽油	116,500 円	20,000 円	前日の清算値の30% (最大60%)	0
中京ガソリン	31,300 円	100 円	前日の清算値の30% (最大60%)	0.014
中京灯油	46,800 円	100 円	前日の清算値の30% (最大60%)	0.013

堂島取引所

銘柄	価格変動リスク (BPL)	スプレッド変動リスク (SFR)	制限値段幅	係数
とうもろこし50	66,000 円	500 円	1,000 円	
米国産大豆	41,500 円	100 円	2,000 円	
小豆	20,000 円	400 円	350 円	
金	2,307 円	—	理論現物価格の10%	1
銀	7,160 円	—	理論現物価格の30%	1.6
白金	1,802 円	—	理論現物価格の10%	0.324

※上記、VaR証拠金は2023年12月5日(夜間取引)から2023年12月8日(日中取引)まで適用になります。

以上

VaR証拠金 臨時見直し銘柄

大阪取引所

銘柄	変更前		変更後	
	価格変動リスク (BPL)	スプレッド変動リスク (SFR)	価格変動リスク (BPL)	スプレッド変動リスク (SFR)
金	196,000 円	6,000 円	247,000 円	6,000 円
金ミニ	19,600 円	600 円	24,700 円	600 円
金限日	20,700 円	—————	21,600 円	—————

堂島取引所

銘柄	変更前		変更後	
	価格変動リスク (BPL)	スプレッド変動リスク (SFR)	価格変動リスク (BPL)	スプレッド変動リスク (SFR)
金	2,070 円	—————	2,307 円	—————

【2023年12月5日(夜間取引)から2023年12月8日(日中取引)まで適用になります。】

以上