

SPAN<sup>®</sup>パラメーター(および緊急証拠金発動基準)

対象商品	適用期間
無担保コールオーバーナイト3ヵ月金利先物、オプション ユーロ円3ヵ月金利先物、オプション	2023年10月19日～2023年11月15日

1. SPAN<sup>®</sup>パラメーター

パラメーター	無担保コールオーバーナイト3ヵ月金利先物、オプション (O3)&(O3O)	ユーロ円3ヵ月金利先物、オプション (EY)&(EYO)
スキャンレンジ	1-4 限月 : ¥7,500 ( 3.0 ticks ) 5-8 限月 : ¥10,000 ( 4.0 ticks ) 9-20 限月 : ¥12,500 ( 5.0 ticks )	*1 *2 1-2 限月 : ¥7,500 ( 3.0 ticks ) 3-5 限月 : ¥7,500 ( 3.0 ticks ) 6-20 限月 : ¥0 ( 0.0 ticks )
ボラティリティ スキャンレンジ	0.03%	0.00%
商品内スプレッド ティア	ティア 1 : 1-4 限月 ティア 2 : 5-8 限月 ティア 3 : 9-20 限月	ティア 1 : 1-2 限月 ティア 2 : 3-20 限月
ティア間商品内 スプレッド割増金額	1 - 1 : ¥5,000 ( 2.0 ticks ) 1 - 2 : ¥7,500 ( 3.0 ticks ) 1 - 3 : ¥7,500 ( 3.0 ticks ) 2 - 2 : ¥7,500 ( 3.0 ticks ) 2 - 3 : ¥7,500 ( 3.0 ticks ) 3 - 3 : ¥7,500 ( 3.0 ticks )	1 - 1 : ¥2,500 ( 1.0 ticks ) 1 - 2 : ¥5,000 ( 2.0 ticks ) 2 - 2 : ¥5,000 ( 2.0 ticks )
売オプション 最低証拠金金額	¥300	¥0

\*1: EYの1-20限月は四半期限月を表す。シリアル限月には、直後の四半期限月のスキャンレンジが適用される。

\*2: 上記スキャンレンジにかかわらず2025年3月限より期先の限月については、2023年3月20日以降取引を停止しているためスキャンレンジはゼロとする。

2. 緊急証拠金

スキャンレンジ	無担保コールオーバーナイト3ヵ月金利先物	第2限月 : 3.1 ticks以上となった場合に発動
極端な価格変動	無担保コールオーバーナイト3ヵ月金利先物	第2限月 : 50.1 ticks以上となった場合に発動