

SPAN[®]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	2024年2月22日～2024年3月21日

1. SPAN[®]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	1-3 限月 : ¥7,500 (3.0 ticks) 4-8 限月 : ¥13,750 (5.5 ticks) 9-10 限月 : ¥23,750 (9.5 ticks) 11-20 限月 : ¥40,000 (16.0 ticks)	*1 *2 1-4 限月 : ¥7,500 (3.0 ticks) 5-20 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 : 1-3 限月 ティア 2 : 4-8 限月 ティア 3 : 9-10 限月 ティア 4 : 11-20 限月	ティア 1 : 1-20 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 : ¥6,250 (2.5 ticks) 1 - 3 : ¥6,250 (2.5 ticks) 1 - 4 : ¥7,500 (3.0 ticks) 2 - 2 : ¥8,750 (3.5 ticks) 2 - 3 : ¥11,250 (4.5 ticks) 2 - 4 : ¥11,250 (4.5 ticks) 3 - 3 : ¥11,250 (4.5 ticks) 3 - 4 : ¥12,500 (5.0 ticks) 4 - 4 : ¥15,000 (6.0 ticks)	1 - 1 : ¥2,500 (1.0 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