

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
ユーロ円3か月金利先物、オプション、 ユーロ円LIBOR6か月金利先物、 無担保コールオーバーナイト金利先物、 GCレポスポット・ネクスト金利先物	平成24年2月14日～平成24年3月16日

1. SPAN[®] パラメーター

パラメーター	ユーロ円3か月金利先物, オプション (EY)&(EYO)	ユーロ円LIBOR6か月金利先物 (EL)	無担保コールオーバーナイト 金利先物 (ON)	GCレポスポット・ネクスト 金利先物 (SN)
スキャンレンジ*1	1-4 限月 : ¥7,500 (3.0 ticks) 5-8 限月 : ¥10,000 (4.0 ticks) 9-20 限月 : ¥15,000 (6.0 ticks)	1-4 限月 : ¥16,250 (3.25 ticks) 5-8 限月 : ¥22,500 (4.50 ticks) 9-20 限月 : ¥32,500 (6.50 ticks)	全限月 : ¥5,000 (2 ticks)	全限月 : ¥5,000 (2 ticks)
ボラティリティ スキャンレンジ	0.03%	-	-	-
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 : 1-4 限月 ティア 2 : 5-8 限月 ティア 3 : 9-20 限月	ティア 1 : 全限月	ティア 1 : 全限月
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 : ¥8,750 (3.5 ticks) 2 - 3 : ¥8,750 (3.5 ticks) 3 - 3 : ¥12,500 (5.0 ticks)	1 - 1 : ¥11,250 (2.25 ticks) 1 - 2 : ¥16,250 (3.25 ticks) 1 - 3 : ¥16,250 (3.25 ticks) 2 - 2 : ¥20,000 (4.00 ticks) 2 - 3 : ¥20,000 (4.00 ticks) 3 - 3 : ¥27,500 (5.50 ticks)	1 - 1 : ¥2,500 (1 tick)	1 - 1 : ¥2,500 (1 tick)
商品間スプレッド 割引料率 (デルタ/スプレッド 比率)*2	ON - SN 75 % (1 : 1) EY - ON 60 % (2 : 3) EY - SN 60 % (2 : 3) EL - ON 60 % (2 : 7) EL - SN 60 % (2 : 7) EY - EL 45 % (7 : 3)			
売オプション 最低証拠金金額	¥200	-	-	-

*1 : 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 : 端数調整の関係でデルタ/スプレッド比率が各商品間で必ずしも一致しない。

2. 緊急証拠金

スキャンレンジ*3	1-4 限月 : 3 ticks (3.5 ticks以上となった場合に発動) 5-8 限月 : 4 ticks (4.5 ticks以上となった場合に発動) 9-20 限月 : 6 ticks (6.5 ticks以上となった場合に発動)
極端な価格変動*3	50 ticks (50.5 ticks以上となった場合に発動)

*3 : ユーロ円3か月金利先物の中心限月が、上記値を超えて変動した場合、緊急証拠金が発動される。