

# 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
ユーロ円3ヵ月金利先物、オプション、 ユーロ円LIBOR6ヵ月金利先物、 無担保コールオーバーナイト金利先物	平成24年5月15日～平成24年6月18日

## 1. SPAN<sup>®</sup>パラメーター

パラメーター	ユーロ円3ヵ月金利先物, オプション (EY)&(EYO)	ユーロ円LIBOR6ヵ月金利先物 (EL)	無担保コールオーバーナイト 金利先物 (ON)
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 )
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 )
商品間スプレッド 割引料率 (デルタ/スプレッド 比率)*2	EY - ON 60 % ( 2 : 3 ) EL - ON 60 % ( 2 : 7 ) EY - EL 50 % ( 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ヵ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。