

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	平成28年10月18日～平成28年11月14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)
スキャンレンジ*1	1-2 限月 : ¥15,000 (6.0 ticks) 3-6 限月 : ¥20,000 (8.0 ticks) 7-20 限月 : ¥25,000 (10.0 ticks)	1-20 限月 : ¥0	全限月 : ¥10,000 (4 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 : 1-2 限月 ティア 2 : 3-6 限月 ティア 3 : 7-20 限月	ティア 1 : 1-20 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 : ¥10,000 (4.0 ticks) 1 - 2 : ¥10,000 (4.0 ticks) 1 - 3 : ¥12,500 (5.0 ticks) 2 - 2 : ¥15,000 (6.0 ticks) 2 - 3 : ¥15,000 (6.0 ticks) 3 - 3 : ¥20,000 (8.0 ticks)	1 - 1 : ¥0	1 - 1 : ¥5,000 (2 ticks)
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 50 % (2 : 3)		
売オプション 最低証拠金金額	¥500	-	-

*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	1-2 限月 : 6 ticks (6.5 ticks以上となった場合に発動) 3-6 限月 : 8 ticks (8.5 ticks以上となった場合に発動) 7-20 限月 : 10 ticks (10.5 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。