

# 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か月金利先物、オプション	平成29年12月19日～平成30年1月15日

## 1. SPAN<sup>™</sup>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)
スキャンレンジ*1	1-2 限月 : ¥10,000 ( 4.0 ticks ) 3-6 限月 : ¥15,000 ( 6.0 ticks ) 7-20 限月 : ¥20,000 ( 8.0 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
ティア間商品内 スプレッド割増金額	1 - 1 : ¥7,500 ( 3.0 ticks ) 1 - 2 : ¥8,750 ( 3.5 ticks ) 1 - 3 : ¥10,000 ( 4.0 ticks ) 2 - 2 : ¥12,500 ( 5.0 ticks ) 2 - 3 : ¥13,750 ( 5.5 ticks ) 3 - 3 : ¥17,500 ( 7.0 ticks )
売オプション 最低証拠金金額	¥300

\* : 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. 緊急証拠金

スキャンレンジ*	1-2 限月 : 4.0 ticks ( 4.5 ticks以上となった場合に発動) 3-6 限月 : 6.0 ticks ( 6.5 ticks以上となった場合に発動) 7-20 限月 : 8.0 ticks ( 8.5 ticks以上となった場合に発動)
極端な価格変動*	50 ticks ( 50.5 ticks以上となった場合に発動)

\* : 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。