

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ヵ月金利先物、オプション | 2019年6月18日～2019年7月12日 |

1. SPAN[®]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) |
|----------------------|--|
| 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 : 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*2 | 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*2 | 50 ticks (50.5 ticks以上となった場合に発動) |

*2 : 発動の判定基準は、中心限月の価格変動とする。但し、中心限月の交代日及びその翌営業日は、交代前の中心限月の価格変動を判定基準とする。