

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	2020年6月16日～2020年7月13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)
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。