

# 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	2020年12月15日～2021年1月18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 : ¥7,500 ( 3.0 ticks ) 3-6 限月 : ¥12,500 ( 5.0 ticks ) 7-20 限月 : ¥17,500 ( 7.0 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 : ¥5,000 ( 2.0 ticks ) 1 - 2 : ¥6,250 ( 2.5 ticks ) 1 - 3 : ¥7,500 ( 3.0 ticks ) 2 - 2 : ¥10,000 ( 4.0 ticks ) 2 - 3 : ¥11,250 ( 4.5 ticks ) 3 - 3 : ¥15,000 ( 6.0 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 : 3.0 ticks ( 3.5 ticks以上となった場合に発動) 3-6 限月 : 5.0 ticks ( 5.5 ticks以上となった場合に発動) 7-20 限月 : 7.0 ticks ( 7.5 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。