

# 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ヵ月金利先物、オプション | 2022年1月18日～2022年2月14日 |

## 1. SPAN<sup>®</sup>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<br>(EY)&(EYO)                                                                                                                                                                |
|----------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| スキャンレンジ*1            | 1-2 限月 : ¥7,500 ( 3.0 ticks )<br>3-6 限月 : ¥12,500 ( 5.0 ticks )<br>7-20 限月 : ¥17,500 ( 7.0 ticks )                                                                                              |
| ボラティリティ<br>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<br>ティア 2 : 3-6 限月<br>ティア 3 : 7-20 限月                                                                                                                                             |
| ティア間商品内<br>スプレッド割増金額 | 1 - 1 : ¥5,000 ( 2.0 ticks )<br>1 - 2 : ¥6,250 ( 2.5 ticks )<br>1 - 3 : ¥7,500 ( 3.0 ticks )<br>2 - 2 : ¥10,000 ( 4.0 ticks )<br>2 - 3 : ¥11,250 ( 4.5 ticks )<br>3 - 3 : ¥15,000 ( 6.0 ticks ) |
| 売オプション<br>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)<br>3-6 限月 : 5.0 ticks ( 5.5 ticks以上となった場合に発動)<br>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。