

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 |
|---|-----------------------|
| 無担保コールオーバーナイト3か月金利先物、オプション ユーロ円3か月金利先物、オプション | 2023年7月20日～2023年8月16日 |

1. SPAN[®]パラメーター

| パラメーター | 無担保コールオーバーナイト3か月金利先物、オプション (O3)&(O3O) | 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 | 1-2 限月 : ¥10,000 (4.0 ticks) 3-6 限月 : ¥20,000 (8.0 ticks) 7-20 限月 : ¥37,500 (15.0 ticks) | *1 *2 1-2 限月 : ¥7,500 (3.0 ticks) 3-6 限月 : ¥7,500 (3.0 ticks) 7-20 限月 : ¥0 (0.0 ticks) |
| ボラティリティ スキャンレンジ | 0.03% | 0.00% |
| 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 1 : 1-2 限月 ティア 2 : 3-20 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 : ¥7,500 (3.0 ticks) 1 - 3 : ¥7,500 (3.0 ticks) 2 - 2 : ¥7,500 (3.0 ticks) 2 - 3 : ¥11,250 (4.5 ticks) 3 - 3 : ¥15,000 (6.0 ticks) | 1 - 1 : ¥5,000 (2.0 ticks) 1 - 2 : ¥7,500 (3.0 ticks) 2 - 2 : ¥7,500 (3.0 ticks) |
| 売オプション 最低証拠金金額 | ¥300 | ¥0 |

*1: EYの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: 上記スキャンレンジにかかわらず2025年3月限より期先の限月については、2023年3月20日以降取引を停止しているためスキャンレンジはゼロとする。

2. 緊急証拠金

| | | |
|---------|----------------------|------------------------------|
| スキャンレンジ | 無担保コールオーバーナイト3か月金利先物 | 第2限月 : 4.1 ticks以上となった場合に発動 |
| 極端な価格変動 | 無担保コールオーバーナイト3か月金利先物 | 第2限月 : 50.1 ticks以上となった場合に発動 |