

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ヵ月金利先物、オプション ユーロ円3ヵ月金利先物、オプション	2024年7月18日～2024年8月21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ヵ月金利先物、オプション (O3)&(O3O)	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	1-3 限月 : ¥7,500 (3.0 ticks) 4-7 限月 : ¥11,250 (4.5 ticks) 8-11 限月 : ¥15,000 (6.0 ticks) 12-20 限月 : ¥28,750 (11.5 ticks)	1-20 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 : 1-3 限月 ティア 2 : 4-7 限月 ティア 3 : 8-11 限月 ティア 4 : 12-20 限月	ティア 1 : 1-20 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 : ¥5,000 (2.0 ticks) 1 - 3 : ¥5,000 (2.0 ticks) 1 - 4 : ¥6,250 (2.5 ticks) 2 - 2 : ¥6,250 (2.5 ticks) 2 - 3 : ¥7,500 (3.0 ticks) 2 - 4 : ¥7,500 (3.0 ticks) 3 - 3 : ¥7,500 (3.0 ticks) 3 - 4 : ¥8,750 (3.5 ticks) 4 - 4 : ¥10,000 (4.0 ticks)	1 - 1 : ¥0 (0.0 ticks)
売オプション 最低証拠金金額	¥300	¥0

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ヵ月金利先物	第2限月 : 3.1 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ヵ月金利先物	第2限月 : 50.1 ticks以上となった場合に発動