

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                |
|-------------------------------------------------|------------------------|
| 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<br>ユーロ円3ヵ月金利先物、オプション | 2024年9月19日～2024年10月16日 |

1. SPAN<sup>®</sup>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<br>(O3)&(O3O)                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 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              | 1-2 限月 : ¥10,000 ( 4.0 ticks )<br>3-6 限月 : ¥12,500 ( 5.0 ticks )<br>7-11 限月 : ¥16,250 ( 6.5 ticks )<br>12-20 限月 : ¥27,500 ( 11.0 ticks )                                                                                                                                                                                             | 1-20 限月 : ¥0 ( 0.0 ticks )      |
| ボラティリティ<br>スキャンレンジ   | 0.03%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 0.00%                           |
| 商品内スプレッド<br>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 : 7-11 限月<br>ティア 4 : 12-20 限月                                                                                                                                                                                                                                                              | ティア 1 : 1-20 限月                 |
| ティア間商品内<br>スプレッド割増金額 | 1 - 1 : ¥7,500 ( 3.0 ticks )<br>1 - 2 : ¥8,750 ( 3.5 ticks )<br>1 - 3 : ¥10,000 ( 4.0 ticks )<br>1 - 4 : ¥10,000 ( 4.0 ticks )<br>2 - 2 : ¥10,000 ( 4.0 ticks )<br>2 - 3 : ¥10,000 ( 4.0 ticks )<br>2 - 4 : ¥10,000 ( 4.0 ticks )<br>3 - 3 : ¥10,000 ( 4.0 ticks )<br>3 - 4 : ¥10,000 ( 4.0 ticks )<br>4 - 4 : ¥11,250 ( 4.5 ticks ) | 1 - 1 : ¥0 ( 0.0 ticks )        |
| 売オプション<br>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 : 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ヵ月金利先物 | 第2限月 : 50.1 ticks以上となった場合に発動 |