

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10月17日～2024年11月20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	1-2 限月 : ¥12,500 (5.0 ticks) 3-7 限月 : ¥15,000 (6.0 ticks) 8-11 限月 : ¥18,750 (7.5 ticks) 12-20 限月 : ¥27,500 (11.0 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 : 1-2 限月 ティア 2 : 3-7 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 : ¥8,750 (3.5 ticks) 1 - 2 : ¥10,000 (4.0 ticks) 1 - 3 : ¥10,000 (4.0 ticks) 1 - 4 : ¥10,000 (4.0 ticks) 2 - 2 : ¥10,000 (4.0 ticks) 2 - 3 : ¥10,000 (4.0 ticks) 2 - 4 : ¥10,000 (4.0 ticks) 3 - 3 : ¥10,000 (4.0 ticks) 3 - 4 : ¥10,000 (4.0 ticks) 4 - 4 : ¥11,250 (4.5 ticks)	1 - 1 : ¥0 (0.0 ticks)
売オプション 最低証拠金金額	¥400	¥0

※2024年11月11日以降は取引所システムからは削除予定。

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 : 5.1 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