

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	2024年12月19日～2025年1月15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)
スキャンレンジ	1-2 限月 : ¥12,500 (5.0 ticks) 3-6 限月 : ¥16,250 (6.5 ticks) 7-11 限月 : ¥18,750 (7.5 ticks) 12-20 限月 : ¥27,500 (11.0 ticks)
ボラティリティ 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 ティア 2 : 3-6 限月 ティア 3 : 7-11 限月 ティア 4 : 12-20 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)
売オプション 最低証拠金金額	¥400

2. 緊急証拠金

スキャンレンジ	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	第2限月 : 50.1 ticks以上となった場合に発動