

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	2025年12月18日～2026年1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)
スキャンレンジ	1-3 限月 : ¥10,000 (4.0 ticks) 4-6 限月 : ¥13,750 (5.5 ticks) 7-20 限月 : ¥17,500 (7.0 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 : 1-3 限月 ティア 2 : 4-6 限月 ティア 3 : 7-20 限月
ティア間商品内 スプレッド割増金額	2 - 2 : ¥2,500 (1.0 ticks) 1 - 2 : ¥6,250 (2.5 ticks) 1 - 3 : ¥8,750 (3.5 ticks) 1 - 1 : ¥11,250 (4.5 ticks) 2 - 3 : ¥12,500 (5.0 ticks) 3 - 3 : ¥20,000 (8.0 ticks)
売オプション 最低証拠金金額	¥300

2. 緊急証拠金

スキャンレンジ	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	第2限月 : 50.1 ticks以上となった場合に発動