

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	2026年1月22日～2026年2月18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	1-4 限月 : ¥13,750 (5.5 ticks) 5-7 限月 : ¥17,500 (7.0 ticks) 8-20 限月 : ¥22,500 (9.0 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 : 1-4 限月 ティア 2 : 5-7 限月 ティア 3 : 8-20 限月
ティア間商品内 スプレッド割増金額	1 - 1 : ¥12,500 (5.0 ticks) 1 - 2 : ¥12,500 (5.0 ticks) 1 - 3 : ¥13,750 (5.5 ticks) 2 - 2 : ¥16,250 (6.5 ticks) 2 - 3 : ¥16,250 (6.5 ticks) 3 - 3 : ¥22,500 (9.0 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 : 5.6 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