

## 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	2026年2月19日～2026年3月18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 (O3)&(O3O)
スキャンレンジ	1-4 限月 : ¥11,250 ( 4.5 ticks ) 5-7 限月 : ¥17,500 ( 7.0 ticks ) 8-20 限月 : ¥21,250 ( 8.5 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	3 - 3 : ¥2,500 ( 1.0 ticks ) 2 - 3 : ¥3,750 ( 1.5 ticks ) 1 - 2 : ¥10,000 ( 4.0 ticks ) 1 - 1 : ¥11,250 ( 4.5 ticks ) 1 - 3 : ¥11,250 ( 4.5 ticks ) 2 - 2 : ¥16,250 ( 6.5 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 : 4.6 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