

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 無担保コールオーバーナイト1ヵ月金利先物 無担保コールオーバーナイト日本銀行決定会合間金利先物	2026年10月19日～2026年10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)	無担保コールオーバーナイト 1ヵ月金利先物 (O1)	無担保コールオーバーナイト 日本銀行決定会合間金利先物 (G1)
スキャンレンジ	1-4 限月 : ¥11,250 (4.5 ticks) 5-6 限月 : ¥21,250 (8.5 ticks) 7-20 限月 : ¥26,250 (10.5 ticks)	全限月 : ¥15,000 (6.0 ticks)	全限月 : ¥25,000 (10.0 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 : 5-6 限月 ティア 3 : 7-20 限月	ティア 1 : 全限月	ティア 1 : 全限月
ティア間商品内 スプレッド割増金額	1 - 2 : ¥6,250 (2.5 ticks) 1 - 3 : ¥10,000 (4.0 ticks) 1 - 1 : ¥11,250 (4.5 ticks) 2 - 3 : ¥13,750 (5.5 ticks) 2 - 2 : ¥15,000 (6.0 ticks) 3 - 3 : ¥18,750 (7.5 ticks)	1 - 1 : ¥17,500 (7.0 ticks)	1 - 1 : ¥25,000 (10.0 ticks)
商品間スプレッド割引料率 (デルタ／スプレッド比率)	G1 - O3 45 % (1 : 1) O1 - O3 40 % (1 : 1) O1 - G1 0 % (1 : 1)		
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	無担保コールオーバーナイト3ヵ月金利先物 第2限月 : 4.6 ticks以上
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