

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
ユーロ円3か月金利先物、オプション、 無担保コールオーバーナイト金利先物、 GCレボスポット・ネクスト金利先物	平成19年12月3日～平成19年12月17日

1. SPAN[®] パラメーター

パラメーター	ユーロ円3か月金利先物, オプション (EY)&(EYO)	無担保コールオーバーナイト 金利先物 (ON)	GCレボスポット・ネクスト 金利先物 (SN)
スキャンレンジ	1 - 3 限月* : ¥8,750 (3.5 ticks) 4 - 6 限月 : ¥13,750 (5.5 ticks) 7 - 12 限月 : ¥15,000 (6 ticks) 13 - 20 限月 : ¥17,500 (7 ticks)	全限月 : ¥5,000 (2 ticks)	全限月 : ¥5,000 (2 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 - 12 限月 ティア 4 : 13 - 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 - 1 : ¥5,000 (2 ticks) 2 - 2 : ¥5,000 (2 ticks) 1 - 2 : ¥5,000 (2 ticks) 2 - 3 : ¥6,250 (2.5 ticks) 1 - 3 : ¥6,250 (2.5 ticks) 3 - 3 : ¥7,500 (3 ticks) 1 - 4 : ¥8,750 (3.5 ticks) 3 - 4 : ¥10,000 (4 ticks) 2 - 4 : ¥10,000 (4 ticks) 4 - 4 : ¥11,250 (4.5 ticks)	1 - 1 : ¥2,500 (1 ticks)	1 - 1 : ¥2,500 (1 ticks)
商品間スプレッド 割引料率 (デルタ/スプレッド 比率)*2	ON - SN 60 % EY - SN 50 % EY - ON 50 %	(1 : 1) (2 : 1) (2 : 1)	
売オプション 最低証拠金金額	¥300	-	-

*1 : 2つのシリアル限月を含む。

*2 : 端数調整の関係でデルタ/スプレッド比率が各商品間で必ずしも一致しない。

2. 緊急証拠金

中心限月スキャンレンジ + α *	1 - 3 限月 : $\alpha = 1.5$ ticks 4 - 12 限月 : $\alpha = 2$ ticks 13 - 20 限月 : $\alpha = 2.5$ ticks
極端な価格変動 *	50 ticks

(* ユーロ円3か月金利先物の中心限月が、上記値を超えて変動した場合、緊急証拠金が発動される。)