

## 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
ユーロ円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18日～平成20年3月17日

### 1. SPAN<sup>®</sup>パラメーター

パラメーター	ユーロ円3ヵ月金利先物、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*1 : ¥10,000 ( 4 ticks ) 4 - 6 限月 : ¥15,000 ( 6 ticks ) 7 - 12 限月 : ¥16,250 ( 6.5 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 ) 1 - 3 : ¥5,000 ( 2 ticks ) 2 - 3 : ¥6,250 ( 2.5 ticks ) 1 - 4 : ¥6,250 ( 2.5 ticks ) 3 - 3 : ¥7,500 ( 3 ticks ) 2 - 4 : ¥7,500 ( 3 ticks ) 4 - 4 : ¥8,750 ( 3.5 ticks ) 3 - 4 : ¥8,750 ( 3.5 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 % ( 1 : 1 ) EY - SN 55 % ( 2 : 1 ) EY - ON 50 % ( 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 + $\alpha$ *	1 - 3 限月 : $\alpha = 1.5$ ticks 4 - 6 限月 : $\alpha = 2$ ticks 7 - 20 限月 : $\alpha = 2.5$ ticks
極端な価格変動 *	50 ticks

(\* ユーロ円3ヵ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。)