

【参考】臨時見直し対象商品GのSPAN(R)パラメーター

(適用期間:2015年1月26日~2015年1月30日)

※網掛け+赤字部分が、臨時見直しによる当初予定値からの変更点です。

※本資料は「SPAN(R)パラメーター」ファイルから抜粋した参考情報となりますので、各適用期間のSPAN/パラメーターは「SPAN(R)パラメーター」ファイルをご確認ください。

1. 国債先物グループ【コード:0001】

適用日	プライス・ スキャンレンジ(円)	ボラティリティ・ スキャンレンジ(%)	1ネットデルタ当たりの 商品内スプレッド割増額(円)	売オプション1単位当たりの 最低証拠金額(円)
2015/1/26	660,000	0.68	110,000	14,900
2015/1/27	720,000	↓	↓	↓
2015/1/28	↓	↓	↓	↓
2015/1/29	↓	↓	↓	↓
2015/1/30	↓	↓	↓	↓

2. 日経平均株価グループ【コード:0018】

適用日	プライス・ スキャンレンジ(円)	ボラティリティ・ スキャンレンジ(%)	1ネットデルタ当たりの 商品内スプレッド割増額(円)	売オプション1単位当たりの 最低証拠金額(円)
2015/1/26	720,000	7.58	30,000	33,800
2015/1/27	↓	↓	↓	↓
2015/1/28	↓	↓	↓	↓
2015/1/29	↓	↓	↓	↓
2015/1/30	↓	↓	↓	↓

3. TOPIXグループ【コード:0005】

適用日	プライス・ スキャンレンジ(円)	ボラティリティ・ スキャンレンジ(%)	1ネットデルタ当たりの 商品内スプレッド割増額(円)	売オプション1単位当たりの 最低証拠金額(円)
2015/1/26	540,000	4.67	150,000	27,300
2015/1/27	↓	↓	↓	↓
2015/1/28	↓	↓	↓	↓
2015/1/29	↓	↓	↓	↓
2015/1/30	↓	↓	↓	↓

4. 日経平均VIグループ【コード:0015】

適用日	プライス・ スキャンレンジ(円)	ボラティリティ・ スキャンレンジ(%)	1ネットデルタ当たりの 商品内スプレッド割増額(円)	売オプション1単位当たりの 最低証拠金額(円)
2015/1/26	64,500		25,800	
2015/1/27	↓		↓	
2015/1/28	↓		↓	
2015/1/29	↓		↓	
2015/1/30	↓		↓	

5. 日経平均・配当指数グループ【コード:0017】

適用日	プライス・ スキャンレンジ(円)	ボラティリティ・ スキャンレンジ(%)	1ネットデルタ当たりの 商品内スプレッド割増額(円)	売オプション1単位当たりの 最低証拠金額(円)
2015/1/26	6,000		12,000	
2015/1/27	↓		↓	
2015/1/28	↓		↓	
2015/1/29	↓		↓	
2015/1/30	↓		↓	

6. TOPIX配当指数グループ【コード:0008】

適用日	プライス・ スキャンレンジ(円)	ボラティリティ・ スキャンレンジ(%)	1ネットデルタ当たりの 商品内スプレッド割増額(円)	売オプション1単位当たりの 最低証拠金額(円)
2015/1/26	11,700		23,400	
2015/1/27	↓		↓	
2015/1/28	↓		↓	
2015/1/29	↓		↓	
2015/1/30	↓		↓	

7. TOPIX Core30配当指数グループ【コード:0064】

適用日	プライス・ スキャンレンジ(円)	ボラティリティ・ スキャンレンジ(%)	1ネットデルタ当たりの 商品内スプレッド割増額(円)	売オプション1単位当たりの 最低証拠金額(円)
2015/1/26	7,600		15,200	
2015/1/27	↓		↓	
2015/1/28	↓		↓	
2015/1/29	↓		↓	
2015/1/30	↓		↓	