

参考資料2-1 サンプルファイルのSPANパラメーター一覧(12月5日版)

本サンプルファイルには下記のSPANパラメーターを収録しております。※本番とは異なりますのでご注意ください。  
なお、本サンプルファイルに設定されたパラメーター内容は、Weeklyオプション導入後のパラメーター設定内容を保証するものではありません

1. 国債グループ

コード	商品グループ名	ブライ ス・ス キャン レンジ (円)	ボラティ 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)
0001	長期国債	450,000	0.82	80,000	14,700
0002	超長期国債	1,750,000		200,000	
0004	中期国債	130,000		70,000	

2. 指数グループ

コード	商品グループ名	ブライ ス・ス キャン レンジ (円)	ボラティ 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)
0005	TOPIX	510,000	3.95	165,000	28,300
0008	TOPIX配当指数	10,700		21,400	
0015	日経平均VI	59,500		23,800	
0017	日経平均・配当指数	5,500		11,000	
0018	日経225	690,000	7.76	20,000	35,000
0022	JPX日経400	45,500		15,500	
0032	東証銀行業株価指数	68,000		23,000	
0063	TOPIX Core30	26,000		8,500	
0064	TOPIX Core30配当指数	7,000		14,000	
0069	東証REIT指数	44,000		21,000	
0073	NYダウ	38,700		3,870	
0074	CNX Nifty	18,100		1,810	
0076	RNプライム指数	380,000		38,000	

3. 有価証券グループ

コード	商品グループ名	ブライ ス・ス キャン レンジ (円)	ボラティ 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)
1306	TOPIX運動型上場投資信託	580	4.38	58	29
1309	上海株式指数・上証50運動型上場投資信託	1,150	3.18	115	54
1320	ダイワ上場投信ー日経225	690	4.58	69	36
1321	日経225運動型上場投資信託	690	4.61	69	36
1328	金価格運動型上場投資信託	900	3.84	90	77
1330	上場インデックスファンド225	6,800	4.38	680	358
1343	NEXT FUNDS 東証REIT指数運動型上場投信	410	1.64	41	39
1540	純金上場信託(現物国内保管型)	90	2.93	9	9
1605	国際石油開発帝石(株)	8,800	7.44	880	252
1615	東証銀行業株価指数運動型上場投資信託	700	3.03	70	40
1671	WTI原油価格運動型上場投信	210	4.04	21	12
1801	大成建設(株)	33,000	9.24	3,300	1,240
1802	(株)大林組	36,000	6.20	3,600	1,480
1803	清水建設(株)	54,000	8.08	5,400	1,620
1808	(株)長谷エコーポレーション	7,900	7.66	790	198
1812	鹿島建設(株)	24,000	6.70	2,400	940
1925	大和ハウス工業(株)	11,800	11.06	1,180	460
1928	積水ハウス(株)	9,900	4.42	990	319
1944	(株)きんでん	55,000	15.24	5,500	2,270
1963	日 揮(株)	130,000	27.95	13,000	5,200
2002	(株)日清製粉グループ本社	3,800	3.31	380	235
2432	(株)ディー・エヌ・エー	19,700	43.82	1,970	300
2502	アサヒグループホールディングス(株)	16,000	7.86	1,600	750
2503	キリンホールディングス(株)	5,300	6.29	530	305
2531	宝ホールディングス(株)	5,000	8.02	500	157
2651	(株)ローソン	24,000	4.12	2,400	1,470
2768	双日(株)	600	4.30	60	34
2802	味の素(株)	99,000	4.75	9,900	4,440
2914	日本たばこ産業(株)	17,000	6.98	1,700	770
3249	産業ファンド投資法人	57,000	7.27	5,700	2,110
3269	アドバンス・レジデンス投資法人	8,100	3.83	810	580
3279	アクティビア・プロパティーズ投資法人	35,000	4.00	3,500	1,970
3382	(株)セブン&アイ・ホールディングス	16,000	4.75	1,600	890
3402	東レ(株)	60,000	6.33	6,000	1,870
3405	(株)クラレ	5,700	4.66	570	289
3407	旭化成(株)	39,000	5.25	3,900	2,070
3436	(株)SUMCO	17,200	23.52	1,720	310
3632	グリー(株)	6,400	10.57	640	160
3861	王子ホールディングス(株)	20,000	5.46	2,000	840
3863	日本製紙(株)	7,400	4.13	740	347
4005	住友化学(株)	24,000	5.17	2,400	900
4062	イビデン(株)	10,000	34.56	1,000	360
4063	信越化学工業(株)	36,000	5.13	3,600	1,600
4183	三井化学(株)	16,000	5.37	1,600	670
4188	(株)三菱ケミカルホールディングス	2,300	5.60	230	123
4307	(株)野村総合研究所	16,500	4.91	1,650	740
4324	(株)電 通	19,000	4.67	1,900	900
4452	花王(株)	16,500	4.84	1,650	880
4502	武田薬品工業(株)	15,500	4.06	1,550	1,000
4503	アステラス製薬(株)	9,300	3.96	930	342
4519	中外製薬(株)	32,000	21.92	3,200	650
4523	エーザイ(株)	13,000	3.39	1,300	860
4543	テルモ(株)	14,300	7.43	1,430	540
4568	第一三共(株)	7,300	6.95	730	350
4631	大日本インキ化学工業(株)	13,000	5.44	1,300	540
4661	(株)オリエンタルランド	130,000	6.28	13,000	5,200
4676	(株)フジ・メディア・ホールディングス	6,600	5.69	660	307
4689	ヤフー(株)	2,900	17.52	290	87
4704	トレンドマイクロ(株)	16,500	5.39	1,650	730
4716	日本オラクル(株)	20,500	8.72	2,050	900

コード	商品グループ名	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)
4739	伊藤忠テクノソリューションズ(株)	38,000	12.59	3,800	930
4901	富士フイルムホールディングス(株)	21,500	7.22	2,150	790
4902	コニカミノルタホールディングス(株)	8,600	20.40	860	277
4911	(株)資生堂	9,500	7.27	950	355
5012	東燃ゼネラル石油(株)	41,000	15.50	4,100	1,990
5020	JXホールディングス(株)	1,600	4.67	160	89
5108	(株)ブリヂストン	18,000	6.10	1,800	820
5201	旭硝子(株)	21,000	6.03	2,100	1,150
5202	日本板硝子(株)	9,000	38.04	900	236
5214	日本電気硝子	29,000	17.22	2,900	1,090
5333	日本硝子(株)	161,000	19.31	16,100	5,300
5401	新日鐵住金(株)	14,000	4.23	1,400	620
5406	(株)神戸製鋼所	8,000	6.14	800	378
5411	ジェイ・エフ・イー・ホールディングス(株)	9,900	5.05	990	506
5631	(株)日本製鋼所	33,000	13.93	3,300	850
5706	三井金属鉱業(株)	16,000	9.26	1,600	610
5711	三菱マテリアル(株)	26,000	11.14	2,600	750
5713	住友金属鉱山(株)	90,000	10.58	9,000	3,640
5801	古河電気工業(株)	12,000	13.43	1,200	410
5802	住友電気工業(株)	8,400	7.80	840	309
5803	(株)フジクラ	30,000	11.93	3,000	890
5901	東洋製罐グループホールディングス(株)	8,400	6.35	840	287
5938	(株)LIXILグループ	11,700	6.09	1,170	510
6273	SMC(株)	165,000	5.71	16,500	6,600
6301	(株)小松製作所	10,100	3.73	1,010	570
6302	住友重機械工業(株)	41,000	6.63	4,100	1,310
6305	日立建機(株)	14,700	5.02	1,470	520
6326	(株)クボタ	110,000	16.56	11,000	3,800
6367	ダイキン工業(株)	41,000	6.07	4,100	1,580
6471	日本精工(株)	100,000	10.47	10,000	3,000
6479	ミネベア(株)	116,000	8.89	11,600	3,000
6501	(株)日立製作所	38,000	3.63	3,800	1,840
6502	(株)東芝	23,000	5.22	2,300	1,060
6503	三菱電機(株)	62,000	5.96	6,200	2,860
6592	マフチモーター(株)	39,000	4.68	3,900	1,900
6594	日本電産(株)	37,000	5.51	3,700	1,580
6674	(株)ジーエス・ユアサ・コーポレーション	25,000	10.23	2,500	1,140
6701	日本電気(株)	20,000	7.59	2,000	750
6702	富士通(株)	33,000	6.39	3,300	1,360
6703	沖電気工業(株)	17,000	10.72	1,700	480
6723	ルネサスエレクトロニクス(株)	8,100	28.07	810	164
6752	パナソニック(株)	9,200	5.81	920	307
6753	シャープ(株)	15,000	8.50	1,500	570
6758	ソニー(株)	28,800	14.56	2,880	520
6762	TDK(株)	64,000	9.93	6,400	1,430
6770	アルプス電気(株)	17,500	7.63	1,750	480
6773	パイオニア(株)	2,000	8.89	200	51
6806	ヒロセ電機(株)	55,000	4.25	5,500	3,000
6857	(株)アドバンテスト	8,800	11.41	880	284
6861	(株)キーエンス	400,000	7.00	40,000	11,000
6902	(株)デンソー	32,000	5.57	3,200	1,110
6952	カシオ計算機(株)	13,400	9.53	1,340	360
6954	ファナック(株)	114,000	8.38	11,400	4,100
6963	ローム(株)	51,000	13.42	5,100	1,540
6971	京セラ(株)	25,000	5.57	2,500	1,170
6976	太陽誘電(株)	10,600	20.48	1,060	270
6981	(株)村田製作所	71,000	10.67	7,100	2,570
6988	日東電工(株)	34,000	9.49	3,400	1,260
7011	三菱重工業(株)	36,000	7.21	3,600	1,390
7012	川崎重工業(株)	23,000	12.63	2,300	1,050
7013	(株)IHI	36,000	9.12	3,600	1,200
7201	日産自動車(株)	5,600	6.81	560	222
7202	いすゞ自動車(株)	7,300	11.98	730	310
7203	トヨタ自動車(株)	35,000	4.94	3,500	1,470
7259	アイシン精機(株)	23,000	5.41	2,300	850
7261	マツダ(株)	17,500	4.98	1,750	620
7267	本田技研工業(株)	16,000	5.74	1,600	720
7269	スズキ(株)	22,000	7.67	2,200	750
7731	(株)ニコン	8,900	23.07	890	339
7733	オリンパス(株)	26,500	11.46	2,650	870
7741	HOYA(株)	25,000	7.79	2,500	850
7751	キヤノン(株)	10,500	4.75	1,050	770
7752	(株)リコー	4,900	5.12	490	258
7911	凸版印刷(株)	32,000	5.46	3,200	1,530
7912	大日本印刷(株)	41,000	4.47	4,100	2,090
7974	任天堂(株)	83,000	8.39	8,300	2,760
8001	伊藤忠商事(株)	4,600	4.13	460	274
8002	丸紅(株)	2,800	5.45	280	150
8028	(株)ファミリーマート	16,000	7.11	1,600	880
8031	三井物産(株)	5,400	4.35	540	328
8035	東京エレクトロン(株)	44,000	9.71	4,400	1,620
8053	住友商事(株)	5,100	22.49	510	254
8058	三菱商事(株)	8,400	9.98	840	449
8113	ユニ・チャーム(株)	14,100	7.47	1,410	550
8252	(株)丸井グループ	5,600	4.97	560	208
8253	(株)クレディセゾン	22,100	23.84	2,210	450
8263	(株)ダイエー	1,500	29.08	150	28
8267	イオン(株)	5,400	9.65	540	237
8306	(株)三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,600	4.04	260	138
8308	(株)リソナホールディングス	3,600	6.97	360	129

コード	商品グループ名	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)
8309	三井住友トラスト・ホールディングス(株)	37,000	8.14	3,700	990
8316	(株)三井住友フィナンシャルグループ	20,500	5.36	2,050	900
8411	(株)みずほフィナンシャルグループ	700	4.32	70	41
8473	SBIホールディングス(株)	12,800	9.98	1,280	280
8591	オリックス(株)	16,000	9.22	1,600	320
8601	(株)大和証券グループ本社	118,000	17.22	11,800	2,000
8604	野村ホールディングス(株)	5,600	7.61	560	143
8630	損保ジャパン日本興亜ホールディングス (株)	16,500	7.29	1,650	590
8725	MS&ADインシュアランスグループホール ディングス(株)	13,500	6.54	1,350	560
8750	第一生命保険(株)	8,600	5.50	860	345
8766	東京海上ホールディングス(株)	19,500	6.15	1,950	780
8795	(株)T&Dホールディングス	8,400	8.82	840	288
8801	三井不動産(株)	170,000	7.34	17,000	6,900
8802	三菱地所(株)	126,000	5.43	12,600	5,400
8830	住友不動産(株)	245,000	5.55	24,500	8,200
8951	日本ビルファンド投資法人	25,000	4.82	2,500	1,200
8952	ジャパニリアルエステイト投資法人	18,000	8.02	1,800	1,170
8953	日本リテールファンド投資法人	9,400	3.26	940	494
8954	オリックス不動産投資法人	8,900	5.48	890	330
8955	日本プライムリアルティ投資法人	19,500	5.10	1,950	870
8957	東急リアル・エステート	6,200	4.52	620	320
8959	野村不動産オフィスファンド投資法人	16,000	2.95	1,600	1,000
8961	森トラスト総合リート	7,900	3.71	790	450
8967	日本ロジスティクスファンド投資法人	7,900	3.28	790	534
8972	ケネディクス不動産	43,000	8.40	4,300	1,310
8976	大和証券オフィス投資法人	26,000	4.27	2,600	1,200
8984	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	22,000	5.21	2,200	1,090
9005	東京急行電鉄(株)	28,000	5.14	2,800	1,440
9020	東日本旅客鉄道(株)	43,000	4.95	4,300	1,780
9021	西日本旅客鉄道(株)	23,000	3.49	2,300	1,140
9022	東海旅客鉄道(株)	82,000	5.60	8,200	3,460
9062	日本通運(株)	30,000	6.34	3,000	1,140
9064	ヤマトホールディングス(株)	18,500	10.57	1,850	540
9101	日本郵船(株)	16,000	5.45	1,600	670
9104	(株)商船三井	21,000	7.34	2,100	760
9107	川崎汽船(株)	22,000	7.23	2,200	630
9201	日本航空(株)	19,500	7.25	1,950	700
9202	ANAホールディングス(株)	22,000	10.67	2,200	590
9301	三菱倉庫(株)	86,000	7.18	8,600	3,720
9404	日本テレビホールディングス(株)	7,200	5.05	720	352
9432	日本電信電話(株)	38,000	6.29	3,800	1,280
9433	KDDI(株)	40,000	6.75	4,000	1,530
9437	(株)NTTドコモ	9,000	4.45	900	371
9501	東京電力(株)	3,700	24.55	370	87
9502	中部電力(株)	6,900	5.17	690	278
9503	関西電力(株)	6,600	7.46	660	239
9504	中国電力(株)	5,300	3.67	530	307
9506	東北電力(株)	6,000	5.40	600	275
9508	九州電力(株)	8,900	12.14	890	244
9531	東京瓦斯(株)	22,000	3.98	2,200	1,300
9532	大阪瓦斯(株)	15,000	3.56	1,500	910
9613	(株)エヌ・ティ・ティ・データ	20,000	5.82	2,000	910
9735	セコム(株)	36,000	6.80	3,600	1,380
9766	コナミ(株)	10,100	5.20	1,010	450
9831	(株)ヤマダ電機	2,600	9.62	260	79
9983	(株)ファーストリテイリング	180,000	8.00	18,000	8,700
9984	ソフトバンク(株)	49,000	9.95	4,900	1,600

#### 4. 商品間スプレッド割引

商品間スプレッド	商品間スプレッドク レジットレート(%)	商品間デルタ/スプレッド比率
長期国債 : 中期国債	34.89%	1.00 : 1.30
超長期国債 : 長期国債	14.91%	1.00 : 1.38
超長期国債 : 中期国債	23.28%	1.00 : 1.80
日経225 : TOPIX	89.68%	1.00 : 1.22
日経225 : JPX日経400	88.55%	1.00 : 13.40
日経225 : TOPIX Core30	78.56%	1.00 : 23.70
日経225 : RNプライム指数	81.03%	1.00 : 1.62
TOPIX : JPX日経400	97.80%	1.00 : 10.99
TOPIX : TOPIX Core30	79.92%	1.00 : 19.44
TOPIX : RNプライム指数	82.85%	1.00 : 1.33
JPX日経400 : TOPIX Core30	92.17%	1.00 : 1.77
RNプライム指数 : JPX日経400	97.63%	1.00 : 8.27
RNプライム指数 : TOPIX Core30	92.74%	1.00 : 14.63
日経225 : 東証銀行業株価指数	80.35%	1.00 : 8.83
TOPIX : 東証銀行業株価指数	84.20%	1.00 : 7.24
東証銀行業株価指数 : JPX日経400	80.41%	1.00 : 1.52
東証銀行業株価指数 : TOPIX Core30	85.87%	1.00 : 2.69
RNプライム指数 : 東証銀行業株価指数	82.06%	1.00 : 5.45
日経225 : NYダウ	68.48%	1.00 : 9.17
TOPIX : NYダウ	65.76%	1.00 : 7.52
NYダウ : JPX日経400	60.63%	1.00 : 1.46
NYダウ : TOPIX Core30	48.13%	1.00 : 2.59
RNプライム指数 : NYダウ	51.90%	1.00 : 5.66
日経225 : CNX Nifty	52.37%	1.00 : 19.96
TOPIX : CNX Nifty	43.57%	1.00 : 16.37
JPX日経400 : CNX Nifty	46.37%	1.00 : 1.49
CNX Nifty : TOPIX Core30	46.63%	1.00 : 1.19
RNプライム指数 : CNX Nifty	43.87%	1.00 : 12.32
NYダウ : CNX Nifty	43.48%	1.00 : 2.18

※プライス・スキャンレンジは、単一商品の単一限月取引において1単位買い(売り)建てた場合の証拠金額に相当する。

※ミニTOPIX先物、ミニ長期国債先物、日経225miniに係るプライス・スキャンレンジ及び1ネット・デルタ当たりの商品内スプレッド割増額は、各商品グループにおけるラージ取引の10分の1とする。