

参考資料2 サンプルファイルのSPANパラメーター一覧(12月12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	420,000	0.82	80,000	14,800
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	555,000	4.67	150,000	29,000
0008	TOPIX配当指数	10,700		21,400	
0015	日経平均VI	64,000		25,600	
0017	日経平均・配当指数	5,500		11,000	
0018	日経225	750,000	7.58	20,000	35,900
0022	JPX日経400	50,500		14,000	
0032	東証銀行業株価指数	69,000		21,000	
0063	TOPIX Core30	28,500		8,000	
0064	TOPIX Core30配当指数	7,100		14,200	
0069	東証REIT指数	44,500		19,000	
0073	NYダウ	35,200		3,520	
0074	CNX Nifty	16,700		1,670	
0076	RNプライム指数	420,000		42,000	

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	590	4.61	59	30
1309	上海株式指数・上証50運動型上場投資信託	1,650	3.18	165	65
1320	ダイワ上場投信ー日経225	710	5.36	71	37
1321	日経225運動型上場投資信託	710	4.82	71	37
1328	金価格運動型上場投資信託	1,100	3.84	110	79
1330	上場インデックスファンド225	6,900	4.78	690	368
1343	NEXT FUNDS 東証REIT指数運動型上場投信	420	2.62	42	40
1540	純金上場信託(現物国内保管型)	195	5.51	20	10
1605	国際石油開発帝石(株)	8,900	7.44	890	257
1615	東証銀行業株価指数運動型上場投資信託	700	6.80	70	41
1671	WTI原油価格運動型上場投信	250	4.17	25	12
1801	大成建設(株)	33,000	9.24	3,300	1,250
1802	(株)大林組	35,000	6.20	3,500	1,430
1803	清水建設(株)	53,000	8.08	5,300	1,590
1808	(株)長谷エコーポレーション	8,000	7.66	800	199
1812	鹿島建設(株)	24,000	6.70	2,400	930
1925	大和ハウス工業(株)	12,200	11.06	1,220	470
1928	積水ハウス(株)	10,100	4.42	1,010	330
1944	(株)きんでん	56,000	15.24	5,600	2,320
1963	日 揮(株)	131,000	27.95	13,100	5,200
2002	(株)日清製粉グループ本社	3,800	3.79	380	236
2432	(株)ディー・エヌ・エー	19,200	43.82	1,920	290
2502	アサヒグループホールディングス(株)	16,500	7.86	1,650	770
2503	キリンホールディングス(株)	5,400	6.29	540	310
2531	宝ホールディングス(株)	5,000	8.09	500	159
2651	(株)ローソン	23,000	4.12	2,300	1,480
2768	双日(株)	600	4.30	60	34
2802	味の素(株)	103,000	4.75	10,300	4,700
2914	日本たばこ産業(株)	16,000	6.98	1,600	730
3249	産業ファンド投資法人	59,000	7.27	5,900	2,220
3269	アドバンス・レジデンス投資法人	10,500	3.83	1,050	610
3279	アクティビア・プロパティーズ投資法人	36,000	4.00	3,600	2,040
3382	(株)セブン&アイ・ホールディングス	16,000	4.75	1,600	880
3402	東レ(株)	64,000	6.33	6,400	1,970
3405	(株)クラレ	5,900	4.66	590	301
3407	旭化成(株)	39,000	5.25	3,900	2,190
3436	(株)SUMCO	23,800	23.52	2,380	370
3632	グリー(株)	6,200	10.57	620	154
3861	王子ホールディングス(株)	18,000	5.46	1,800	860
3863	日本製紙(株)	7,200	4.13	720	354
4005	住友化学(株)	26,000	4.92	2,600	1,000
4062	イビデン(株)	10,500	34.56	1,050	380
4063	信越化学工業(株)	38,000	5.34	3,800	1,700
4183	三井化学(株)	18,000	5.37	1,800	720
4188	(株)三菱ケミカルホールディングス	2,500	5.14	250	131
4307	(株)野村総合研究所	16,500	4.91	1,650	750
4324	(株)電 通	20,000	4.67	2,000	940
4452	花王(株)	16,500	4.73	1,650	910
4502	武田薬品工業(株)	16,000	4.06	1,600	1,010
4503	アステラス製薬(株)	8,800	8.19	880	344
4519	中外製薬(株)	32,000	21.92	3,200	650
4523	エーザイ(株)	31,000	7.76	3,100	1,000
4543	テルモ(株)	15,200	9.21	1,520	580
4568	第一三共(株)	7,500	6.95	750	357
4631	大日本インキ化学工業(株)	14,000	5.44	1,400	590
4661	(株)オリエンタルランド	132,000	6.28	13,200	5,300
4676	(株)フジ・メディア・ホールディングス	6,500	5.69	650	301
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	910

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)	19,000	6.01	1,900	910
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)	9,000	20.40	900	293
4911	(株)資生堂	9,700	7.27	970	364
5012	東燃ゼネラル石油(株)	43,000	15.50	4,300	2,100
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	19,000	6.10	1,900	870
5201	旭硝子(株)	22,000	6.03	2,200	1,210
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	1,110
5333	日本碍子(株)	161,000	19.31	16,100	5,300
5401	新日鐵住金(株)	14,000	5.91	1,400	640
5406	(株)神戸製鋼所	9,000	4.66	900	414
5411	ジェイ・エフ・イー・ホールディングス(株)	10,900	5.05	1,090	560
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)	27,000	11.14	2,700	780
5713	住友金属鉱山(株)	91,000	10.58	9,100	3,690
5801	古河電気工業(株)	12,000	13.43	1,200	400
5802	住友電気工業(株)	8,600	7.80	860	317
5803	(株)フジクラ	32,000	11.93	3,200	940
5901	東洋製罐グループホールディングス(株)	8,600	6.35	860	294
5938	(株)LIXILグループ	12,200	6.53	1,220	530
6273	SMC(株)	170,000	7.16	17,000	6,800
6301	(株)小松製作所	10,600	3.37	1,060	590
6302	住友重機械工業(株)	36,000	7.36	3,600	1,410
6305	日立建機(株)	13,300	5.61	1,330	560
6326	(株)クボタ	112,000	16.56	11,200	3,800
6367	ダイキン工業(株)	42,000	6.07	4,200	1,630
6471	日本精工(株)	103,000	10.47	10,300	3,100
6479	ミネベア(株)	122,000	8.89	12,200	3,200
6501	(株)日立製作所	39,000	4.35	3,900	1,870
6502	(株)東芝	24,000	5.22	2,400	1,080
6503	三菱電機(株)	65,000	5.96	6,500	3,000
6592	マブチモーター(株)	43,000	4.68	4,300	2,080
6594	日本電産(株)	39,000	5.51	3,900	1,650
6674	(株)ジーエス・ユアサ・コーポレーション	23,000	10.23	2,300	1,060
6701	日本電気(株)	21,000	7.59	2,100	780
6702	富士通(株)	34,000	6.39	3,400	1,390
6703	沖電気工業(株)	17,000	10.72	1,700	490
6723	ルネサスエレクトロニクス(株)	8,700	28.07	870	177
6752	パナソニック(株)	7,200	7.82	720	320
6753	シャープ(株)	14,000	6.80	1,400	580
6758	ソニー(株)	23,200	14.56	2,320	540
6762	TDK(株)	59,000	10.71	5,900	1,580
6770	アルプス電気(株)	18,600	7.63	1,860	510
6773	パイオニア(株)	2,000	8.89	200	52
6806	ヒロセ電機(株)	51,000	3.75	5,100	2,950
6857	(株)アドバンテスト	9,200	11.41	920	297
6861	(株)キーエンス	330,000	9.07	33,000	11,200
6902	(株)デンソー	30,000	6.64	3,000	1,190
6952	カシオ計算機(株)	14,800	9.53	1,480	400
6954	ファナック(株)	120,000	10.09	12,000	4,300
6963	ローム(株)	53,000	13.42	5,300	1,600
6971	京セラ(株)	26,000	10.49	2,600	1,190
6976	太陽誘電(株)	11,400	20.48	1,140	290
6981	(株)村田製作所	75,000	10.67	7,500	2,700
6988	日東電工(株)	36,000	9.49	3,600	1,340
7011	三菱重工業(株)	37,000	7.21	3,700	1,420
7012	川崎重工業(株)	25,000	12.63	2,500	1,120
7013	(株)IHI	37,000	9.12	3,700	1,230
7201	日産自動車(株)	5,800	6.81	580	227
7202	いすゞ自動車(株)	7,400	11.98	740	319
7203	トヨタ自動車(株)	37,000	4.94	3,700	1,550
7259	アイシン精機(株)	25,000	5.08	2,500	910
7261	マツダ(株)	18,000	4.98	1,800	650
7267	本田技研工業(株)	17,000	5.74	1,700	750
7269	スズキ(株)	23,500	7.67	2,350	810
7731	(株)ニコン	9,400	23.07	940	358
7733	オリンパス(株)	24,500	11.46	2,450	910
7741	HOYA(株)	25,500	11.39	2,550	880
7751	キヤノン(株)	11,000	4.75	1,100	780
7752	(株)リコー	4,500	4.30	450	261
7911	凸版印刷(株)	32,000	5.46	3,200	1,550
7912	大日本印刷(株)	42,000	4.57	4,200	2,120
7974	任天堂(株)	86,000	8.39	8,600	2,840
8001	伊藤忠商事(株)	4,700	4.13	470	275
8002	丸紅(株)	2,800	5.45	280	149
8028	(株)ファミリーマート	16,000	7.11	1,600	890
8031	三井物産(株)	5,400	4.35	540	328
8035	東京エレクトロン(株)	47,000	9.71	4,700	1,750
8053	住友商事(株)	5,100	22.49	510	253
8058	三菱商事(株)	8,400	9.98	840	449
8113	ユニ・チャーム(株)	15,100	7.47	1,510	590
8252	(株)丸井グループ	5,800	5.14	580	213
8253	(株)クレディセゾン	22,500	23.84	2,250	460
8263	(株)ダイエー	1,500	29.08	150	28
8267	イオン(株)	5,600	9.65	560	245
8306	(株)三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,500	4.04	250	140
8308	(株)リソナホールディングス	3,600	7.35	360	130

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)	32,000	12.50	3,200	1,000
8316	(株)三井住友フィナンシャルグループ	20,000	10.65	2,000	900
8411	(株)みずほフィナンシャルグループ	700	4.32	70	42
8473	SBIホールディングス(株)	13,600	15.36	1,360	300
8591	オリックス(株)	16,800	16.34	1,680	330
8601	(株)大和証券グループ本社	82,000	25.02	8,200	2,010
8604	野村ホールディングス(株)	5,100	13.69	510	149
8630	損保ジャパン日本興亜ホールディングス (株)	17,500	7.29	1,750	650
8725	MS&ADインシュアランスグループホール ディングス(株)	14,300	6.54	1,430	590
8750	第一生命保険(株)	9,100	6.11	910	366
8766	東京海上ホールディングス(株)	20,500	6.15	2,050	820
8795	(株)T&Dホールディングス	8,800	8.82	880	302
8801	三井不動産(株)	165,000	13.08	16,500	6,800
8802	三菱地所(株)	123,000	28.09	12,300	5,300
8830	住友不動産(株)	250,000	17.09	25,000	8,400
8951	日本ビルファンド投資法人	24,000	10.92	2,400	1,190
8952	ジャパニリアルエステイト投資法人	18,000	11.58	1,800	1,180
8953	日本リテールファンド投資法人	10,700	5.35	1,070	510
8954	オリックス不動産投資法人	6,900	5.97	690	337
8955	日本プライムリアルティ投資法人	16,000	6.70	1,600	860
8957	東急リアル・エステート	6,200	6.24	620	316
8959	野村不動産オフィスファンド投資法人	16,000	2.95	1,600	1,020
8961	森トラスト総合リート	9,300	5.25	930	473
8967	日本ロジスティクスファンド投資法人	8,000	3.28	800	540
8972	ケネディクス不動産	32,000	6.64	3,200	1,320
8976	大和証券オフィス投資法人	24,000	5.79	2,400	1,220
8984	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	22,000	5.21	2,200	1,100
9005	東京急行電鉄(株)	27,000	5.66	2,700	1,420
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	1,130
9022	東海旅客鉄道(株)	81,000	7.75	8,100	3,430
9062	日本通運(株)	30,000	6.34	3,000	1,160
9064	ヤマトホールディングス(株)	17,200	14.72	1,720	500
9101	日本郵船(株)	15,000	5.45	1,500	700
9104	(株)商船三井	21,000	7.34	2,100	770
9107	川崎汽船(株)	22,000	7.23	2,200	630
9201	日本航空(株)	21,000	7.25	2,100	770
9202	ANAホールディングス(株)	23,000	10.67	2,300	610
9301	三菱倉庫(株)	87,000	13.87	8,700	3,770
9404	日本テレビホールディングス(株)	7,500	5.05	750	368
9432	日本電信電話(株)	38,000	11.89	3,800	1,260
9433	KDDI(株)	40,000	6.75	4,000	1,530
9437	(株)NTTドコモ	9,000	6.05	900	371
9501	東京電力(株)	3,700	24.55	370	88
9502	中部電力(株)	5,200	5.17	520	279
9503	関西電力(株)	6,800	7.46	680	246
9504	中国電力(株)	5,500	3.67	550	317
9506	東北電力(株)	6,100	6.05	610	285
9508	九州電力(株)	9,000	12.14	900	249
9531	東京瓦斯(株)	22,000	3.98	2,200	1,310
9532	大阪瓦斯(株)	15,000	3.47	1,500	920
9613	(株)エヌ・ティ・ティ・データ	19,500	6.15	1,950	890
9735	セコム(株)	36,000	7.27	3,600	1,380
9766	コナミ(株)	10,000	5.20	1,000	450
9831	(株)ヤマダ電機	2,500	9.62	250	78
9983	(株)ファーストリテイリング	180,000	8.15	18,000	8,700
9984	ソフトバンク(株)	46,000	9.95	4,600	1,560

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	31.57%	1.00 : 1.30
超長期国債 : 長期国債	13.40%	1.00 : 1.38
超長期国債 : 中期国債	23.28%	1.00 : 1.80
日経225 : TOPIX	90.51%	1.00 : 1.22
日経225 : JPX日経400	89.57%	1.00 : 13.40
日経225 : TOPIX Core30	82.16%	1.00 : 23.72
日経225 : RNプライム指数	84.80%	1.00 : 1.62
TOPIX : JPX日経400	98.00%	1.00 : 10.99
TOPIX : TOPIX Core30	83.77%	1.00 : 19.45
TOPIX : RNプライム指数	86.22%	1.00 : 1.33
JPX日経400 : TOPIX Core30	92.90%	1.00 : 1.77
RNプライム指数 : JPX日経400	97.86%	1.00 : 8.27
RNプライム指数 : TOPIX Core30	93.42%	1.00 : 14.64
日経225 : 東証銀行業株価指数	84.80%	1.00 : 8.84
TOPIX : 東証銀行業株価指数	85.09%	1.00 : 7.25
東証銀行業株価指数 : JPX日経400	81.56%	1.00 : 1.52
東証銀行業株価指数 : TOPIX Core30	86.90%	1.00 : 2.68
RNプライム指数 : 東証銀行業株価指数	83.08%	1.00 : 5.45
日経225 : NYダウ	69.35%	1.00 : 9.20
TOPIX : NYダウ	66.72%	1.00 : 7.55
NYダウ : JPX日経400	62.11%	1.00 : 1.46
NYダウ : TOPIX Core30	61.39%	1.00 : 2.58
RNプライム指数 : NYダウ	65.19%	1.00 : 5.68
日経225 : CNX Nifty	53.78%	1.00 : 19.96
TOPIX : CNX Nifty	45.09%	1.00 : 16.36
JPX日経400 : CNX Nifty	48.17%	1.00 : 1.49
CNX Nifty : TOPIX Core30	48.29%	1.00 : 1.19
RNプライム指数 : CNX Nifty	45.93%	1.00 : 12.31
NYダウ : CNX Nifty	38.49%	1.00 : 2.17

※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。