

【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:2018年2月5日~2018年2月9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)
2018/2/5	450,000	0.44	150,000	15,100
2018/2/6	↓	↓	↓	↓
2018/2/7	↓	↓	↓	↓
2018/2/8	↓	↓	↓	↓
2018/2/9	↓	↓	↓	↓

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)
2018/2/5	660,000	3.55	40,000	46,600
2018/2/6	↓	↓	↓	↓
2018/2/7	750,000	9.62	↓	↓
2018/2/8	↓	↓	↓	↓
2018/2/9	↓	↓	↓	↓

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)
2018/2/5	480,000	2.80	105,000	37,300
2018/2/6	↓	↓	↓	↓
2018/2/7	540,000	6.58	↓	↓
2018/2/8	↓	↓	↓	↓
2018/2/9	↓	↓	↓	↓

4. JPX日経インデックス400グループ【コード:0022】

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)
2018/2/5	43,500	3.04	10,500	33,000
2018/2/6	↓	↓	↓	↓
2018/2/7	48,500	6.11	↓	↓
2018/2/8	↓	↓	↓	↓
2018/2/9	↓	↓	↓	↓

5. 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)
2018/2/5	36,000	↓	14,000	↓
2018/2/6	↓	↓	↓	↓
2018/2/7	160,500	↓	58,500	↓
2018/2/8	↓	↓	↓	↓
2018/2/9	↓	↓	↓	↓

6. 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)
2018/2/5	14,000	↓	14,000	↓
2018/2/6	14,400	↓	14,400	↓
2018/2/7	↓	↓	↓	↓
2018/2/8	↓	↓	↓	↓
2018/2/9	↓	↓	↓	↓

7. 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)
2018/2/5	8,900	↓	100	↓
2018/2/6	↓	↓	↓	↓
2018/2/7	↓	↓	↓	↓
2018/2/8	↓	↓	↓	↓
2018/2/9	↓	↓	↓	↓

8. 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)
2018/2/5	7,500	↓	100	↓
2018/2/6	↓	↓	↓	↓
2018/2/7	↓	↓	↓	↓
2018/2/8	↓	↓	↓	↓
2018/2/9	↓	↓	↓	↓