

【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:2022年3月11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)
2022/3/7	630,000	0.80	180,000	15,100
2022/3/8	↓	↓	↓	↓
2022/3/9	↓	↓	↓	↓
2022/3/10	↓	↓	↓	↓
2022/3/11	↓	↓	↓	↓

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)
2022/3/7	1,470,000	9.04	110,000	52,000
2022/3/8	↓	↓	↓	↓
2022/3/9	↓	↓	↓	↓
2022/3/10	↓	↓	↓	↓
2022/3/11	↓	↓	↓	↓

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)
2022/3/7	915,000	5.63	165,000	36,900
2022/3/8	↓	↓	↓	↓
2022/3/9	↓	↓	↓	↓
2022/3/10	↓	↓	↓	↓
2022/3/11	↓	↓	↓	↓

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)
2022/3/7	81,500	5.51	17,000	34,000
2022/3/8	↓	↓	↓	↓
2022/3/9	↓	↓	↓	↓
2022/3/10	↓	↓	↓	↓
2022/3/11	↓	↓	↓	↓

5. 東証REIT指数グループ【コード:0069】

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)
2022/3/7	110,500	6.90	10,500	3,800
2022/3/8	↓	↓	↓	↓
2022/3/9	↓	↓	↓	↓
2022/3/10	↓	↓	↓	↓
2022/3/11	↓	↓	↓	↓

6. 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)
2022/3/7	101,500		31,500	
2022/3/8	↓		↓	
2022/3/9	↓		↓	
2022/3/10	↓		↓	
2022/3/11	↓		↓	

7. 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)
2022/3/7	29,400		15,000	
2022/3/8	↓		↓	
2022/3/9	↓		↓	
2022/3/10	↓		↓	
2022/3/11	↓		↓	

8. 金グループ【コード:00A0】

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)
2022/3/7	156,000	3.17	6,000	720
2022/3/8	↓	↓	↓	↓
2022/3/9	↓	↓	↓	↓
2022/3/10	270,000	3.25	↓	770
2022/3/11	↓	↓	↓	↓

9. ゴールドスポットグループ【コード:00A2】

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)
2022/3/7	19,200			
2022/3/8	↓			
2022/3/9	↓			
2022/3/10	28,200			
2022/3/11	↓			

10. ブラッドパイ原油グループ【コード:00A7】

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)
2022/3/7	401,000		34,500	
2022/3/8	473,000		↓	
2022/3/9	↓		↓	
2022/3/10	↓		↓	
2022/3/11	522,500		↓	

11. バージガソリングループ【コード:00A8】

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)
2022/3/7	385,000		86,000	
2022/3/8	519,500		↓	
2022/3/9	↓		↓	
2022/3/10	↓		↓	
2022/3/11	↓		↓	

12. バージ灯油グループ【コード:00A9】

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)
2022/3/7	211,500		140,500	
2022/3/8	445,500		↓	
2022/3/9	↓		↓	
2022/3/10	↓		↓	
2022/3/11	↓		↓	