

## FTSE JPX ネットゼロ・ジャパン 500 指数先物取引制度要綱

2022 年 12 月 5 日

株式会社大阪取引所

項目	内容	備考
<p>I. 取引の仕組みについて</p> <p>1. 取引対象</p> <p>2. 立会方法</p> <p>(1) 立会の区分及び取引時間</p> <p>(2) 立会方法</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 取引対象は、FTSE JPX ネットゼロ・ジャパン 500 インデックス（以下「FTSE JPX ネットゼロ 500 インデックス」といいます。）とします。</li>   <li>・ 立会は、日中立会及び夜間立会に分かれ、各立会の取引時間は次のとおりとします。 <ul style="list-style-type: none"> <li>① 日中立会 <ul style="list-style-type: none"> <li>➤ オープニング・オークション：午前 8 時 45 分</li> <li>➤ レギュラー・セッション：午前 8 時 45 分から午後 3 時 10 分</li> <li>➤ クロージング・オークション：午後 3 時 15 分</li> </ul> </li> <li>② 夜間立会 <ul style="list-style-type: none"> <li>➤ オープニング・オークション：午後 4 時 30 分</li> <li>➤ レギュラー・セッション：午後 4 時 30 分から翌日の午前 5 時 55 分</li> <li>➤ クロージング・オークション：午前 6 時</li> </ul> </li> </ul> </li>   <li>・ 売買システムによる個別競争取引とします。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 本制度要綱において当該指数先物取引を「FTSE JPX ネットゼロ 500 指数先物取引」といいます。</li>   <li>・ 日経平均先物取引等の指数先物取引（以下「他の指数先物取引」といいます。）と同様です。</li>   <li>・ 売買システムは、J-GATE3.0 を利用します。</li> </ul>

項目	内容	備考
3. 限月取引及びその数	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 3月、6月、9月及び12月の限月取引の第二金曜日（休業日に当たるときは、順次繰り上げます。）の前日（休業日に当たるときは、順次繰り上げます。）を取引最終日とした3限月取引制とします。</li> <li>・ 直近の限月取引の取引最終日の翌営業日の日中立会から新たな限月取引を開始します。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 取引期間は9か月とします。</li> <li>・ フレックス限月取引の設定は行わないものとします。</li> </ul>
4. 取引単位及び呼値等	<ul style="list-style-type: none"> <li>（1）取引単位 <ul style="list-style-type: none"> <li>・ FTSE JPX ネットゼロ 500 インデックスに10,000円を乗じて得た額を1単位とします。</li> </ul> </li> <li>（2）呼値 <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 呼値は、成行及び指値とし、当社が定める有効期間条件・執行数量条件を付して行うものとします。</li> </ul> </li> <li>（3）呼値の単位 <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 呼値の単位は、0.5ポイントとします。</li> </ul> </li> <li>（4）呼値の制限値幅 <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 呼値の制限値幅は、制限値幅の基準値段（原則、前取引日の清算数値）を中心に当該値に8%を乗じて得た数値（以下「制限値幅」といいます。）の範囲内とし、これを超える値段に呼値を行うことはできないものとします。</li> <li>・ サーキット・ブレーカー発動により行う呼値の制限値幅の上限又は下限の拡大における第一次拡大制限値幅及び第二次拡大制限値幅は、制限値幅の基準値段にそれぞれ12%、16%を乗じて得た数値とします。</li> </ul> </li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 有効期間条件・執行数量条件については、他の指数先物取引と同様です。</li> </ul>

項目	内容	備考
5. 取引の停止及び一時中断 (1) 取引の停止          (2) 取引の一時中断 (サーキット・ブレーカー)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 当社は、次に掲げる場合には、取引を停止することができるものとします。               <ul style="list-style-type: none"> <li>a 当社が取引の状況に異常があると認める場合</li> <li>b 当社取引管理上、取引を継続して行わせることが適当でないとした場合</li> <li>c 売買システムの稼働に支障が生じた場合等において、当社が売買システムによる取引を継続して行わせることが困難であると認める場合</li> </ul> </li>   <li>・ 中心限月取引において、呼値の制限値幅の上限の値段又は下限の値段で取引等が行われた場合、全限月取引の取引を 10 分間以上中断します。</li> <li>・ 当該取引の一時中断にあわせて、全限月取引に係る呼値の制限値幅の上限（下限）を拡大します。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 中心限月取引は直近限月取引とします。</li> </ul>

項目	内容	備考													
(3) 即時約定可能値幅 (Dynamic Circuit Breaker)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 各限月取引に係る立会において、即時約定可能値幅（以下「DCB」といいます。）を以下のとおり適用します。               <ul style="list-style-type: none"> <li>a DCB の基準となる値段（以下「DCB 基準値段」といいます。）から当社が定める値幅（以下「DCB 値幅」といいます。）を超えて取引が成立することとなる場合には、一定時間、取引を一時中断します。</li> <li>b DCB 基準値段、DCB 値幅及びDCBによる中断時間は、対象セッションごとに以下のとおりとします。</li> </ul> </li> </ul> <table border="1" data-bbox="584 550 1525 943"> <thead> <tr> <th data-bbox="584 550 831 647">対象セッション</th> <th data-bbox="831 550 1055 647">DCB 基準値段</th> <th data-bbox="1055 550 1301 647">DCB 値幅</th> <th data-bbox="1301 550 1525 647">DCB による中断時間</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="584 647 831 745">オープニング・オークション</td> <td data-bbox="831 647 1055 943" rowspan="3">直近約定値段又はBBO 仲値</td> <td data-bbox="1055 647 1301 745">上下 3.0%</td> <td data-bbox="1301 647 1525 842" rowspan="2">30 秒</td> </tr> <tr> <td data-bbox="584 745 831 842">レギュラー・セッション</td> <td data-bbox="1055 745 1301 842">上下 0.8%</td> </tr> <tr> <td data-bbox="584 842 831 943">クロージング・オークション</td> <td data-bbox="1055 842 1301 943">上下 1.5%</td> <td data-bbox="1301 842 1525 943">- (値幅内でのみ約定)</td> </tr> </tbody> </table>	対象セッション	DCB 基準値段	DCB 値幅	DCB による中断時間	オープニング・オークション	直近約定値段又はBBO 仲値	上下 3.0%	30 秒	レギュラー・セッション	上下 0.8%	クロージング・オークション	上下 1.5%	- (値幅内でのみ約定)	
対象セッション	DCB 基準値段	DCB 値幅	DCB による中断時間												
オープニング・オークション	直近約定値段又はBBO 仲値	上下 3.0%	30 秒												
レギュラー・セッション		上下 0.8%													
クロージング・オークション		上下 1.5%	- (値幅内でのみ約定)												
6. 取引規制の方法	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 当社は、取引の状況に異常があると認める場合又はそのおそれがあると認める場合には、取引又はその受託に関し、当社が規則に定める規制措置のうち、必要な措置を行うことができることとします。</li> </ul>														
7. ストラテジー取引	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 取引参加者は、当社が定めるところにより、ストラテジー取引を行うことができるものとします。</li> <li>・ ストラテジー取引に係る呼値の単位は、0.1 ポイントとします。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ カレンダー・スプレッド取引のみ可能とします。</li> </ul>													
8. J-NET 取引	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 取引参加者は、当社が定めるところにより、FTSE JPX ネットゼロ指数先物取引について J-NET 取引を行うことができるものとします。</li> </ul>														

項目	内容	備考
9. ギブアップ 10. 取引参加者	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ J-NET 取引に係る呼値の単位は、0.0001 ポイントとします。</li> <li>・ ギブアップを可能とします。</li> <li>・ 指数先物取引等取引資格を有する取引参加者は、当社市場において直接取引することができることとします。</li> </ul>	
II. 清算・決済の仕組みについて	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ FTSE JPX ネットゼロ 500 指数先物取引の清算・決済は、株式会社日本証券クリアリング機構が定める方法により行います。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 他の指数先物取引と同様です。</li> <li>・ 最終清算数値は取引最終日の終了する日の翌営業日における取引対象の各構成銘柄の始値に基づいて算出した値とします。</li> </ul>
III. その他 1. 取引手数料 2. マーケットメイカー制度 3. 祝日取引	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 今後決定します。</li> <li>・ 流動性を補完するため、マーケットメイカー制度の対象とします。</li> <li>・ 祝日取引の対象とします。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 具体的な制度内容については、今後、取引参加者に通知します。</li> <li>・ 祝日取引における取引制度上の取扱いは、他の指数先物取引と同様です。</li> </ul>

項目	内容	備考
4. 情報開示 (1) 相場情報  (2) 投資部門別取引内容	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 他の先物取引と区分して、四本値、取引高及び建玉残高等の相場情報を公表します。</li> <li>・ 投資部門別取引内容（取引高及び取引契約金額）は開示しないものとします。</li> </ul>	
IV. 取引開始日	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 2023年5月29日（予定）とします。</li> </ul>	

以 上