

新デリバティブ売買システム導入に伴う先物・オプション取引制度の追加改正事項について（案）

平成 22 年 3 月 16 日

株式会社大阪証券取引所

項 目	内 容	備 考
<p>I 趣旨</p> <p>II 改正概要</p> <p>1 先物・オプション取引に係る場間の廃止</p> <p>2 日経 225mini へのシリアル限月取引の導入</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・ 当社は、日本の株式市場の昼休み時間帯における経済情勢・他のアジア市場の動向等に対応したヘッジ取引等に対するニーズが拡大してきていることを踏まえて、先物・オプション取引における午前立会と午後立会の間時間帯（以下「場間」という。）を廃止することとする。 ・ また、日経 225 オプション取引の四半期限月取引以外の限月取引（以下「シリアル限月取引」という。）に係るデルタヘッジ取引をより効率的に行うことができるよう、日経 225mini についてもシリアル限月取引を導入することとする。 <ul style="list-style-type: none"> ・ 先物・オプション取引について、午前立会と午後立会の場間を廃止し、日中は「1場制」とする。 ・ これに伴い、午前立会終了から午後立会開始までの間の午前立会の VWAP 又は VWAP 土手数料相当額による J-NE T デリバティブ取引を廃止するなど所要の改正を行う。 <ul style="list-style-type: none"> ・ 日経 225 mini について、3月、6月、9月及び12月のうち直近2か月と当該月以外の直近の3か月の各月の第二金曜日の前営業日に終了する取引日を取引最終日とする5限月取引制とする。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 四半期限月取引とは、3月、6月、9月及び12月の各限月取引をいう。 <ul style="list-style-type: none"> ・ シリアル限月取引の取引最終日及び SQ 算出日並びに SQ は、日経 225 オプショ

項 目	内 容	備 考
Ⅲ 実施日	<ul style="list-style-type: none"> ・ 各限月取引の期間は、3月、6月、9月及び12月の各限月取引については6か月、1月、4月、7月及び10月の各限月取引については5か月、その他の各限月取引については4か月とする。 ・ 新デリバティブ売買システムの稼働日から実施するものとする。 	<ul style="list-style-type: none"> ン取引における同じ限月取引に係る日及び数値と同じとする。 ・ シリアル限月の清算数値の決定方法は、他の株価指数先物取引と同様とする。 ・ 新デリバティブ売買システム稼働時期：平成 22 年度第 4 四半期目途。

以 上