

株価指数先物・オプション取引に係る大口対当取引制度要綱（案）

平成 11 年 8 月 27 日

大阪証券取引所

項 目	内 容	備 考
<p>1 取引の仕組み 大口対当取引</p> <p>取引時間</p> <p>取引の申込み方法</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・ 正会員又は先物取引等特別参加者（以下「正会員等」という。）は、立会取引（個別競争取引）によらずに、本所の定める数量以上で、同一限月取引の売付けと買付けを同時に行う株価指数先物取引（以下「株価指数先物取引に係る大口対当取引」という。）、又は同一銘柄の売付けと買付けを同時に行う株価指数オプション取引（以下「株価指数オプション取引に係る大口対当取引」という。）を行うことができるものとする。 ・ 次の各号に掲げる株価指数先物取引及び株価指数オプション取引（以下「株価指数先物・オプション取引」という。）の全ての銘柄が、株価指数先物取引に係る大口対当取引又は株価指数オプション取引に係る大口対当取引（以下「株価指数先物・オプション取引に係る大口対当取引」という。）の対象となる。 <ul style="list-style-type: none"> 日経株価指数 300 先物取引 日経平均株価先物取引 日経 300 株価指数オプション取引 日経平均株価指数オプション取引 ・ 取引時間は、午前 8 時 20 分から午後 4 時までとする（半休日においては、午前 8 時 20 分から正午までとする。）。) ・ 正会員等は、取引時間中において、売買システムにより株価指数先物・オプション取引に係る大口対当取引の申込みを行うものとする。 	

<p>値段</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・ 正会員等は、顧客の委託に基づく申込みか、自己の計算による申込みかの別を明らかにしなければならない。 ・ 正会員等は、次のとおり計算した上限と下限の範囲以内の呼値の単位の整数倍の値段で、株価指数先物・オプション取引に係る大口対当取引の申込みを行うものとする。 <p>株価指数先物取引</p> <p>(上限) X円 (日経株価指数 300 先物取引についてはポイント。この号において同じ。) + X円 \times 5% (立会取引時間中は 3%。以下、値段の範囲計算において同じ。)</p> <p>(下限) X円 - X円 \times 5%</p> <p>株価指数オプション取引</p> <p>(上限) X'円 (日経 300 株価指数オプション取引についてはポイント。この号において同じ。) + Y円 \times 5%</p> <p>(下限) X'円 - Y円 \times 5%</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・ 立会取引において、取引開始日以後取引が成立したことがなく、かつ、最終気配値段が表示されたことがない銘柄については、株価指数先物・オプション取引に係る大口対当取引を行うことができない。 ・ X円は、立会取引時間中については、申込み時の立会取引における直前の約定指数(気配表示がある場合は、当該気配値段。以下同じ。)とし、立会取引時間外については、直前の立会取引における最終約定指数(最終気配表示がある場合は、当該最終気配値段。)とする。 ただし、申込み時の立会取引に約定指数がない、又は直前の立会取引において約定指数がない場合は、本所が定める値段とする。 ・ X'円は、立会取引時間中については、申込み時の立会取引における直前の約定値段(気配表示がある場合は、当該気配値段。以下同じ。)とし、立会取引時間外につい
-----------	---	---

<p>数量</p> <p>取引契約締結の方法</p> <p>取引の停止及び一時中断</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・ 正会員等は、日経平均株価に係る株価指数先物・オプション取引については 200 単位以上の数量で、日経株価指数 300 に係る株価指数先物・オプション取引については 500 単位以上の数量で、株価指数先物・オプション取引に係る大口対当取引の申込みを行うものとする。 ・ 本所は、同一正会員等による売付けに係る申込みと買付けに係る申込みとを対当させることにより、株価指数先物・オプション取引に係る大口対当取引を成立させるものとする。 ・ 本所は、次の各号に掲げる場合には、株価指数先物・オプション取引に係る大口対当取引を停止することができる。 <ul style="list-style-type: none"> 本所が立会取引における株価指数先物・オプション取引を停止する場合 株価指数先物・オプション取引に係る大口対当取引の売買システムの稼動に支障が生じた場合 その他本所が適当と認める場合 	<p>ては、直前の立会取引における最終約定値段(最終気配表示がある場合は、当該気配値段。)とする。ただし、申込み時の立会取引において約定値段がない場合、又は直前の立会取引において約定値段がない場合は、本所が定める値段とする。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ Y円は、申込み時における現物指数とする。ただし、当日に現物指数が公表されていない場合については、本所が定める現物指数とする。
---	---	---

	<ul style="list-style-type: none"> ・ 本所が立会取引における株価指数先物・オプション取引に関して、全ての銘柄又は一部の銘柄の取引を一時中断する場合には、取引を一時中断している間、当該銘柄についての株価指数先物・オプション取引に係る大口対当取引を一時中断する。 	
2 株価指数先物取引における値洗い	<ul style="list-style-type: none"> ・ 各限月取引における売付け又は買付けとして取り扱う。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 株価指数先物取引に係る大口対当取引により成立した約定指数は、清算指数に用いない。
3 建玉及び決済	<ul style="list-style-type: none"> ・ 各銘柄における売付け又は買付けとして取り扱う。 	
4 証拠金	<ul style="list-style-type: none"> ・ 各銘柄における売付け又は買付けとして取り扱う。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 株価指数オプション取引に係る大口対当取引により成立した約定値段は、証拠金算定基準値段に用いない。
5 定率会費又は定率負担金	<ul style="list-style-type: none"> ・ 各銘柄における売付け又は買付けとして取り扱う。 	
6 取引高及び約定値段の公表	<ul style="list-style-type: none"> ・ 本所は、株価指数先物・オプション取引に係る大口対当取引の取引時間終了後、当該取引に係る各銘柄の取引高（立会取引による取引高を含める。）、最高、最低及び最終の約定指数を公表する。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 公表は、本所ホームページにおける掲載、報道機関への資料配布により行う。
7 取引開始日	<ul style="list-style-type: none"> ・ 取引の開始日は、平成 11 年 11 月を目途とする。 	