

Russell / Nomura Prime インデックス先物取引制度要綱（案）

平成 16 年 10 月 26 日  
株式会社大阪証券取引所

項 目	内 容	備 考
取引の仕組み		
1 取引対象	<ul style="list-style-type: none"> <li>取引対象は、ラッセル・インベストメント・グループ及び野村證券株式会社(以下「ラッセル野村」という。)が算出する Russell / Nomura Prime インデックス(以下「当該インデックス」という。)とする。</li> </ul>	
2 限月取引	<ul style="list-style-type: none"> <li>3月、6月、9月及び12月の各月の第2金曜日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。)の前日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。以下同じ。)を取引最終日とする5限月取引制(最長1年3か月)とする。</li> <li>直近限月取引の取引最終日の翌日(休業日に当たるときは順次繰り下げる。以下同じ。)を新たな限月取引の取引開始日とする。</li> <li>各限月取引の最終決済期日は、最終清算指数決定日の翌日とする。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>他の株価指数先物取引(Dow Jones Industrial Average™先物取引を除くすべての株価指数先物取引)と同様。</li> </ul>
3 取引契約締結の方法	<ul style="list-style-type: none"> <li>個別競争取引とする。</li> </ul>	
4 立会方法等		
(1) 立会時間	<ul style="list-style-type: none"> <li>午前立会：午前9時から11時まで(半休日においては、午前9時から11時10分まで)</li> </ul>	

項 目	内 容	備 考
(2) 立会方法	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 午後立会：午後0時30分から3時10分まで</li> <li>・ 売買システムによる取引とする。</li> </ul>	
5 取引単位、呼値及び値幅制限		
(1) 取引単位	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 当該インデックスの数値に10,000円を乗じて得た額を1単位とする。</li> </ul>	
(2) 呼値	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 成行及び指値とする。</li> <li>・ 呼値の単位は、0.5ポイントとする。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 1ティックの金額は、5,000円。</li> </ul>
(3) 値幅制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 呼値は、本所が定める値幅の限度を超える値段により行うことができないものとする。</li> <li>・ 値幅の限度は、基準値段（原則として、前日の清算指数）を中心に次の値幅とする。ただし、本所は、市場の状況等を勘案し、必要に応じて呼値の制限値幅を変更することができるものとする。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 他の株価指数先物取引と同様。</li> <li>・ MSCI JAPAN<sup>SM</sup> 先物取引と同じ。</li> </ul>

項 目	内 容	備 考																		
	<table><tr><th>基 準 値 段</th><th>値 幅</th></tr><tr><td>500 ポイント未満</td><td>上下 80 ポイント</td></tr><tr><td>500 ポイント以上 1,000 ポイント未満</td><td>上下 160 ポイント</td></tr><tr><td>1,000 ポイント以上 1,500 ポイント未満</td><td>上下 240 ポイント</td></tr><tr><td>1,500 ポイント以上 2,000 ポイント未満</td><td>上下 320 ポイント</td></tr><tr><td>2,000 ポイント以上 2,500 ポイント未満</td><td>上下 400 ポイント</td></tr><tr><td>2,500 ポイント以上 3,000 ポイント未満</td><td>上下 480 ポイント</td></tr><tr><td>3,000 ポイント以上 3,500 ポイント未満</td><td>上下 560 ポイント</td></tr><tr><td>3,500 ポイント以上</td><td>上下 640 ポイント</td></tr></table>	基 準 値 段	値 幅	500 ポイント未満	上下 80 ポイント	500 ポイント以上 1,000 ポイント未満	上下 160 ポイント	1,000 ポイント以上 1,500 ポイント未満	上下 240 ポイント	1,500 ポイント以上 2,000 ポイント未満	上下 320 ポイント	2,000 ポイント以上 2,500 ポイント未満	上下 400 ポイント	2,500 ポイント以上 3,000 ポイント未満	上下 480 ポイント	3,000 ポイント以上 3,500 ポイント未満	上下 560 ポイント	3,500 ポイント以上	上下 640 ポイント	
基 準 値 段	値 幅																			
500 ポイント未満	上下 80 ポイント																			
500 ポイント以上 1,000 ポイント未満	上下 160 ポイント																			
1,000 ポイント以上 1,500 ポイント未満	上下 240 ポイント																			
1,500 ポイント以上 2,000 ポイント未満	上下 320 ポイント																			
2,000 ポイント以上 2,500 ポイント未満	上下 400 ポイント																			
2,500 ポイント以上 3,000 ポイント未満	上下 480 ポイント																			
3,000 ポイント以上 3,500 ポイント未満	上下 560 ポイント																			
3,500 ポイント以上	上下 640 ポイント																			
6 取引の一時中断	<ul style="list-style-type: none"><li>本所は、限月取引の直前の約定指数（特別気配含む。）が基準値段から一定幅を超えて上昇（又は下落）し、かつ当該限月取引の理論価格（本所が算出する数値）から一定幅を超えて上方（又は下方）に乖離している場合には、当該限月取引について取引を一時中断する。</li></ul>	<ul style="list-style-type: none"><li>他の株価指数先物取引と同様。具体的な基準は、MSCI JAPAN 先物取引と同じ。</li></ul>																		
7 取引規制の方法	<ul style="list-style-type: none"><li>本所は 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、制限値幅の縮小及び証拠金の差入日時の繰上げ等の必要な措置を行うことができるものとする。</li></ul>	<ul style="list-style-type: none"><li>他の株価指数先物取引と同様。</li></ul>																		

項 目	内 容	備 考
限月間スプレッド取引	<ul style="list-style-type: none"> <li>取引参加者は、本所が定めるところにより、限月間スプレッド取引を行うことができるものとする。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>具体的な制度内容については、日経平均株価先物取引に係る限月間スプレッド取引と同様とする。</li> </ul>
立会外大口取引	<ul style="list-style-type: none"> <li>取引参加者は、本所が定めるところにより、取引単位の 100 倍以上の数量により立会外大口取引を行うことができるものとする。</li> <li>値段の単位は、0.1 ポイントの整数倍とする。</li> <li>その他の事項については、日経平均株価先物取引に係る立会外大口取引と同様とする。</li> </ul>	
証拠金	<ul style="list-style-type: none"> <li>顧客が差し入れる証拠金所要額及び自己取引に係る証拠金所要額については、SPAN<sup>®</sup>（CME が開発した証拠金計算方法）を利用して計算する。</li> <li>SPAN による証拠金所要額の計算において、次に掲げる株価指数に係る株価指数先物取引及び株価指数オプション取引との間で、リスク相殺を認めることとする。 <ol style="list-style-type: none"> <li>(1) 日経平均株価</li> <li>(2) 日経株価指数 300</li> <li>(3) MSCI JAPAN Index</li> </ol> </li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>他の株価指数先物取引と同様。</li> </ul>

項 目	内 容	備 考
値洗い	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 清算参加者と本所との間の値洗いは毎日行うこととし、本所が毎日定める清算指数を基準として、清算参加者毎に引直差金及び更新差金を算出し、これを清算参加者と本所との間で授受するものとする。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 値洗差金の授受に係る方法等については、他の株価指数先物取引と同じ。</li> </ul>
決済について	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 新規の売付け及び買付けはそれぞれ建玉として算定し、転売若しくは買戻し又は最終決済（最終清算指数による決済）により決済を行うものとする。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 転売又は買戻しの申告、最終清算指数の決定及び顧客と取引参加者との間における決済等に係る方法等については、他の株価指数先物取引と同様。</li> </ul>
決済履行確保の基金	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 決済履行確保の基金は、先物取引等違約損失準備金、清算預託金及び特別清算預託金とする。</li> <li>・ 特別清算預託金所要額に係る料率は、万分の 3 とする。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 他の株価指数先物取引と同様。ただし、日経平均株価及び日経株価指数 300 に係る株価指数先物・オプション取引については、当分の間、特別清算預託金所要額の算出から控除することとしている。</li> </ul>
定率負担金	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 別途検討する。</li> </ul>	
取引参加者	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 取引参加者は正取引参加者及び先物取引等取引参加者とする。</li> </ul>	

項 目	内 容	備 考
情報開示		
1 四本値及び取引高等の公表	<ul style="list-style-type: none"> <li>以下の情報を，電子情報システムにより伝達することとする。</li> <li>(1) 四本値</li> <li>(2) 限月取引別取引高概算</li> <li>(3) 限月取引別建玉残高概算</li> <li>(4) 気配情報</li> </ul>	
2 取引参加者別取引内容(手口)及び建玉残高の公表	<ul style="list-style-type: none"> <li>当分の間，公表しない。</li> </ul>	
3 投資部門別取引内容の公表	<ul style="list-style-type: none"> <li>投資部門別に，売・買別の取引高及び取引契約金額を公表する(週間・月間・年間)。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>他の株価指数先物取引と同様。</li> </ul>
XI 取引開始日等	<ul style="list-style-type: none"> <li>取引開始日は，平成 17 年 4 月を目途とする。</li> <li>ただし，限月間スプレッド取引及び参加者間立会外大口取引については，新売買システム稼動以降に導入する。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>新売買システム稼動時期：平成 17 年度下期目途</li> </ul>

以 上