

デリバティブ市場における新商品導入等に伴う業務規程等の一部改正について

2023年3月22日
株式会社大阪取引所

I. 趣旨

当社は、業務規程等の一部改正を行い、2023年5月29日から施行します（詳細については、規則改正新旧対照表を御覧ください。）。

今回の改正は、デリバティブ市場における新商品の導入等に伴い、所要の対応を行うものです。

II. 改正概要

1. 新商品の導入

(1) TONA3か月金利先物

a 取引対象

- ・ TONA3か月金利に係る金融指標（日本銀行が公表する無担保コールオーバーナイト物レート（以下「TONA」といいます。）に係る3か月間の日次累積複利を100から差し引いた金融指標をいいます。）とします。

b 立会の区分及び取引時間

- ・ 立会は、午前立会（午前8時45分から11時2分まで）、午後立会（午後0時30分から3時2分まで）及び夜間立会（午後3時30分から翌日の午前6時まで）に分かれ、行うものとします。

c 限月取引及びその数

- ・ 3月、6月、9月又は12月の第三水曜日から3か月後の第三水曜日の前日までを金利参照期間とし、金利参照期間が終了する日が属する月の第三水曜日の前日（休業日に当たるときは、順次繰り上げます。以下同じ。）に終了する取引日を取引最終日とします。
- ・ 3月、6月、9月及び12月の限月取引の20限月取引制とします。

d 取引単位及び呼値

(a) 取引単位

- ・ TONA3か月金利に係る金融指標の数値に250,000円を乗じて得た額を1単位とします。

(b) 呼値の単位

- ・ 0.0025ポイントとします。

(備考)

・ 業務規程第4条の5

・ 業務規程第18条第1項第1号の2

・ 業務規程第4条の6第1項及び第2項

・ 業務規程第29条第1号の2

・ 業務規程第26条第9項第1号の2

(c) 呼値の制限値幅

- ・ 0.25 ポイント（第一次拡大時は 0.5 ポイント、第二次拡大時は 0.75 ポイント）とします。

e 最終清算数値

- ・ 金利参照期間における TONA（各銀行休業日については、その前銀行営業日における TONA を複利計算せずに適用）の日次累積複利（年利換算し、百分率で表示した利率）を 100 から差し引いた数値（小数点以下第 4 位未満の端数があるときは、これを四捨五入）とします。

f 取引資格

- ・ 先物取引等取引資格及び国債先物等取引資格を有する取引参加者が取引できるものとします。
- ・ 取引の開始及び中止を行う場合には、あらかじめ当社に届出を行うものとします。

g 取引手数料

- ・ 1 取引単位につき、70 円とします。

(2) 日経 225 マイクロ先物

a 取引対象

- ・ 日経平均株価とします。

b 立会の区分及び取引時間

- ・ 立会は、日中立会（午前 8 時 45 分から午後 3 時 15 分まで）及び夜間立会（午後 4 時 30 分から翌日の午前 6 時まで）に分かれ、行うものとします。

c 限月取引及びその数

- ・ 3 月、6 月、9 月及び 12 月の限月取引の直近 2 限月取引及びその他の限月取引の直近 2 限月取引の 4 限月取引制とし、取引最終日は、各限月の第二金曜日（休業日に当たるときは、順次繰り上げます。以下同じ。）の前日に終了する取引日とします。

・ 業務規程施行規則第 16 条第 2 項第 1 号の 2 及び第 3 項第 1 号の 2

・ 業務規程第 34 条の 12 第 1 項、業務規程施行規則第 21 条の 5 第 1 項及び別表 2 の 2

・ 取引参加者規程第 2 条第 2 項第 1 号の 2 及び第 3 項
・ 取引参加者規程第 15 条第 18 号

・ 取引参加者料金等に関する規則別表 1

・ 業務規程第 5 条第 1 項第 1 号及び第 6 条第 1 号

・ 業務規程第 18 条第 1 項第 2 号

・ 業務規程第 7 条第 2 項第 1 号 c

d 取引単位及び呼値	
(a) 取引単位	
<ul style="list-style-type: none"> 日経平均株価に 10 円を乗じて得た額を 1 単位とします。 	<ul style="list-style-type: none"> 業務規程第 29 条第 2 号 a (c)
(b) 呼値の単位	
<ul style="list-style-type: none"> 5 円とします。 	<ul style="list-style-type: none"> 業務規程第 26 条第 9 項第 2 号 a (b)
(c) 呼値の制限値幅	
<ul style="list-style-type: none"> 基準値段 (前取引日の清算数値) に 8 % (第一次拡大時は 12%、第二次拡大時は 16%) を乗じて得た数値 (5 円単位で端数切捨て) とします。 	<ul style="list-style-type: none"> 業務規程施行規則第 16 条第 2 項第 2 号 a 及び第 3 項第 2 号 a
e 最終清算数値	
<ul style="list-style-type: none"> 取引最終日の終了する日の翌日 (休業日に当たるときは、順次繰り下げます。) における日経平均株価の各構成銘柄の始値に基づいて算出した値とします。 	<ul style="list-style-type: none"> 業務規程第 36 条第 1 項第 1 号
<ul style="list-style-type: none"> 最終決済において、顧客の委託に基づく未決済約定に係る約定数値と最終清算数値との差に相当する金銭に円位未満の端数が生じた場合は、取引参加者と顧客との間で取決めがあるときを除き、切り捨てることとします。 	<ul style="list-style-type: none"> 受託契約準則第 15 条第 1 項
f 取引手数料	
<ul style="list-style-type: none"> 1 取引単位につき、1 円 10 銭とします。 	<ul style="list-style-type: none"> 取引参加者料金等に関する規則別表 1
(3) 日経 225 ミニオプション	
a 取引対象	
<ul style="list-style-type: none"> 日経平均株価に係る指数プットオプション及び指数コールオプションとします。 	<ul style="list-style-type: none"> 業務規程第 14 条第 1 項及び第 2 項第 1 号
b 立会の区分及び取引時間	
<ul style="list-style-type: none"> 立会は、日中立会 (午前 8 時 45 分から午後 3 時 15 分まで) 及び夜間立会 (午後 4 時 30 分から翌日の午前 6 時まで) に分かち、行うものとします。 	<ul style="list-style-type: none"> 業務規程第 18 条第 1 項第 2 号
c 限月取引及びその数	
<ul style="list-style-type: none"> 第二金曜日の前日に終了する取引日を取引最終日とする限月取引の直近 3 限月取引及び各週の金曜日 (第二金曜日を除く。) の前日に終了する取引日を取引最終日とする限月取引 (以下「週次設定限月取引」とい 	<ul style="list-style-type: none"> 業務規程第 15 条第 1 項第 1 号の 2 及び第 2 項第 1 号の 2

います。)の直近4週次設定限月取引の7限月取引制とします。

※ 日経225ミニオプションの導入に伴い、現行の日経平均オプション(週次設定限月取引)は終了します。

d 権利行使価格及びその数

(a) 新規設定

- ・ 取引開始日の前日における最終の日経平均株価の数値に最も近接する125円の整数倍の数値(当該数値が2種類ある場合は高い方の数値とします。以下同じ。)及び当該数値に近接する上下各24種類の125円の整数倍の数値とします。

・ 業務規程第16条第2項第1号の2等

(b) 追加設定

- ・ 前日における日経平均株価の最終の数値に最も近接する125円の整数倍の数値を上回る(又は下回る)既存の権利行使価格が23種類以下となった場合、当該125円の整数倍の数値を上回る(又は下回る)権利行使価格が当該125円の整数倍の数値から125円刻みで連続して24種類となるまで、既存の権利行使価格から125円刻みで設定することとします。

・ 業務規程第16条第5項第1号の2等

e 取引換算額及び呼値

(a) 取引換算額

- ・ 100円とします。

・ 業務規程第14条第3項第1号及び第15条第1項第1号の2

(b) 呼値の単位

- ・ 100円以下の場合には1円、100円を超える場合は5円とします。

・ 業務規程第26条第9項第5号a

(c) 呼値の制限値幅

- ・ 基準値段に応じて呼値の制限値幅を設定することとし、拡大時は指数オプション取引制限値幅算定基準値に3%を乗じて得た数値(10円単位で端数切捨て)を拡大します。

・ 業務規程施行規則第16条第2項第5号a及び第3項第4号

f オプション清算数値

- ・ 権利行使日(取引最終日の終了する日の翌日(休業日に当たるときは、順次繰り下げます。))をいいます。)における日経平均株価の各構成銘柄の始値に基づいて算出した値とします。

・ 業務規程第40条

g 取引手数料

- ・ 1取引単位につき、4円とします。

・ 取引参加者料金等に関する規則別表 1

(4) S&P/JPX 500 ESG スコア・ティルト指数先物、FTSE JPX ネットゼロ・ジャパン 500 指数先物及び日経平均気候変動 1.5°C 目標指数先物

a 取引対象

- ・ S&P/JPX 500 ESG スコア・ティルト指数（傾斜 0.5）、FTSE JPX ネットゼロ・ジャパン 500 指数及び日経平均気候変動 1.5°C 目標指数とします。

・ 業務規程第 5 条第 1 項第 15 号、第 16 号及び第 17 号

b 立会の区分及び取引時間

- ・ 立会は、日中立会（午前 8 時 45 分から午後 3 時 15 分まで）及び夜間立会（午後 4 時 30 分から翌日の午前 6 時まで）に分ち、行うものとします。

・ 業務規程第 18 条第 1 項第 2 号

c 限月取引及びその数

- ・ 3 月、6 月、9 月及び 12 月の限月取引の 3 限月取引制とし、取引最終日は、各限月の第二金曜日の前日に終了する取引日とします。

・ 業務規程第 7 条第 1 項第 9 号及び第 2 項第 4 号

d 取引単位及び呼値

(a) 取引単位

- ・ 各取引対象に 10,000 円（日経平均気候変動 1.5°C 目標指数先物は 1,000 円）を乗じて得た額を 1 単位とします。

・ 業務規程第 29 条第 2 号 d 及び e

(b) 呼値の単位

- ・ 0.5 ポイント（日経平均気候変動 1.5°C 目標指数先物は 10 円）とします。

・ 業務規程第 26 条第 9 項第 2 号 d 及び i

(c) 呼値の制限値幅

- ・ 呼値の制限値幅の基準値段に 8%（第一次拡大時は 12%、第二次拡大時は 16%）を乗じて得た数値（0.5 ポイント単位で端数切捨て）とします。

・ 業務規程施行規則第 16 条第 2 項第 2 号 a 及び第 3 項第 2 号 a

e 最終清算数値

- ・ 取引最終日の終了する日の翌日（休業日に当たるときは、順次繰り下げます。）における各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。

・ 業務規程第 36 条第 1 項第 1 号

f 取引手数料

- ・ 1取引単位につき、110円とします。

・ 取引参加者料金等に関する規則別表 1

- | | |
|--|--|
| <p>2. 日経 225 オプションに係る限月取引の設定方法の一部見直し</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 3月、6月、9月及び12月の限月取引以外の限月取引の数を直近8限月取引とし、当該限月取引の取引期間を1年とします。 | <ul style="list-style-type: none"> ・ 業務規程第 15 条第 2 項第 1 号 a |
| <p>3. 指数オプションに係る権利行使価格の設定方法の一部見直し</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 次の a～c に掲げる指数オプションの区分に従い、新たな限月取引における権利行使価格を設定できるものとします。 <p>a 日経 225 オプション及び日経 225 ミニオプション</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 日経平均株価の数値につき、1,000 円刻みで設定する 1,000 円の整数倍の数値 <p>b 東証株価指数オプション</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 東証株価指数の数値につき、100 ポイント刻みで設定する 100 ポイントの整数倍の数値 <p>c JPX 日経インデックス 400 オプション</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ JPX 日経インデックス 400 の数値につき、1,000 ポイント刻みで設定する 1,000 ポイントの整数倍の数値 | <ul style="list-style-type: none"> ・ 業務規程第 16 条第 3 項 ・ 業務規程施行規則第 10 条第 3 項第 1 号及び第 2 号 ・ 業務規程施行規則第 10 条第 3 項第 3 号 ・ 業務規程施行規則第 10 条第 3 項第 4 号 |
| <p>4. その他</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ その他、所要の改正を行うものとします。 | |

Ⅲ. 施行日

- ・ 2023 年 5 月 29 日から施行します。ただし、売買システムの稼働に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、2023 年 5 月 29 日に施行することが適当でないと当社が認める場合には、当該日以後の当社が定める日から施行します。

以 上