

東京金融取引所日報 (TFX DAILY STATISTICS REPORT)

発行所 (Issued by) 東京金融取引所 (Tokyo Financial Exchange Inc.)

所在地 (Registered Office) 東京都千代田区丸の内 1-8-2

1-8-2 Marunouchi, Chiyoda-ku, Tokyo 電話 (Telephone) 03-4578-2400 URL https://www.tfx.co.jp E-mail info@tfx.co.jp

- 1.破線----は該当なしを表示。(---- means not applicable.)
- 2.建玉数量、取引数量の単位は、1契約。(Unit of Open Int. and Volume is 1 contract.)
- \* : Int. Rate %, p.a.
- 3.取引数量は、ストラテジー振替分を含む。(Volume includes Strategy.)
- 4.建玉数量は17:00時点のもの。(Open Int is as of 17:00.)

無担保コールオーバーナイト3ヵ月金利先物

Three-month TONA Futures

| 限月<br>Contract<br>Months | 前日清算価格<br>Settle.(Previous Day) |       | 始 値<br>Open Price |       | 高 値<br>High |       | 安 値<br>Low |       | 終 値<br>Closing |       | 公式終値<br>Official Closing |       | 清 算 価 格<br>Sett. Price |               |        | 取 引 数 量<br>Volume | 権利行使<br>移行数量<br>Exercised | 建 玉 数 量<br>Open<br>Int. |
|--------------------------|---------------------------------|-------|-------------------|-------|-------------|-------|------------|-------|----------------|-------|--------------------------|-------|------------------------|---------------|--------|-------------------|---------------------------|-------------------------|
|                          |                                 | *     |                   | *     |             | *     |            | *     |                | *     |                          | *     | 年利<br>%                | 前日比<br>Change |        |                   |                           |                         |
| 24.09                    | 99.774                          | 0.226 | ----              | ----  | ----        | ----  | ----       | ----  | ----           | ----  | 99.774                   | 0.226 | 99.774                 | 0.226         | 0.000  | 0                 | 0                         | 959                     |
| 24.12                    | 99.610                          | 0.390 | 99.608            | 0.392 | 99.608      | 0.392 | 99.607     | 0.393 | 99.607         | 0.393 | 99.608                   | 0.392 | 99.610                 | 0.390         | 0.000  | 402               | 0                         | 1,629                   |
| 25.03                    | 99.515                          | 0.485 | 99.512            | 0.488 | 99.512      | 0.488 | 99.510     | 0.490 | 99.510         | 0.490 | 99.510                   | 0.490 | 99.511                 | 0.489         | -0.004 | 604               | 0                         | 702                     |
| 25.06                    | 99.442                          | 0.558 | 99.441            | 0.559 | 99.441      | 0.559 | 99.441     | 0.559 | 99.441         | 0.559 | 99.440                   | 0.560 | 99.441                 | 0.559         | -0.001 | 451               | 0                         | 781                     |
| 25.09                    | 99.390                          | 0.610 | 99.392            | 0.608 | 99.392      | 0.608 | 99.392     | 0.608 | 99.392         | 0.608 | 99.391                   | 0.609 | 99.392                 | 0.608         | 0.002  | 1                 | 0                         | 546                     |
| 25.12                    | 99.363                          | 0.637 | ----              | ----  | ----        | ----  | ----       | ----  | ----           | ----  | 99.364                   | 0.636 | 99.365                 | 0.635         | 0.002  | 0                 | 0                         | 97                      |
| 26.03                    | 99.341                          | 0.659 | ----              | ----  | ----        | ----  | ----       | ----  | ----           | ----  | 99.342                   | 0.658 | 99.343                 | 0.657         | 0.002  | 0                 | 0                         | 5                       |
| 26.06                    | 99.319                          | 0.681 | ----              | ----  | ----        | ----  | ----       | ----  | ----           | ----  | 99.320                   | 0.680 | 99.321                 | 0.679         | 0.002  | 0                 | 0                         | 0                       |
| 26.09                    | 99.310                          | 0.690 | ----              | ----  | ----        | ----  | ----       | ----  | ----           | ----  | 99.299                   | 0.701 | 99.300                 | 0.700         | -0.010 | 0                 | 0                         | 0                       |
| 26.12                    | 99.289                          | 0.711 | ----              | ----  | ----        | ----  | ----       | ----  | ----           | ----  | 99.280                   | 0.720 | 99.281                 | 0.719         | -0.008 | 0                 | 0                         | 0                       |
| 27.03                    | 99.270                          | 0.730 | ----              | ----  | ----        | ----  | ----       | ----  | ----           | ----  | 99.265                   | 0.735 | 99.266                 | 0.734         | -0.004 | 0                 | 0                         | 0                       |
| 27.06                    | 99.255                          | 0.745 | ----              | ----  | ----        | ----  | ----       | ----  | ----           | ----  | 99.251                   | 0.749 | 99.252                 | 0.748         | -0.003 | 0                 | 0                         | 0                       |
| 27.09                    | 99.243                          | 0.757 | ----              | ----  | ----        | ----  | ----       | ----  | ----           | ----  | 99.239                   | 0.761 | 99.240                 | 0.760         | -0.003 | 0                 | 0                         | 0                       |
| 27.12                    | 99.232                          | 0.768 | ----              | ----  | ----        | ----  | ----       | ----  | ----           | ----  | 99.226                   | 0.774 | 99.227                 | 0.773         | -0.005 | 0                 | 0                         | 0                       |
| 28.03                    | 99.219                          | 0.781 | ----              | ----  | ----        | ----  | ----       | ----  | ----           | ----  | 99.212                   | 0.788 | 99.213                 | 0.787         | -0.006 | 0                 | 0                         | 0                       |
| 28.06                    | 99.203                          | 0.797 | ----              | ----  | ----        | ----  | ----       | ----  | ----           | ----  | 99.195                   | 0.805 | 99.196                 | 0.804         | -0.007 | 0                 | 0                         | 0                       |
| 28.09                    | 99.183                          | 0.817 | ----              | ----  | ----        | ----  | ----       | ----  | ----           | ----  | 99.175                   | 0.825 | 99.176                 | 0.824         | -0.007 | 0                 | 0                         | 0                       |
| 28.12                    | 99.160                          | 0.840 | ----              | ----  | ----        | ----  | ----       | ----  | ----           | ----  | 99.152                   | 0.848 | 99.153                 | 0.847         | -0.007 | 0                 | 0                         | 0                       |
| 29.03                    | 99.137                          | 0.863 | ----              | ----  | ----        | ----  | ----       | ----  | ----           | ----  | 99.129                   | 0.871 | 99.130                 | 0.870         | -0.007 | 0                 | 0                         | 0                       |
| 29.06                    | 99.112                          | 0.888 | ----              | ----  | ----        | ----  | ----       | ----  | ----           | ----  | 99.105                   | 0.895 | 99.106                 | 0.894         | -0.006 | 0                 | 0                         | 0                       |
| 計Totals                  | ----                            | ----  | ----              | ----  | ----        | ----  | ----       | ----  | ----           | ----  | ----                     | ----  | ----                   | ----          | ----   | 1,458             | 0                         | 4,719                   |

東京金融取引所日報 (TFX DAILY STATISTICS REPORT)

発行所 (Issued by) 東京金融取引所 (Tokyo Financial Exchange Inc.)

所在地 (Registered Office) 東京都千代田区丸の内 1-8-2

1-8-2 Marunouchi, Chiyoda-ku, Tokyo 電話 (Telephone) 03-4578-2400 URL https://www.tfx.co.jp E-mail info@tfx.co.jp

1.破線----は該当なしを表示。(---- means not applicable.)

3.建玉数量は17:00時点のもの。(Open Int is as of 17:00.)

2.建玉数量、取引数量の単位は、1契約。(Unit of Open Int. and Volume is 1 contract.)

\* : Int. Rate %, p.a.

無担保コールオーバーナイト3ヵ月金利先物(ブロック取引分)

Three-month TONA Futures (Block Trade)

| 限月<br>Contract<br>Months | 前日清算価格<br>Settle.(Previous Day) |         | 始値<br>Open Price |         | 高値<br>High |         | 安値<br>Low |         | 終値<br>Closing |         | 公式終値<br>Official Closing |         | 清算価格<br>Sett. Price |      |      | 取引数量<br>Volume | 権利行使<br>移行数量<br>Exercised | 建玉数量<br>Open<br>Int. |
|--------------------------|---------------------------------|---------|------------------|---------|------------|---------|-----------|---------|---------------|---------|--------------------------|---------|---------------------|------|------|----------------|---------------------------|----------------------|
|                          | 年利<br>%                         | 年利<br>% | 年利<br>%          | 年利<br>% | 年利<br>%    | 年利<br>% | 年利<br>%   | 年利<br>% | 年利<br>%       | 年利<br>% | 年利<br>%                  | 年利<br>% | 前日比<br>Change       |      |      |                |                           |                      |
| 24.09                    | ----                            | ----    | ----             | ----    | ----       | ----    | ----      | ----    | ----          | ----    | ----                     | ----    | ----                | ---- | ---- | 0              | ----                      | ----                 |
| 24.12                    | ----                            | ----    | ----             | ----    | ----       | ----    | ----      | ----    | ----          | ----    | ----                     | ----    | ----                | ---- | ---- | 0              | ----                      | ----                 |
| 25.03                    | ----                            | ----    | ----             | ----    | ----       | ----    | ----      | ----    | ----          | ----    | ----                     | ----    | ----                | ---- | ---- | 0              | ----                      | ----                 |
| 25.06                    | ----                            | ----    | ----             | ----    | ----       | ----    | ----      | ----    | ----          | ----    | ----                     | ----    | ----                | ---- | ---- | 0              | ----                      | ----                 |
| 25.09                    | ----                            | ----    | ----             | ----    | ----       | ----    | ----      | ----    | ----          | ----    | ----                     | ----    | ----                | ---- | ---- | 0              | ----                      | ----                 |
| 25.12                    | ----                            | ----    | ----             | ----    | ----       | ----    | ----      | ----    | ----          | ----    | ----                     | ----    | ----                | ---- | ---- | 0              | ----                      | ----                 |
| 26.03                    | ----                            | ----    | ----             | ----    | ----       | ----    | ----      | ----    | ----          | ----    | ----                     | ----    | ----                | ---- | ---- | 0              | ----                      | ----                 |
| 26.06                    | ----                            | ----    | ----             | ----    | ----       | ----    | ----      | ----    | ----          | ----    | ----                     | ----    | ----                | ---- | ---- | 0              | ----                      | ----                 |
| 26.09                    | ----                            | ----    | ----             | ----    | ----       | ----    | ----      | ----    | ----          | ----    | ----                     | ----    | ----                | ---- | ---- | 0              | ----                      | ----                 |
| 26.12                    | ----                            | ----    | ----             | ----    | ----       | ----    | ----      | ----    | ----          | ----    | ----                     | ----    | ----                | ---- | ---- | 0              | ----                      | ----                 |
| 27.03                    | ----                            | ----    | ----             | ----    | ----       | ----    | ----      | ----    | ----          | ----    | ----                     | ----    | ----                | ---- | ---- | 0              | ----                      | ----                 |
| 27.06                    | ----                            | ----    | ----             | ----    | ----       | ----    | ----      | ----    | ----          | ----    | ----                     | ----    | ----                | ---- | ---- | 0              | ----                      | ----                 |
| 27.09                    | ----                            | ----    | ----             | ----    | ----       | ----    | ----      | ----    | ----          | ----    | ----                     | ----    | ----                | ---- | ---- | 0              | ----                      | ----                 |
| 27.12                    | ----                            | ----    | ----             | ----    | ----       | ----    | ----      | ----    | ----          | ----    | ----                     | ----    | ----                | ---- | ---- | 0              | ----                      | ----                 |
| 28.03                    | ----                            | ----    | ----             | ----    | ----       | ----    | ----      | ----    | ----          | ----    | ----                     | ----    | ----                | ---- | ---- | 0              | ----                      | ----                 |
| 28.06                    | ----                            | ----    | ----             | ----    | ----       | ----    | ----      | ----    | ----          | ----    | ----                     | ----    | ----                | ---- | ---- | 0              | ----                      | ----                 |
| 28.09                    | ----                            | ----    | ----             | ----    | ----       | ----    | ----      | ----    | ----          | ----    | ----                     | ----    | ----                | ---- | ---- | 0              | ----                      | ----                 |
| 28.12                    | ----                            | ----    | ----             | ----    | ----       | ----    | ----      | ----    | ----          | ----    | ----                     | ----    | ----                | ---- | ---- | 0              | ----                      | ----                 |
| 29.03                    | ----                            | ----    | ----             | ----    | ----       | ----    | ----      | ----    | ----          | ----    | ----                     | ----    | ----                | ---- | ---- | 0              | ----                      | ----                 |
| 29.06                    | ----                            | ----    | ----             | ----    | ----       | ----    | ----      | ----    | ----          | ----    | ----                     | ----    | ----                | ---- | ---- | 0              | ----                      | ----                 |
| 計Totals                  | ----                            | ----    | ----             | ----    | ----       | ----    | ----      | ----    | ----          | ----    | ----                     | ----    | ----                | ---- | 0    | ----           | ----                      |                      |

東京金融取引所日報 (TFX DAILY STATISTICS REPORT)

発行所 (Issued by) 東京金融取引所 (Tokyo Financial Exchange Inc.)  
 所在地 (Registered Office) 東京都千代田区丸の内 1-8-2

1-8-2 Marunouchi, Chiyoda-ku, Tokyo 電話 (Telephone) 03-4578-2400 URL https://www.tfx.co.jp E-mail info@tfx.co.jp

- 1.破線----は該当なしを表示。(---- means not applicable.)
- 2.建玉数量、取引数量の単位は、1契約。(Unit of Open Int. and Volume is 1 contract.)
- 3.権利行使数量は当日の権利行使申告 (= 割当通知) に係る数量。(Exercise Volume is based on today's report.)
- 4.取引数量は、ストラテジー振替分を含む。(Volume includes Strategy.)
- 5.建玉数量は17:00時点のもの。(Open Int is as of 17:00.)

無担保コールオーバーナイト3ヵ月金利先物プットオプション

Put Options on Three-month TONA Futures

| 限月<br>Contract<br>Months | 権利行使<br>価格<br>Strike Price | 前日<br>清算価格<br>Settle.<br>(Previous Day) | 始値<br>Open Price | 高値<br>High | 安値<br>Low | 終値<br>Closing | 公式終値<br>Official Closing | 清算価格<br>Sett. Price |               | 取引数量<br>Volume | 建玉数量<br>Open Int. | 権利行使数量<br>Exercise<br>Volume | ボラティリティ<br>Volatility<br>% |
|--------------------------|----------------------------|---|------------------|------------|-----------|---------------|--------------------------|---------------------|---------------|----------------|-------------------|------------------------------|----------------------------|
|                          |                            |   |                  |            |           |               |                          |                     | 前日比<br>Change |                |                   |                              |                            |
| 24.09                    | 99.000                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.09                    | 99.125                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.09                    | 99.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.09                    | 99.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.09                    | 99.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.09                    | 99.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.09                    | 99.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.09                    | 99.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.09                    | 100.000                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.09                    | 100.125                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.09                    | 100.250                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.09                    | 100.375                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.09                    | 100.500                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.09                    | 100.625                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.12                    | 98.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.12                    | 99.000                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.12                    | 99.125                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.12                    | 99.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.12                    | 99.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.12                    | 99.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.12                    | 99.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.12                    | 99.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.12                    | 99.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.12                    | 100.000                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.12                    | 100.125                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.12                    | 100.250                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.12                    | 100.375                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.12                    | 100.500                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.12                    | 100.625                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.03                    | 98.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.03                    | 98.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 計 Totals                 | ----                       | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | ----           | ----              | ----                         | ----                       |

東京金融取引所日報 (TFX DAILY STATISTICS REPORT)

発行所 (Issued by) 東京金融取引所 (Tokyo Financial Exchange Inc.)

所在地 (Registered Office) 東京都千代田区丸の内 1-8-2

1-8-2 Marunouchi, Chiyoda-ku, Tokyo 電話 (Telephone) 03-4578-2400 URL https://www.tfx.co.jp E-mail info@tfx.co.jp

- 1.破線----は該当なしを表示。(---- means not applicable.)
- 2.建玉数量、取引数量の単位は、1契約。(Unit of Open Int. and Volume is 1 contract.)
- 3.権利行使数量は当日の権利行使申告 (= 割当通知) に係る数量。(Exercise Volume is based on today's report.)
- 4.取引数量は、ストラテジー振替分を含む。(Volume includes Strategy.)
- 5.建玉数量は17:00時点のもの。(Open Int is as of 17:00.)

無担保コールオーバーナイト3ヵ月金利先物プットオプション

Put Options on Three-month TONA Futures

| 限月<br>Contract<br>Months | 権利行使<br>価格<br>Strike Price | 前日<br>清算価格<br>Settle.<br>(Previous Day) | 始値<br>Open Price | 高値<br>High | 安値<br>Low | 終値<br>Closing | 公式終値<br>Official Closing | 清算価格<br>Sett. Price |               | 取引数量<br>Volume | 建玉数量<br>Open Int. | 権利行使数量<br>Exercise<br>Volume | ボラティリティ<br>Volatility<br>% |
|--------------------------|----------------------------|---|------------------|------------|-----------|---------------|--------------------------|---------------------|---------------|----------------|-------------------|------------------------------|----------------------------|
|                          |                            |   |                  |            |           |               |                          |                     | 前日比<br>Change |                |                   |                              |                            |
| 25.03                    | 99.000                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.03                    | 99.125                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.03                    | 99.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.03                    | 99.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.03                    | 99.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.03                    | 99.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.03                    | 99.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.03                    | 99.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.03                    | 100.000                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.03                    | 100.125                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.03                    | 100.250                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.03                    | 100.375                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.06                    | 98.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.06                    | 98.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.06                    | 98.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.06                    | 99.000                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.06                    | 99.125                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.06                    | 99.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.06                    | 99.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.06                    | 99.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.06                    | 99.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.06                    | 99.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.06                    | 99.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.06                    | 100.000                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.06                    | 100.125                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.06                    | 100.250                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.06                    | 100.375                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.09                    | 98.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.09                    | 98.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.09                    | 98.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.09                    | 99.000                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 計 Totals                 | ----                       | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | ----           | ----              | ----                         | ----                       |

東京金融取引所日報 (TFX DAILY STATISTICS REPORT)

発行所 (Issued by) 東京金融取引所 (Tokyo Financial Exchange Inc.)

所在地 (Registered Office) 東京都千代田区丸の内 1-8-2

1-8-2 Marunouchi, Chiyoda-ku, Tokyo 電話 (Telephone) 03-4578-2400 URL https://www.tfx.co.jp E-mail info@tfx.co.jp

- 1.破線----は該当なしを表示。(---- means not applicable.)
- 2.建玉数量、取引数量の単位は、1契約。(Unit of Open Int. and Volume is 1 contract.)
- 3.権利行使数量は当日の権利行使申告 (= 割当通知) に係る数量。(Exercise Volume is based on today's report.)
- 4.取引数量は、ストラテジー振替分を含む。(Volume includes Strategy.)
- 5.建玉数量は17:00時点のもの。(Open Int is as of 17:00.)

無担保コールオーバーナイト3ヵ月金利先物プットオプション

Put Options on Three-month TONA Futures

| 限月<br>Contract<br>Months | 権利行使<br>価格<br>Strike Price | 前日<br>清算価格<br>Settle.<br>(Previous Day) | 始値<br>Open Price | 高値<br>High | 安値<br>Low | 終値<br>Closing | 公式終値<br>Official Closing | 清算価格<br>Sett. Price |               | 取引数量<br>Volume | 建玉数量<br>Open Int. | 権利行使数量<br>Exercise<br>Volume | ボラティリティ<br>Volatility<br>% |
|--------------------------|----------------------------|---|------------------|------------|-----------|---------------|--------------------------|---------------------|---------------|----------------|-------------------|------------------------------|----------------------------|
|                          |                            |   |                  |            |           |               |                          |                     | 前日比<br>Change |                |                   |                              |                            |
| 25.09                    | 99.125                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.09                    | 99.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.09                    | 99.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.09                    | 99.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.09                    | 99.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.09                    | 99.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.09                    | 99.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.09                    | 100.000                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.09                    | 100.125                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.09                    | 100.250                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.09                    | 100.375                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 計Totals                  | ----                       | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | 0                 | 0                            | ----                       |

東京金融取引所日報 (TFX DAILY STATISTICS REPORT)

発行所 (Issued by) 東京金融取引所 (Tokyo Financial Exchange Inc.)

所在地 (Registered Office) 東京都千代田区丸の内 1-8-2

1-8-2 Marunouchi, Chiyoda-ku, Tokyo 電話 (Telephone) 03-4578-2400 URL https://www.tfx.co.jp E-mail info@tfx.co.jp

- 1.破線----は該当なしを表示。(---- means not applicable.)
- 2.建玉数量、取引数量の単位は、1契約。(Unit of Open Int. and Volume is 1 contract.)
- 3.権利行使数量は当日の権利行使申告 (= 割当通知) に係る数量。(Exercise Volume is based on today's report.)
- 4.建玉数量は17:00時点のもの。(Open Int is as of 17:00.)

無担保コールオーバーナイト3ヵ月金利先物プットオプション(ブロック取引分)

Put Options on Three-month TONA Futures (Block Trade)

| 限月<br>Contract<br>Months | 権利行使<br>価格<br>Strike Price | 前日<br>清算価格<br>Settle.<br>(Previous Day) | 始値<br>Open Price | 高値<br>High | 安値<br>Low | 終値<br>Closing | 公式終値<br>Official Closing | 清算価格<br>Sett. Price |               | 取引数量<br>Volume | 建玉数量<br>Open Int. | 権利行使数量<br>Exercise<br>Volume | ボラティリティ<br>Volatility<br>% |
|--------------------------|----------------------------|---|------------------|------------|-----------|---------------|--------------------------|---------------------|---------------|----------------|-------------------|------------------------------|----------------------------|
|                          |                            |   |                  |            |           |               |                          |                     | 前日比<br>Change |                |                   |                              |                            |
| 24.09                    | 99.000                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.09                    | 99.125                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.09                    | 99.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.09                    | 99.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.09                    | 99.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.09                    | 99.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.09                    | 99.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.09                    | 99.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.09                    | 100.000                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.09                    | 100.125                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.09                    | 100.250                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.09                    | 100.375                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.09                    | 100.500                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.09                    | 100.625                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.12                    | 98.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.12                    | 99.000                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.12                    | 99.125                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.12                    | 99.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.12                    | 99.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.12                    | 99.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.12                    | 99.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.12                    | 99.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.12                    | 99.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.12                    | 100.000                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.12                    | 100.125                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.12                    | 100.250                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.12                    | 100.375                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.12                    | 100.500                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.12                    | 100.625                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.03                    | 98.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.03                    | 98.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 計Totals                  | ----                       | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | ----           | ----              | ----                         | ----                       |

東京金融取引所日報 (TFX DAILY STATISTICS REPORT)

発行所 (Issued by) 東京金融取引所 (Tokyo Financial Exchange Inc.)

所在地 (Registered Office) 東京都千代田区丸の内 1-8-2

1-8-2 Marunouchi, Chiyoda-ku, Tokyo 電話 (Telephone) 03-4578-2400 URL https://www.tfx.co.jp E-mail info@tfx.co.jp

- 1.破線----は該当なしを表示。(---- means not applicable.)
- 2.建玉数量、取引数量の単位は、1契約。(Unit of Open Int. and Volume is 1 contract.)
- 3.権利行使数量は当日の権利行使申告 (= 割当通知) に係る数量。(Exercise Volume is based on today's report.)
- 4.建玉数量は17:00時点のもの。(Open Int is as of 17:00.)

無担保コールオーバーナイト3ヵ月金利先物プットオプション(ブロック取引分)

Put Options on Three-month TONA Futures (Block Trade)

| 限月<br>Contract<br>Months | 権利行使<br>価格<br>Strike Price | 前日<br>清算価格<br>Settle.<br>(Previous Day) | 始値<br>Open Price | 高値<br>High | 安値<br>Low | 終値<br>Closing | 公式終値<br>Official Closing | 清算価格<br>Sett. Price |               | 取引数量<br>Volume | 建玉数量<br>Open Int. | 権利行使数量<br>Exercise<br>Volume | ボラティリティ<br>Volatility<br>% |
|--------------------------|----------------------------|---|------------------|------------|-----------|---------------|--------------------------|---------------------|---------------|----------------|-------------------|------------------------------|----------------------------|
|                          |                            |   |                  |            |           |               |                          |                     | 前日比<br>Change |                |                   |                              |                            |
| 25.03                    | 99.000                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.03                    | 99.125                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.03                    | 99.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.03                    | 99.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.03                    | 99.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.03                    | 99.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.03                    | 99.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.03                    | 99.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.03                    | 100.000                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.03                    | 100.125                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.03                    | 100.250                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.03                    | 100.375                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.06                    | 98.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.06                    | 98.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.06                    | 98.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.06                    | 99.000                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.06                    | 99.125                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.06                    | 99.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.06                    | 99.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.06                    | 99.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.06                    | 99.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.06                    | 99.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.06                    | 99.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.06                    | 100.000                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.06                    | 100.125                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.06                    | 100.250                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.06                    | 100.375                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.09                    | 98.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.09                    | 98.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.09                    | 98.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.09                    | 99.000                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 計Totals                  | ----                       | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | ----           | ----              | ----                         | ----                       |

東京金融取引所日報 (TFX DAILY STATISTICS REPORT)

発行所 (Issued by) 東京金融取引所 (Tokyo Financial Exchange Inc.)

所在地 (Registered Office) 東京都千代田区丸の内 1-8-2

1-8-2 Marunouchi, Chiyoda-ku, Tokyo 電話 (Telephone) 03-4578-2400 URL https://www.tfx.co.jp E-mail info@tfx.co.jp

- 1.破線----は該当なしを表示。(---- means not applicable.)
- 2.建玉数量、取引数量の単位は、1契約。(Unit of Open Int. and Volume is 1 contract.)
- 3.権利行使数量は当日の権利行使申告 (= 割当通知) に係る数量。(Exercise Volume is based on today's report.)
- 4.建玉数量は17:00時点のもの。(Open Int is as of 17:00.)

無担保コールオーバーナイト3ヵ月金利先物プットオプション(ブロック取引分)

Put Options on Three-month TONA Futures (Block Trade)

| 限月<br>Contract<br>Months | 権利行使<br>価格<br>Strike Price | 前日<br>清算価格<br>Settle.<br>(Previous Day) | 始値<br>Open Price | 高値<br>High | 安値<br>Low | 終値<br>Closing | 公式終値<br>Official Closing | 清算価格<br>Sett. Price |               | 取引数量<br>Volume | 建玉数量<br>Open Int. | 権利行使数量<br>Exercise<br>Volume | ボラティリティ<br>Volatility<br>% |
|--------------------------|----------------------------|---|------------------|------------|-----------|---------------|--------------------------|---------------------|---------------|----------------|-------------------|------------------------------|----------------------------|
|                          |                            |   |                  |            |           |               |                          |                     | 前日比<br>Change |                |                   |                              |                            |
| 25.09                    | 99.125                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.09                    | 99.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.09                    | 99.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.09                    | 99.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.09                    | 99.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.09                    | 99.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.09                    | 99.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.09                    | 100.000                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.09                    | 100.125                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.09                    | 100.250                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.09                    | 100.375                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 計Totals                  | ----                       | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |



東京金融取引所日報 (TFX DAILY STATISTICS REPORT)

発行所 (Issued by) 東京金融取引所 (Tokyo Financial Exchange Inc.)

所在地 (Registered Office) 東京都千代田区丸の内 1-8-2

1-8-2 Marunouchi, Chiyoda-ku, Tokyo 電話 (Telephone) 03-4578-2400 URL https://www.tfx.co.jp E-mail info@tfx.co.jp

- 1.破線----は該当なしを表示。(---- means not applicable.)
- 2.建玉数量、取引数量の単位は、1契約。(Unit of Open Int. and Volume is 1 contract.)
- 3.権利行使数量は当日の権利行使申告 (= 割当通知) に係る数量。(Exercise Volume is based on today's report.)
- 4.取引数量は、ストラテジー振替分を含む。(Volume includes Strategy.)
- 5.建玉数量は17:00時点のもの。(Open Int is as of 17:00.)

無担保コールオーバーナイト3ヵ月金利先物コールオプション

Call Options on Three-month TONA Futures

| 限月<br>Contract<br>Months | 権利行使<br>価格<br>Strike Price | 前日<br>清算価格<br>Settle.<br>(Previous Day) | 始値<br>Open Price | 高値<br>High | 安値<br>Low | 終値<br>Closing | 公式終値<br>Official Closing | 清算価格<br>Sett. Price |               | 取引数量<br>Volume | 建玉数量<br>Open Int. | 権利行使数量<br>Exercise<br>Volume | ボラティリティ<br>Volatility<br>% |
|--------------------------|----------------------------|---|------------------|------------|-----------|---------------|--------------------------|---------------------|---------------|----------------|-------------------|------------------------------|----------------------------|
|                          |                            |   |                  |            |           |               |                          |                     | 前日比<br>Change |                |                   |                              |                            |
| 24.09                    | 99.000                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.09                    | 99.125                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.09                    | 99.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.09                    | 99.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.09                    | 99.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.09                    | 99.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.09                    | 99.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.09                    | 99.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.09                    | 100.000                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.09                    | 100.125                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.09                    | 100.250                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.09                    | 100.375                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.09                    | 100.500                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.09                    | 100.625                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.12                    | 98.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.12                    | 99.000                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.12                    | 99.125                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.12                    | 99.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.12                    | 99.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.12                    | 99.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.12                    | 99.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.12                    | 99.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.12                    | 99.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.12                    | 100.000                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.12                    | 100.125                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.12                    | 100.250                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.12                    | 100.375                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.12                    | 100.500                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 24.12                    | 100.625                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.03                    | 98.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.03                    | 98.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 計 Totals                 | ----                       | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | ----           | ----              | ----                         | ----                       |

東京金融取引所日報 (TFX DAILY STATISTICS REPORT)

発行所 (Issued by) 東京金融取引所 (Tokyo Financial Exchange Inc.)

所在地 (Registered Office) 東京都千代田区丸の内 1-8-2

1-8-2 Marunouchi, Chiyoda-ku, Tokyo 電話 (Telephone) 03-4578-2400 URL https://www.tfx.co.jp E-mail info@tfx.co.jp

- 1.破線----は該当なしを表示。(---- means not applicable.)
- 2.建玉数量、取引数量の単位は、1契約。(Unit of Open Int. and Volume is 1 contract.)
- 3.権利行使数量は当日の権利行使申告 (= 割当通知) に係る数量。(Exercise Volume is based on today's report.)
- 4.取引数量は、ストラテジー振替分を含む。(Volume includes Strategy.)
- 5.建玉数量は17:00時点のもの。(Open Int is as of 17:00.)

無担保コールオーバーナイト3ヵ月金利先物コールオプション

Call Options on Three-month TONA Futures

| 限月<br>Contract<br>Months | 権利行使<br>価格<br>Strike Price | 前日<br>清算価格<br>Settle.<br>(Previous Day) | 始値<br>Open Price | 高値<br>High | 安値<br>Low | 終値<br>Closing | 公式終値<br>Official Closing | 清算価格<br>Sett. Price |               | 取引数量<br>Volume | 建玉数量<br>Open Int. | 権利行使数量<br>Exercise<br>Volume | ボラティリティ<br>Volatility<br>% |
|--------------------------|----------------------------|---|------------------|------------|-----------|---------------|--------------------------|---------------------|---------------|----------------|-------------------|------------------------------|----------------------------|
|                          |                            |   |                  |            |           |               |                          |                     | 前日比<br>Change |                |                   |                              |                            |
| 25.03                    | 99.000                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.03                    | 99.125                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.03                    | 99.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.03                    | 99.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.03                    | 99.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.03                    | 99.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.03                    | 99.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.03                    | 99.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.03                    | 100.000                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.03                    | 100.125                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.03                    | 100.250                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.03                    | 100.375                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.06                    | 98.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.06                    | 98.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.06                    | 98.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.06                    | 99.000                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.06                    | 99.125                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.06                    | 99.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.06                    | 99.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.06                    | 99.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.06                    | 99.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.06                    | 99.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.06                    | 99.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.06                    | 100.000                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.06                    | 100.125                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.06                    | 100.250                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.06                    | 100.375                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.09                    | 98.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.09                    | 98.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.09                    | 98.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.09                    | 99.000                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 計Totals                  | ----                       | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | ----           | ----              | ----                         | ----                       |

東京金融取引所日報 (TFX DAILY STATISTICS REPORT)

発行所 (Issued by) 東京金融取引所 (Tokyo Financial Exchange Inc.)

所在地 (Registered Office) 東京都千代田区丸の内 1-8-2

1-8-2 Marunouchi, Chiyoda-ku, Tokyo 電話 (Telephone) 03-4578-2400 URL https://www.tfx.co.jp E-mail info@tfx.co.jp

- 1.破線----は該当なしを表示。(---- means not applicable.)
- 2.建玉数量、取引数量の単位は、1契約。(Unit of Open Int. and Volume is 1 contract.)
- 3.権利行使数量は当日の権利行使申告 (= 割当通知) に係る数量。(Exercise Volume is based on today's report.)
- 4.取引数量は、ストラテジー振替分を含む。(Volume includes Strategy.)
- 5.建玉数量は17:00時点のもの。(Open Int is as of 17:00.)

無担保コールオーバーナイト3ヵ月金利先物コールオプション

Call Options on Three-month TONA Futures

| 限月<br>Contract<br>Months | 権利行使<br>価格<br>Strike Price | 前日<br>清算価格<br>Settle.<br>(Previous Day) | 始値<br>Open Price | 高値<br>High | 安値<br>Low | 終値<br>Closing | 公式終値<br>Official Closing | 清算価格<br>Sett. Price |               | 取引数量<br>Volume | 建玉数量<br>Open Int. | 権利行使数量<br>Exercise<br>Volume | ボラティリティ<br>Volatility<br>% |
|--------------------------|----------------------------|---|------------------|------------|-----------|---------------|--------------------------|---------------------|---------------|----------------|-------------------|------------------------------|----------------------------|
|                          |                            |   |                  |            |           |               |                          |                     | 前日比<br>Change |                |                   |                              |                            |
| 25.09                    | 99.125                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.09                    | 99.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.09                    | 99.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.09                    | 99.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.09                    | 99.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.09                    | 99.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.09                    | 99.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.09                    | 100.000                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.09                    | 100.125                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.09                    | 100.250                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.09                    | 100.375                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 計 Totals                 | ----                       | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | 0                 | 0                            | ----                       |

東京金融取引所日報 (TFX DAILY STATISTICS REPORT)

発行所 (Issued by) 東京金融取引所 (Tokyo Financial Exchange Inc.)

所在地 (Registered Office) 東京都千代田区丸の内 1-8-2

1-8-2 Marunouchi, Chiyoda-ku, Tokyo 電話 (Telephone) 03-4578-2400 URL https://www.tfx.co.jp E-mail info@tfx.co.jp

- 1.破線----は該当なしを表示。(---- means not applicable.)
- 2.建玉数量、取引数量の単位は、1契約。(Unit of Open Int. and Volume is 1 contract.)
- 3.権利行使数量は当日の権利行使申告 (= 割当通知) に係る数量。(Exercise Volume is based on today's report.)
- 4.建玉数量は17:00時点のもの。(Open Int is as of 17:00.)

無担保コールオーバーナイト3ヵ月金利先物コールオプション(ブロック取引分)

Call Options on Three-month TONA Futures (Block Trade)

| 限月<br>Contract<br>Months | 権利行使<br>価格<br>Strike Price | 前日<br>清算価格<br>Settle.<br>(Previous Day) | 始値<br>Open Price | 高値<br>High | 安値<br>Low | 終値<br>Closing | 公式終値<br>Official Closing | 清算価格<br>Sett. Price |               | 取引数量<br>Volume | 建玉数量<br>Open Int. | 権利行使数量<br>Exercise<br>Volume | ボラティリティ<br>Volatility<br>% |
|--------------------------|----------------------------|---|------------------|------------|-----------|---------------|--------------------------|---------------------|---------------|----------------|-------------------|------------------------------|----------------------------|
|                          |                            |   |                  |            |           |               |                          |                     | 前日比<br>Change |                |                   |                              |                            |
| 24.09                    | 99.000                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.09                    | 99.125                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.09                    | 99.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.09                    | 99.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.09                    | 99.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.09                    | 99.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.09                    | 99.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.09                    | 99.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.09                    | 100.000                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.09                    | 100.125                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.09                    | 100.250                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.09                    | 100.375                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.09                    | 100.500                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.09                    | 100.625                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.12                    | 98.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.12                    | 99.000                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.12                    | 99.125                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.12                    | 99.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.12                    | 99.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.12                    | 99.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.12                    | 99.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.12                    | 99.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.12                    | 99.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.12                    | 100.000                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.12                    | 100.125                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.12                    | 100.250                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.12                    | 100.375                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.12                    | 100.500                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 24.12                    | 100.625                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.03                    | 98.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.03                    | 98.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 計Totals                  | ----                       | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | ----           | ----              | ----                         | ----                       |

東京金融取引所日報 (TFX DAILY STATISTICS REPORT)

発行所 (Issued by) 東京金融取引所 (Tokyo Financial Exchange Inc.)

所在地 (Registered Office) 東京都千代田区丸の内 1-8-2

1-8-2 Marunouchi, Chiyoda-ku, Tokyo 電話 (Telephone) 03-4578-2400 URL https://www.tfx.co.jp E-mail info@tfx.co.jp

- 1.破線----は該当なしを表示。(---- means not applicable.)
- 2.建玉数量、取引数量の単位は、1契約。(Unit of Open Int. and Volume is 1 contract.)
- 3.権利行使数量は当日の権利行使申告 (= 割当通知) に係る数量。(Exercise Volume is based on today's report.)
- 4.建玉数量は17:00時点のもの。(Open Int is as of 17:00.)

無担保コールオーバーナイト3ヵ月金利先物コールオプション(ブロック取引分)

Call Options on Three-month TONA Futures (Block Trade)

| 限月<br>Contract<br>Months | 権利行使<br>価格<br>Strike Price | 前日<br>清算価格<br>Settle.<br>(Previous Day) | 始値<br>Open Price | 高値<br>High | 安値<br>Low | 終値<br>Closing | 公式終値<br>Official Closing | 清算価格<br>Sett. Price |               | 取引数量<br>Volume | 建玉数量<br>Open Int. | 権利行使数量<br>Exercise<br>Volume | ボラティリティ<br>Volatility<br>% |
|--------------------------|----------------------------|---|------------------|------------|-----------|---------------|--------------------------|---------------------|---------------|----------------|-------------------|------------------------------|----------------------------|
|                          |                            |   |                  |            |           |               |                          |                     | 前日比<br>Change |                |                   |                              |                            |
| 25.03                    | 99.000                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.03                    | 99.125                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.03                    | 99.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.03                    | 99.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.03                    | 99.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.03                    | 99.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.03                    | 99.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.03                    | 99.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.03                    | 100.000                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.03                    | 100.125                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.03                    | 100.250                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.03                    | 100.375                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.06                    | 98.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.06                    | 98.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.06                    | 98.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.06                    | 99.000                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.06                    | 99.125                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.06                    | 99.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.06                    | 99.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.06                    | 99.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.06                    | 99.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.06                    | 99.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.06                    | 99.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.06                    | 100.000                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.06                    | 100.125                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.06                    | 100.250                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.06                    | 100.375                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.09                    | 98.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.09                    | 98.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.09                    | 98.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.09                    | 99.000                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 計 Totals                 | ----                       | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | ----           | ----              | ----                         | ----                       |

東京金融取引所日報 (TFX DAILY STATISTICS REPORT)

発行所 (Issued by) 東京金融取引所 (Tokyo Financial Exchange Inc.)

所在地 (Registered Office) 東京都千代田区丸の内 1-8-2

1-8-2 Marunouchi, Chiyoda-ku, Tokyo 電話 (Telephone) 03-4578-2400 URL https://www.tfx.co.jp E-mail info@tfx.co.jp

- 1.破線----は該当なしを表示。(---- means not applicable.)
- 2.建玉数量、取引数量の単位は、1契約。(Unit of Open Int. and Volume is 1 contract.)
- 3.権利行使数量は当日の権利行使申告 (= 割当通知) に係る数量。(Exercise Volume is based on today's report.)
- 4.建玉数量は17:00時点のもの。(Open Int is as of 17:00.)

無担保コールオーバーナイト3ヵ月金利先物コールオプション(ブロック取引分)

Call Options on Three-month TONA Futures (Block Trade)

| 限月<br>Contract<br>Months | 権利行使<br>価格<br>Strike Price | 前日<br>清算価格<br>Settle.<br>(Previous Day) | 始値<br>Open Price | 高値<br>High | 安値<br>Low | 終値<br>Closing | 公式終値<br>Official Closing | 清算価格<br>Sett. Price |               | 取引数量<br>Volume | 建玉数量<br>Open Int. | 権利行使数量<br>Exercise<br>Volume | ボラティリティ<br>Volatility<br>% |
|--------------------------|----------------------------|---|------------------|------------|-----------|---------------|--------------------------|---------------------|---------------|----------------|-------------------|------------------------------|----------------------------|
|                          |                            |   |                  |            |           |               |                          |                     | 前日比<br>Change |                |                   |                              |                            |
| 25.09                    | 99.125                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.09                    | 99.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.09                    | 99.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.09                    | 99.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.09                    | 99.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.09                    | 99.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.09                    | 99.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.09                    | 100.000                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.09                    | 100.125                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.09                    | 100.250                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.09                    | 100.375                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 計Totals                  | ----                       | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |