

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.)

4.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.

3.取引数量は、ストラテジー振替分を含む。(Volume includes Strategy.)

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 |        |                |                           |                      |
| 25.12                    | 99.284                          | 0.716 | ----             | ----  | ----       | ----  | ----      | ----  | ----          | ----  | 99.284                   | 0.716 | 99.284              | 0.716         | 0.000  | 0              | 0                         | 152                  |
| 26.03                    | 99.160                          | 0.840 | 99.161           | 0.839 | 99.161     | 0.839 | 99.158    | 0.842 | 99.158        | 0.842 | 99.158                   | 0.842 | 99.161              | 0.839         | 0.001  | 1,651          | 0                         | 329                  |
| 26.06                    | 99.001                          | 0.999 | ----             | ----  | ----       | ----  | ----      | ----  | ----          | ----  | 98.993                   | 1.007 | 99.002              | 0.998         | 0.001  | 0              | 0                         | 314                  |
| 26.09                    | 98.857                          | 1.143 | ----             | ----  | ----       | ----  | ----      | ----  | ----          | ----  | 98.845                   | 1.155 | 98.854              | 1.146         | -0.003 | 0              | 0                         | 753                  |
| 26.12                    | 98.711                          | 1.289 | ----             | ----  | ----       | ----  | ----      | ----  | ----          | ----  | 98.699                   | 1.301 | 98.708              | 1.292         | -0.003 | 0              | 0                         | 140                  |
| 27.03                    | 98.606                          | 1.394 | ----             | ----  | ----       | ----  | ----      | ----  | ----          | ----  | 98.594                   | 1.406 | 98.603              | 1.397         | -0.003 | 0              | 0                         | 0                    |
| 27.06                    | 98.502                          | 1.498 | ----             | ----  | ----       | ----  | ----      | ----  | ----          | ----  | 98.490                   | 1.510 | 98.499              | 1.501         | -0.003 | 0              | 0                         | 0                    |
| 27.09                    | 98.402                          | 1.598 | ----             | ----  | ----       | ----  | ----      | ----  | ----          | ----  | 98.390                   | 1.610 | 98.399              | 1.601         | -0.003 | 0              | 0                         | 0                    |
| 27.12                    | 98.356                          | 1.644 | ----             | ----  | ----       | ----  | ----      | ----  | ----          | ----  | 98.333                   | 1.667 | 98.342              | 1.658         | -0.014 | 0              | 0                         | 0                    |
| 28.03                    | 98.322                          | 1.678 | ----             | ----  | ----       | ----  | ----      | ----  | ----          | ----  | 98.294                   | 1.706 | 98.303              | 1.697         | -0.019 | 0              | 0                         | 0                    |
| 28.06                    | 98.294                          | 1.706 | ----             | ----  | ----       | ----  | ----      | ----  | ----          | ----  | 98.262                   | 1.738 | 98.271              | 1.729         | -0.023 | 0              | 0                         | 0                    |
| 28.09                    | 98.267                          | 1.733 | ----             | ----  | ----       | ----  | ----      | ----  | ----          | ----  | 98.231                   | 1.769 | 98.240              | 1.760         | -0.027 | 0              | 0                         | 0                    |
| 28.12                    | 98.232                          | 1.768 | ----             | ----  | ----       | ----  | ----      | ----  | ----          | ----  | 98.196                   | 1.804 | 98.205              | 1.795         | -0.027 | 0              | 0                         | 0                    |
| 29.03                    | 98.195                          | 1.805 | ----             | ----  | ----       | ----  | ----      | ----  | ----          | ----  | 98.159                   | 1.841 | 98.168              | 1.832         | -0.027 | 0              | 0                         | 0                    |
| 29.06                    | 98.160                          | 1.840 | ----             | ----  | ----       | ----  | ----      | ----  | ----          | ----  | 98.126                   | 1.874 | 98.135              | 1.865         | -0.025 | 0              | 0                         | 0                    |
| 29.09                    | 98.128                          | 1.872 | ----             | ----  | ----       | ----  | ----      | ----  | ----          | ----  | 98.096                   | 1.904 | 98.105              | 1.895         | -0.023 | 0              | 0                         | 0                    |
| 29.12                    | 98.098                          | 1.902 | ----             | ----  | ----       | ----  | ----      | ----  | ----          | ----  | 98.068                   | 1.932 | 98.077              | 1.923         | -0.021 | 0              | 0                         | 0                    |
| 30.03                    | 98.069                          | 1.931 | ----             | ----  | ----       | ----  | ----      | ----  | ----          | ----  | 98.041                   | 1.959 | 98.050              | 1.950         | -0.019 | 0              | 0                         | 0                    |
| 30.06                    | 98.040                          | 1.960 | ----             | ----  | ----       | ----  | ----      | ----  | ----          | ----  | 98.013                   | 1.987 | 98.022              | 1.978         | -0.018 | 0              | 0                         | 0                    |
| 30.09                    | 98.010                          | 1.990 | ----             | ----  | ----       | ----  | ----      | ----  | ----          | ----  | 97.982                   | 2.018 | 97.991              | 2.009         | -0.019 | 0              | 0                         | 0                    |
| 計Totals                  | ----                            | ----  | ----             | ----  | ----       | ----  | ----      | ----  | ----          | ----  | ----                     | ----  | ----                | ----          | ----   | 1,651          | 0                         | 1,688                |

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>%                         | 前日比<br>Change | 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>%                  |      |                        |      |                   |                           |                         |
| 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                 | ----                      | ----                    |
| 29.09                    | ----                            | ----          | ----              | ----    | ----        | ----    | ----       | ----    | ----           | ----    | ----                     | ---- | ----                   | ---- | 0                 | ----                      | ----                    |
| 29.12                    | ----                            | ----          | ----              | ----    | ----        | ----    | ----       | ----    | ----           | ----    | ----                     | ---- | ----                   | ---- | 0                 | ----                      | ----                    |
| 30.03                    | ----                            | ----          | ----              | ----    | ----        | ----    | ----       | ----    | ----           | ----    | ----                     | ---- | ----                   | ---- | 0                 | ----                      | ----                    |
| 30.06                    | ----                            | ----          | ----              | ----    | ----        | ----    | ----       | ----    | ----           | ----    | ----                     | ---- | ----                   | ---- | 0                 | ----                      | ----                    |
| 30.09                    | ----                            | ----          | ----              | ----    | ----        | ----    | ----       | ----    | ----           | ----    | ----                     | ---- | ----                   | ---- | 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 |                |                   |                              |                            |
| 25.12                    | 98.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.12                    | 98.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.12                    | 98.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.12                    | 98.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.12                    | 98.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.12                    | 99.000                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.12                    | 99.125                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.12                    | 99.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.12                    | 99.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.12                    | 99.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.12                    | 99.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.12                    | 99.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.12                    | 99.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.12                    | 100.000                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.12                    | 100.125                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 98.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 98.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 98.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 98.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 98.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 98.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 99.000                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 99.125                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 99.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 99.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 99.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 99.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 99.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 99.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 100.000                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 100.125                    | 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 |                |                   |                              |                            |
| 26.06                    | 98.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.06                    | 98.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.06                    | 98.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.06                    | 98.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.06                    | 98.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.06                    | 98.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.06                    | 99.000                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.06                    | 99.125                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.06                    | 99.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.06                    | 99.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.06                    | 99.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.06                    | 99.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.06                    | 99.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.06                    | 99.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.06                    | 100.000                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.09                    | 98.125                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.09                    | 98.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.09                    | 98.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.09                    | 98.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.09                    | 98.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.09                    | 98.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.09                    | 98.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.09                    | 99.000                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.09                    | 99.125                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.09                    | 99.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.09                    | 99.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.09                    | 99.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.09                    | 99.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.09                    | 99.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.09                    | 99.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.12                    | 98.000                     | 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 |                |                   |                              |                            |
| 26.12                    | 98.125                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.12                    | 98.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.12                    | 98.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.12                    | 98.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.12                    | 98.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.12                    | 98.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.12                    | 98.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.12                    | 99.000                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.12                    | 99.125                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.12                    | 99.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.12                    | 99.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.12                    | 99.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.12                    | 99.625                     | 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 |                |                   |                              |                            |
| 25.12                    | 98.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.12                    | 98.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.12                    | 98.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.12                    | 98.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.12                    | 98.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.12                    | 99.000                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.12                    | 99.125                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.12                    | 99.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.12                    | 99.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.12                    | 99.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.12                    | 99.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.12                    | 99.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.12                    | 99.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.12                    | 100.000                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.12                    | 100.125                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 98.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 98.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 98.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 98.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 98.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 98.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 99.000                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 99.125                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 99.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 99.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 99.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 99.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 99.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 99.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 100.000                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 100.125                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 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 |                |                   |                              |                            |
| 26.06                    | 98.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.06                    | 98.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.06                    | 98.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.06                    | 98.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.06                    | 98.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.06                    | 98.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.06                    | 99.000                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.06                    | 99.125                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.06                    | 99.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.06                    | 99.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.06                    | 99.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.06                    | 99.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.06                    | 99.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.06                    | 99.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.06                    | 100.000                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.09                    | 98.125                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.09                    | 98.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.09                    | 98.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.09                    | 98.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.09                    | 98.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.09                    | 98.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.09                    | 98.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.09                    | 99.000                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.09                    | 99.125                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.09                    | 99.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.09                    | 99.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.09                    | 99.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.09                    | 99.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.09                    | 99.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.09                    | 99.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.12                    | 98.000                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 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 |                |                   |                              |                            |
| 26.12                    | 98.125                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.12                    | 98.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.12                    | 98.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.12                    | 98.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.12                    | 98.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.12                    | 98.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.12                    | 98.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.12                    | 99.000                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.12                    | 99.125                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.12                    | 99.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.12                    | 99.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.12                    | 99.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.12                    | 99.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 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 |                |                   |                              |                            |
| 25.12                    | 98.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.12                    | 98.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.12                    | 98.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.12                    | 98.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.12                    | 98.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.12                    | 99.000                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.12                    | 99.125                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.12                    | 99.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.12                    | 99.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.12                    | 99.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.12                    | 99.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.12                    | 99.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.12                    | 99.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.12                    | 100.000                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 25.12                    | 100.125                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 98.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 98.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 98.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 98.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 98.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 98.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 99.000                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 99.125                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 99.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 99.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 99.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 99.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 99.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 99.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 100.000                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.03                    | 100.125                    | 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 |                |                   |                              |                            |
| 26.06                    | 98.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.06                    | 98.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.06                    | 98.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.06                    | 98.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.06                    | 98.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.06                    | 98.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.06                    | 99.000                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.06                    | 99.125                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.06                    | 99.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.06                    | 99.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.06                    | 99.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.06                    | 99.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.06                    | 99.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.06                    | 99.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.06                    | 100.000                    | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.09                    | 98.125                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.09                    | 98.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.09                    | 98.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.09                    | 98.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.09                    | 98.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.09                    | 98.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.09                    | 98.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.09                    | 99.000                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.09                    | 99.125                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.09                    | 99.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.09                    | 99.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.09                    | 99.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.09                    | 99.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.09                    | 99.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.09                    | 99.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.12                    | 98.000                     | 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 |                |                   |                              |                            |
| 26.12                    | 98.125                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.12                    | 98.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.12                    | 98.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.12                    | 98.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.12                    | 98.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.12                    | 98.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.12                    | 98.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.12                    | 99.000                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.12                    | 99.125                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.12                    | 99.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.12                    | 99.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.12                    | 99.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 26.12                    | 99.625                     | 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 |                |                   |                              |                            |
| 25.12                    | 98.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.12                    | 98.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.12                    | 98.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.12                    | 98.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.12                    | 98.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.12                    | 99.000                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.12                    | 99.125                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.12                    | 99.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.12                    | 99.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.12                    | 99.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.12                    | 99.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.12                    | 99.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.12                    | 99.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.12                    | 100.000                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 25.12                    | 100.125                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 98.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 98.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 98.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 98.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 98.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 98.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 99.000                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 99.125                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 99.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 99.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 99.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 99.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 99.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 99.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 100.000                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.03                    | 100.125                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 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 |                |                   |                              |                            |
| 26.06                    | 98.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.06                    | 98.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.06                    | 98.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.06                    | 98.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.06                    | 98.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.06                    | 98.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.06                    | 99.000                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.06                    | 99.125                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.06                    | 99.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.06                    | 99.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.06                    | 99.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.06                    | 99.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.06                    | 99.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.06                    | 99.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.06                    | 100.000                    | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.09                    | 98.125                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.09                    | 98.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.09                    | 98.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.09                    | 98.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.09                    | 98.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.09                    | 98.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.09                    | 98.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.09                    | 99.000                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.09                    | 99.125                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.09                    | 99.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.09                    | 99.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.09                    | 99.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.09                    | 99.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.09                    | 99.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.09                    | 99.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.12                    | 98.000                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 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 |                |                   |                              |                            |
| 26.12                    | 98.125                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.12                    | 98.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.12                    | 98.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.12                    | 98.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.12                    | 98.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.12                    | 98.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.12                    | 98.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.12                    | 99.000                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.12                    | 99.125                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.12                    | 99.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.12                    | 99.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.12                    | 99.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.12                    | 99.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 計 Totals                 | ----                       | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |