

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. |
|--------------------------|---------------------------------|--------------|------------------|--------------|------------|--------------|-----------|--------------|---------------|--------------|--------------------------|--------------|---------------------|---------------|-------|----------------|---------------------------|----------------------|
|                          |                                 | *<br>年利<br>% |                  | *<br>年利<br>% |            | *<br>年利<br>% |           | *<br>年利<br>% |               | *<br>年利<br>% |                          | *<br>年利<br>% | 年利<br>%             | 前日比<br>Change |       |                |                           |                      |
| 26.03                    | 99.240                          | 0.760        | ----             | ----         | ----       | ----         | ----      | ----         | ----          | ----         | 99.240                   | 0.760        | 99.240              | 0.760         | 0.000 | 0              | 0                         | 261                  |
| 26.06                    | 99.050                          | 0.950        | ----             | ----         | ----       | ----         | ----      | ----         | ----          | ----         | 99.050                   | 0.950        | 99.050              | 0.950         | 0.000 | 500            | 0                         | 361                  |
| 26.09                    | 98.893                          | 1.107        | ----             | ----         | ----       | ----         | ----      | ----         | ----          | ----         | 98.895                   | 1.105        | 98.895              | 1.105         | 0.002 | 500            | 0                         | 753                  |
| 26.12                    | 98.762                          | 1.238        | ----             | ----         | ----       | ----         | ----      | ----         | ----          | ----         | 98.764                   | 1.236        | 98.764              | 1.236         | 0.002 | 0              | 0                         | 71                   |
| 27.03                    | 98.602                          | 1.398        | ----             | ----         | ----       | ----         | ----      | ----         | ----          | ----         | 98.604                   | 1.396        | 98.604              | 1.396         | 0.002 | 0              | 0                         | 0                    |
| 27.06                    | 98.475                          | 1.525        | ----             | ----         | ----       | ----         | ----      | ----         | ----          | ----         | 98.482                   | 1.518        | 98.482              | 1.518         | 0.007 | 0              | 0                         | 0                    |
| 27.09                    | 98.348                          | 1.652        | ----             | ----         | ----       | ----         | ----      | ----         | ----          | ----         | 98.360                   | 1.640        | 98.360              | 1.640         | 0.012 | 0              | 0                         | 0                    |
| 27.12                    | 98.235                          | 1.765        | ----             | ----         | ----       | ----         | ----      | ----         | ----          | ----         | 98.246                   | 1.754        | 98.246              | 1.754         | 0.011 | 0              | 0                         | 0                    |
| 28.03                    | 98.165                          | 1.835        | ----             | ----         | ----       | ----         | ----      | ----         | ----          | ----         | 98.175                   | 1.825        | 98.175              | 1.825         | 0.010 | 0              | 0                         | 0                    |
| 28.06                    | 98.126                          | 1.874        | ----             | ----         | ----       | ----         | ----      | ----         | ----          | ----         | 98.134                   | 1.866        | 98.134              | 1.866         | 0.008 | 0              | 0                         | 0                    |
| 28.09                    | 98.094                          | 1.906        | ----             | ----         | ----       | ----         | ----      | ----         | ----          | ----         | 98.102                   | 1.898        | 98.102              | 1.898         | 0.008 | 0              | 0                         | 0                    |
| 28.12                    | 98.061                          | 1.939        | ----             | ----         | ----       | ----         | ----      | ----         | ----          | ----         | 98.068                   | 1.932        | 98.068              | 1.932         | 0.007 | 0              | 0                         | 0                    |
| 29.03                    | 98.020                          | 1.980        | ----             | ----         | ----       | ----         | ----      | ----         | ----          | ----         | 98.026                   | 1.974        | 98.026              | 1.974         | 0.006 | 0              | 0                         | 0                    |
| 29.06                    | 97.977                          | 2.023        | ----             | ----         | ----       | ----         | ----      | ----         | ----          | ----         | 97.984                   | 2.016        | 97.984              | 2.016         | 0.007 | 0              | 0                         | 0                    |
| 29.09                    | 97.939                          | 2.061        | ----             | ----         | ----       | ----         | ----      | ----         | ----          | ----         | 97.946                   | 2.054        | 97.946              | 2.054         | 0.007 | 0              | 0                         | 0                    |
| 29.12                    | 97.905                          | 2.095        | ----             | ----         | ----       | ----         | ----      | ----         | ----          | ----         | 97.913                   | 2.087        | 97.913              | 2.087         | 0.008 | 0              | 0                         | 0                    |
| 30.03                    | 97.875                          | 2.125        | ----             | ----         | ----       | ----         | ----      | ----         | ----          | ----         | 97.884                   | 2.116        | 97.884              | 2.116         | 0.009 | 0              | 0                         | 0                    |
| 30.06                    | 97.845                          | 2.155        | ----             | ----         | ----       | ----         | ----      | ----         | ----          | ----         | 97.857                   | 2.143        | 97.857              | 2.143         | 0.012 | 0              | 0                         | 0                    |
| 30.09                    | 97.814                          | 2.186        | ----             | ----         | ----       | ----         | ----      | ----         | ----          | ----         | 97.828                   | 2.172        | 97.828              | 2.172         | 0.014 | 0              | 0                         | 0                    |
| 30.12                    | 97.781                          | 2.219        | ----             | ----         | ----       | ----         | ----      | ----         | ----          | ----         | 97.795                   | 2.205        | 97.795              | 2.205         | 0.014 | 0              | 0                         | 0                    |
| 計Totals                  | ----                            | ----         | ----             | ----         | ----       | ----         | ----      | ----         | ----          | ----         | ----                     | ----         | ----                | ----          | ----  | 1,000          | 0                         | 1,446                |

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>%                  |      |                     |      |                |                           |                      |
| 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              | ----                      | ----                 |
| 30.12                    | ----                            | ----          | ----             | ----    | ----       | ----    | ----      | ----    | ----          | ----    | ----                     | ---- | ----                | ---- | 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 |                |                   |                              |                            |
| 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                     |
| 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                     |
| 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 |                |                   |                              |                            |
| 26.09                    | 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                    | 97.875                     | 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                     |
| 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                     |
| 26.12                    | 99.750                     | 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 |                |                   |                              |                            |
| 27.03                    | 97.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 27.03                    | 98.000                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 27.03                    | 98.125                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 27.03                    | 98.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 27.03                    | 98.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 27.03                    | 98.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 27.03                    | 98.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 27.03                    | 98.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 27.03                    | 98.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 27.03                    | 99.000                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 27.03                    | 99.125                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 27.03                    | 99.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 27.03                    | 99.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 計 Totals                 | ----                       | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | 0                 | 0                            | ----                       |

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

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

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

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

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

無担保コールオーバーナイト3ヵ月金利先物プットオプション(ブロック取引分)

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

| 限月<br>Contract<br>Months | 権利行使<br>価格<br>Strike Price | 前日<br>清算価格<br>Settle.<br>(Previous Day) | 始値<br>Open Price | 高値<br>High | 安値<br>Low | 終値<br>Closing | 公式終値<br>Official Closing | 清算価格<br>Sett. Price |               | 取引数量<br>Volume | 建玉数量<br>Open Int. | 権利行使数量<br>Exercise<br>Volume | ボラティリティ<br>Volatility<br>% |
|--------------------------|----------------------------|---|------------------|------------|-----------|---------------|--------------------------|---------------------|---------------|----------------|-------------------|------------------------------|----------------------------|
|                          |                            |   |                  |            |           |               |                          |                     | 前日比<br>Change |                |                   |                              |                            |
| 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              | ----              | ----                         | ----                       |
| 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              | ----              | ----                         | ----                       |
| 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 |                |                   |                              |                            |
| 26.09                    | 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                    | 97.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.12                    | 98.000                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 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              | ----              | ----                         | ----                       |
| 27.03                    | 97.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 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 |                |                   |                              |                            |
| 27.03                    | 97.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 27.03                    | 98.000                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 27.03                    | 98.125                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 27.03                    | 98.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 27.03                    | 98.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 27.03                    | 98.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 27.03                    | 98.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 27.03                    | 98.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 27.03                    | 98.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 27.03                    | 99.000                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 27.03                    | 99.125                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 27.03                    | 99.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 27.03                    | 99.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 計 Totals                 | ----                       | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |

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

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

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

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

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

無担保コールオーバーナイト3ヵ月金利先物コールオプション

Call Options on Three-month TONA Futures

| 限月<br>Contract<br>Months | 権利行使<br>価格<br>Strike Price | 前日<br>清算価格<br>Settle.<br>(Previous Day) | 始値<br>Open Price | 高値<br>High | 安値<br>Low | 終値<br>Closing | 公式終値<br>Official Closing | 清算価格<br>Sett. Price |               | 取引数量<br>Volume | 建玉数量<br>Open Int. | 権利行使数量<br>Exercise<br>Volume | ボラティリティ<br>Volatility<br>% |
|--------------------------|----------------------------|---|------------------|------------|-----------|---------------|--------------------------|---------------------|---------------|----------------|-------------------|------------------------------|----------------------------|
|                          |                            |   |                  |            |           |               |                          |                     | 前日比<br>Change |                |                   |                              |                            |
| 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                     |
| 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                     |
| 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 |                |                   |                              |                            |
| 26.09                    | 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                    | 97.875                     | 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                     |
| 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                     |
| 27.03                    | 97.750                     | 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.) 5.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.)  
 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.)

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 |                |                   |                              |                            |
| 27.03                    | 97.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 27.03                    | 98.000                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 27.03                    | 98.125                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 27.03                    | 98.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 27.03                    | 98.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 27.03                    | 98.500                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 27.03                    | 98.625                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 27.03                    | 98.750                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 27.03                    | 98.875                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 27.03                    | 99.000                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 27.03                    | 99.125                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 27.03                    | 99.250                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 27.03                    | 99.375                     | 0.000                                   | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | 0.000               | 0.000         | 0              | 0                 | 0                            | 0.0000                     |
| 計 Totals                 | ----                       | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | 0                 | 0                            | ----                       |

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

発行所 (Issued by) 東京金融取引所 (Tokyo Financial Exchange Inc.)  
 所在地 (Registered Office) 東京都千代田区丸の内 1-8-2  
 1-8-2 Marunouchi, Chiyoda-ku, Tokyo 電話 (Telephone) 03-4578-2400 URL https://www.tfx.co.jp E-mail info@tfx.co.jp

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

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 |                |                   |                              |                            |
| 26.03                    | 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              | ----              | ----                         | ----                       |
| 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              | ----              | ----                         | ----                       |
| 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 |                |                   |                              |                            |
| 26.09                    | 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                    | 97.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 26.12                    | 98.000                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 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              | ----              | ----                         | ----                       |
| 27.03                    | 97.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 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 |                |                   |                              |                            |
| 27.03                    | 97.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 27.03                    | 98.000                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 27.03                    | 98.125                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 27.03                    | 98.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 27.03                    | 98.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 27.03                    | 98.500                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 27.03                    | 98.625                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 27.03                    | 98.750                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 27.03                    | 98.875                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 27.03                    | 99.000                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 27.03                    | 99.125                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 27.03                    | 99.250                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 27.03                    | 99.375                     | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |
| 計 Totals                 | ----                       | ----                                    | ----             | ----       | ----      | ----          | ----                     | ----                | ----          | 0              | ----              | ----                         | ----                       |