

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>% |                        | *<br>年利<br>% | 前日比<br>Change |                   |                           |                         |  |
| 26.06                     | 99.023                          | 0.977        | 99.022            | 0.978        | 99.022      | 0.978        | 99.022     | 0.978        | 99.022         | 0.978                    | 99.022                      | 0.978        | 99.022                 | 0.978        | -0.001        | 6,810             | 0                         | 1,371                   |  |
| 26.09                     | 98.809                          | 1.191        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----                     | 98.805                      | 1.195        | 98.805                 | 1.195        | -0.004        | 460               | 0                         | 904                     |  |
| 26.12                     | 98.586                          | 1.414        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----                     | 98.585                      | 1.415        | 98.585                 | 1.415        | -0.001        | 0                 | 0                         | 270                     |  |
| 27.03                     | 98.401                          | 1.599        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----                     | 98.400                      | 1.600        | 98.400                 | 1.600        | -0.001        | 0                 | 0                         | 1                       |  |
| 27.06                     | 98.246                          | 1.754        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----                     | 98.245                      | 1.755        | 98.245                 | 1.755        | -0.001        | 0                 | 0                         | 0                       |  |
| 27.09                     | 98.128                          | 1.872        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----                     | 98.132                      | 1.868        | 98.132                 | 1.868        | 0.004         | 0                 | 0                         | 0                       |  |
| 27.12                     | 98.027                          | 1.973        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----                     | 98.030                      | 1.970        | 98.030                 | 1.970        | 0.003         | 0                 | 0                         | 0                       |  |
| 28.03                     | 97.945                          | 2.055        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----                     | 97.946                      | 2.054        | 97.946                 | 2.054        | 0.001         | 0                 | 0                         | 0                       |  |
| 28.06                     | 97.873                          | 2.127        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----                     | 97.873                      | 2.127        | 97.873                 | 2.127        | 0.000         | 0                 | 0                         | 0                       |  |
| 28.09                     | 97.808                          | 2.192        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----                     | 97.808                      | 2.192        | 97.808                 | 2.192        | 0.000         | 0                 | 0                         | 0                       |  |
| 28.12                     | 97.748                          | 2.252        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----                     | 97.748                      | 2.252        | 97.748                 | 2.252        | 0.000         | 0                 | 0                         | 0                       |  |
| 29.03                     | 97.692                          | 2.308        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----                     | 97.692                      | 2.308        | 97.692                 | 2.308        | 0.000         | 0                 | 0                         | 0                       |  |
| 29.06                     | 97.636                          | 2.364        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----                     | 97.636                      | 2.364        | 97.636                 | 2.364        | 0.000         | 0                 | 0                         | 0                       |  |
| 29.09                     | 97.580                          | 2.420        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----                     | 97.579                      | 2.421        | 97.579                 | 2.421        | -0.001        | 0                 | 0                         | 0                       |  |
| 29.12                     | 97.525                          | 2.475        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----                     | 97.524                      | 2.476        | 97.524                 | 2.476        | -0.001        | 0                 | 0                         | 0                       |  |
| 30.03                     | 97.472                          | 2.528        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----                     | 97.469                      | 2.531        | 97.469                 | 2.531        | -0.003        | 0                 | 0                         | 0                       |  |
| 30.06                     | 97.420                          | 2.580        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----                     | 97.415                      | 2.585        | 97.415                 | 2.585        | -0.005        | 0                 | 0                         | 0                       |  |
| 30.09                     | 97.367                          | 2.633        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----                     | 97.359                      | 2.641        | 97.359                 | 2.641        | -0.008        | 0                 | 0                         | 0                       |  |
| 30.12                     | 97.313                          | 2.687        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----                     | 97.305                      | 2.695        | 97.305                 | 2.695        | -0.008        | 0                 | 0                         | 0                       |  |
| 31.03                     | 97.259                          | 2.741        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----                     | 97.252                      | 2.748        | 97.252                 | 2.748        | -0.007        | 0                 | 0                         | 0                       |  |
|                           |                                 |              |                   |              |             |              |            |              |                |                          |                             |              |                        |              |               |                   |                           |                         |  |
| 計Totals                   | ----                            | ----         | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----                     | ----                        | ----         | ----                   | ----         | ----          | 7,270             | 0                         | 2,546                   |  |



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ヵ月金利先物プットオプション |                                |                                             |                   |             |            |                |                             |                        |                 | Put Options on Three-month TONA Futures |                      |                              |                            |  |
|------------------------------|--------------------------------|---------------------------------------------|-------------------|-------------|------------|----------------|-----------------------------|------------------------|-----------------|-----------------------------------------|----------------------|------------------------------|----------------------------|--|
| 限 月<br>Contract<br>Months    | 権 利 行 使<br>価 格<br>Strike Price | 前 日<br>清 算 価 格<br>Settle.<br>(Previous Day) | 始 値<br>Open Price | 高 値<br>High | 安 値<br>Low | 終 値<br>Closing | 公 式 終 値<br>Official Closing | 清 算 価 格<br>Sett. Price |                 | 取 引 数 量<br>Volume                       | 建 玉 数 量<br>Open Int. | 権利行使数量<br>Exercise<br>Volume | ボラティリティ<br>Volatility<br>% |  |
|                              |                                |                                             |                   |             |            |                |                             |                        | 前 日 比<br>Change |                                         |                      |                              |                            |  |
| 26.06                        | 98.250                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.06                        | 98.375                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.06                        | 98.500                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.06                        | 98.625                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.06                        | 98.750                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.06                        | 98.875                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.06                        | 99.000                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.06                        | 99.125                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.06                        | 99.250                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.06                        | 99.375                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.06                        | 99.500                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.06                        | 99.625                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.06                        | 99.750                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.06                        | 99.875                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.06                        | 100.000                        | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 98.000                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 98.125                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 98.250                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 98.375                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 98.500                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 98.625                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 98.750                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 98.875                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 99.000                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 99.125                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 99.250                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 99.375                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 99.500                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 99.625                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 99.750                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 99.875                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                       | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 計 Totals                     | ----                           | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | ----                                    | ----                 | ----                         | ----                       |  |

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

発行所 (Issued by)

東京金融取引所 (Tokyo Financial Exchange Inc.)

所在地 (Registered Office)

東京都千代田区丸の内 1-8-2

1-8-2 Marunouchi, Chiyoda-ku, Tokyo

電話 (Telephone)

03-4578-2400

URL

https://www.tfx.co.jp

E-mail

info@tfx.co.jp

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

| 無担保コールオーバーナイト3ヵ月金利先物プットオプション |                                |                                             |                   |             |            |                |                             |                        |                 | Put Options on Three-month TONA Futures |                      |                              |                            |  |
|------------------------------|--------------------------------|---------------------------------------------|-------------------|-------------|------------|----------------|-----------------------------|------------------------|-----------------|-----------------------------------------|----------------------|------------------------------|----------------------------|--|
| 限 月<br>Contract<br>Months    | 権 利 行 使<br>価 格<br>Strike Price | 前 日<br>清 算 価 格<br>Settle.<br>(Previous Day) | 始 値<br>Open Price | 高 値<br>High | 安 値<br>Low | 終 値<br>Closing | 公 式 終 値<br>Official Closing | 清 算 価 格<br>Sett. Price |                 | 取 引 数 量<br>Volume                       | 建 玉 数 量<br>Open Int. | 権利行使数量<br>Exercise<br>Volume | ボラティリティ<br>Volatility<br>% |  |
|                              |                                |                                             |                   |             |            |                |                             |                        | 前 日 比<br>Change |                                         |                      |                              |                            |  |
| 26.12                        | 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                        | 97.625                         | 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                     |  |
| 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                     |  |
| 27.03                        | 99.500                         | 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](mailto: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 |                   |                      |                                   |                            |  |
| 27.06                     | 97.500                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                                 | 0.0000                     |  |
| 27.06                     | 97.625                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                                 | 0.0000                     |  |
| 27.06                     | 97.750                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                                 | 0.0000                     |  |
| 27.06                     | 97.875                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                                 | 0.0000                     |  |
| 27.06                     | 98.000                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                                 | 0.0000                     |  |
| 27.06                     | 98.125                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                                 | 0.0000                     |  |
| 27.06                     | 98.250                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                                 | 0.0000                     |  |
| 27.06                     | 98.375                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                                 | 0.0000                     |  |
| 27.06                     | 98.500                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                                 | 0.0000                     |  |
| 27.06                     | 98.625                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                                 | 0.0000                     |  |
| 27.06                     | 98.750                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                                 | 0.0000                     |  |
| 27.06                     | 98.875                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                                 | 0.0000                     |  |
| 27.06                     | 99.000                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                                 | 0.0000                     |  |
| 27.06                     | 99.125                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                                 | 0.0000                     |  |
| 27.06                     | 99.250                         | 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ヵ月金利先物プットオプション (ブロック取引分) Put Options on Three-month TONA Futures (Block Trade)

| 限 月<br>Contract<br>Months | 権 利 行 使<br>価 格<br>Strike Price | 前 日<br>清 算 価 格<br>Settle.<br>(Previous Day) | 始 値<br>Open Price | 高 値<br>High | 安 値<br>Low | 終 値<br>Closing | 公 式 終 値<br>Official Closing | 清 算 価 格<br>Sett. Price |                 | 取 引 数 量<br>Volume | 建 玉 数 量<br>Open Int. | 権利行使数量<br>Exercise<br>Volume | ボラティリティ<br>Volatility<br>% |  |
|---------------------------|--------------------------------|---------------------------------------------|-------------------|-------------|------------|----------------|-----------------------------|------------------------|-----------------|-------------------|----------------------|------------------------------|----------------------------|--|
|                           |                                |                                             |                   |             |            |                |                             |                        | 前 日 比<br>Change |                   |                      |                              |                            |  |
| 26.06                     | 98.250                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.06                     | 98.375                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.06                     | 98.500                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.06                     | 98.625                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.06                     | 98.750                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.06                     | 98.875                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.06                     | 99.000                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.06                     | 99.125                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.06                     | 99.250                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.06                     | 99.375                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.06                     | 99.500                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.06                     | 99.625                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.06                     | 99.750                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.06                     | 99.875                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.06                     | 100.000                        | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 98.000                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 98.125                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 98.250                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 98.375                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 98.500                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 98.625                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 98.750                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 98.875                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 99.000                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 99.125                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 99.250                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 99.375                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 99.500                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 99.625                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 99.750                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 99.875                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 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.) 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ヵ月金利先物プットオプション (ブロック取引分) |                                |                                             |                   |             |            |                |                             |                        |                 | Put Options on Three-month TONA Futures (Block Trade) |                      |                                   |                            |  |
|----------------------------------------|--------------------------------|---------------------------------------------|-------------------|-------------|------------|----------------|-----------------------------|------------------------|-----------------|-------------------------------------------------------|----------------------|-----------------------------------|----------------------------|--|
| 限 月<br>Contract<br>Months              | 権 利 行 使<br>価 格<br>Strike Price | 前 日<br>清 算 価 格<br>Settle.<br>(Previous Day) | 始 値<br>Open Price | 高 値<br>High | 安 値<br>Low | 終 値<br>Closing | 公 式 終 値<br>Official Closing | 清 算 価 格<br>Sett. Price |                 | 取 引 数 量<br>Volume                                     | 建 玉 数 量<br>Open Int. | 権 利 行 使 数 量<br>Exercise<br>Volume | ボラティリティ<br>Volatility<br>% |  |
|                                        |                                |                                             |                   |             |            |                |                             |                        | 前 日 比<br>Change |                                                       |                      |                                   |                            |  |
| 26.12                                  | 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                                  | 97.625                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                     | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 27.03                                  | 97.750                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                     | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 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                                                     | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 27.03                                  | 99.500                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 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](mailto: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 |                   |                      |                                   |                            |  |
| 27.06                     | 97.500                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 27.06                     | 97.625                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 27.06                     | 97.750                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 27.06                     | 97.875                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 27.06                     | 98.000                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 27.06                     | 98.125                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 27.06                     | 98.250                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 27.06                     | 98.375                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 27.06                     | 98.500                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 27.06                     | 98.625                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 27.06                     | 98.750                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 27.06                     | 98.875                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 27.06                     | 99.000                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 27.06                     | 99.125                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 27.06                     | 99.250                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 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 |                                          |                      |                              |                            |  |
| 26.06                        | 98.250                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.06                        | 98.375                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.06                        | 98.500                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.06                        | 98.625                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.06                        | 98.750                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.06                        | 98.875                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.06                        | 99.000                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.06                        | 99.125                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.06                        | 99.250                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.06                        | 99.375                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.06                        | 99.500                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.06                        | 99.625                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.06                        | 99.750                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.06                        | 99.875                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.06                        | 100.000                        | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 98.000                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 98.125                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 98.250                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 98.375                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 98.500                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 98.625                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 98.750                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 98.875                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 99.000                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 99.125                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 99.250                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 99.375                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 99.500                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 99.625                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 99.750                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.09                        | 99.875                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                                        | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 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 |                   |                      |                              |                            |  |  |
| 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                        | 97.625                         | 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                     |  |  |
| 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                     |  |  |
| 27.03                        | 99.500                         | 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.) 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 |                   |                      |                              |                            |  |
| 26.06                     | 98.250                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.06                     | 98.375                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.06                     | 98.500                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.06                     | 98.625                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.06                     | 98.750                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.06                     | 98.875                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.06                     | 99.000                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.06                     | 99.125                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.06                     | 99.250                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.06                     | 99.375                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.06                     | 99.500                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.06                     | 99.625                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.06                     | 99.750                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.06                     | 99.875                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.06                     | 100.000                        | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 98.000                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 98.125                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 98.250                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 98.375                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 98.500                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 98.625                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 98.750                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 98.875                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 99.000                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 99.125                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 99.250                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 99.375                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 99.500                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 99.625                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 99.750                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.09                     | 99.875                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 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.) 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 |                   |                      |                                   |                            |  |
| 26.12                                  | 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                                  | 97.625                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                                                   | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 27.03                                  | 97.750                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                                                   | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 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                 | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 27.03                                  | 99.500                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                                                   | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 計 Totals                               | ----                           | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                                                   | ----                   | ----            | ----              | ----                 | ----                              | ----                       |  |

