

## 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                     | 99.022                          | 0.978        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----         | 99.022                      | 0.978        | 99.022                 | 0.978        | 0.000         | 0                 | 0                         | 1,422                   |
| 26.09                     | 98.777                          | 1.223        | 98.768            | 1.232        | 98.768      | 1.232        | 98.768     | 1.232        | 98.768         | 1.232        | 98.768                      | 1.232        | 98.768                 | 1.232        | -0.009        | 1,000             | 0                         | 814                     |
| 26.12                     | 98.529                          | 1.471        | 98.513            | 1.487        | 98.513      | 1.487        | 98.513     | 1.487        | 98.513         | 1.487        | 98.513                      | 1.487        | 98.513                 | 1.487        | -0.016        | 1,100             | 0                         | 182                     |
| 27.03                     | 98.327                          | 1.673        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----         | 98.311                      | 1.689        | 98.311                 | 1.689        | -0.016        | 0                 | 0                         | 1                       |
| 27.06                     | 98.132                          | 1.868        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----         | 98.128                      | 1.872        | 98.128                 | 1.872        | -0.004        | 0                 | 0                         | 0                       |
| 27.09                     | 97.985                          | 2.015        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----         | 97.998                      | 2.002        | 97.998                 | 2.002        | 0.013         | 0                 | 0                         | 0                       |
| 27.12                     | 97.895                          | 2.105        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----         | 97.900                      | 2.100        | 97.900                 | 2.100        | 0.005         | 0                 | 0                         | 0                       |
| 28.03                     | 97.796                          | 2.204        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----         | 97.807                      | 2.193        | 97.807                 | 2.193        | 0.011         | 0                 | 0                         | 0                       |
| 28.06                     | 97.717                          | 2.283        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----         | 97.735                      | 2.265        | 97.735                 | 2.265        | 0.018         | 0                 | 0                         | 0                       |
| 28.09                     | 97.667                          | 2.333        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----         | 97.687                      | 2.313        | 97.687                 | 2.313        | 0.020         | 0                 | 0                         | 0                       |
| 28.12                     | 97.627                          | 2.373        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----         | 97.648                      | 2.352        | 97.648                 | 2.352        | 0.021         | 0                 | 0                         | 0                       |
| 29.03                     | 97.588                          | 2.412        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----         | 97.612                      | 2.388        | 97.612                 | 2.388        | 0.024         | 0                 | 0                         | 0                       |
| 29.06                     | 97.546                          | 2.454        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----         | 97.571                      | 2.429        | 97.571                 | 2.429        | 0.025         | 0                 | 0                         | 0                       |
| 29.09                     | 97.497                          | 2.503        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----         | 97.524                      | 2.476        | 97.524                 | 2.476        | 0.027         | 0                 | 0                         | 0                       |
| 29.12                     | 97.448                          | 2.552        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----         | 97.478                      | 2.522        | 97.478                 | 2.522        | 0.030         | 0                 | 0                         | 0                       |
| 30.03                     | 97.401                          | 2.599        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----         | 97.432                      | 2.568        | 97.432                 | 2.568        | 0.031         | 0                 | 0                         | 0                       |
| 30.06                     | 97.354                          | 2.646        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----         | 97.386                      | 2.614        | 97.386                 | 2.614        | 0.032         | 0                 | 0                         | 0                       |
| 30.09                     | 97.306                          | 2.694        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----         | 97.340                      | 2.660        | 97.340                 | 2.660        | 0.034         | 0                 | 0                         | 0                       |
| 30.12                     | 97.259                          | 2.741        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----         | 97.294                      | 2.706        | 97.294                 | 2.706        | 0.035         | 0                 | 0                         | 0                       |
| 31.03                     | 97.212                          | 2.788        | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----         | 97.248                      | 2.752        | 97.248                 | 2.752        | 0.036         | 0                 | 0                         | 0                       |
| 計 Totals                  | ----                            | ----         | ----              | ----         | ----        | ----         | ----       | ----         | ----           | ----         | ----                        | ----         | ----                   | ----         | ----          | 2,100             | 0                         | 2,419                   |



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](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 |                   |                      |                              |                            |  |
| 26.12                     | 97.750                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.12                     | 97.875                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.12                     | 98.000                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.12                     | 98.125                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.12                     | 98.250                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.12                     | 98.375                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.12                     | 98.500                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.12                     | 98.625                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.12                     | 98.750                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.12                     | 98.875                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.12                     | 99.000                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.12                     | 99.125                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.12                     | 99.250                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.12                     | 99.375                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.12                     | 99.500                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.12                     | 99.625                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 27.03                     | 97.625                         | 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                     |  |
| 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ヵ月金利先物プットオプション

## Put Options on Three-month TONA Futures

| 限 月<br>Contract<br>Months | 権 利 行 使<br>価 格<br>Strike Price | 前 日<br>清 算 価 格<br>Settle.<br>(Previous Day) | 始 値<br>Open Price | 高 値<br>High | 安 値<br>Low | 終 値<br>Closing | 公 式 終 値<br>Official Closing | 清 算 価 格<br>Sett. Price |                 | 取 引 数 量<br>Volume | 建 玉 数 量<br>Open Int. | 権 利 行 使 数 量<br>Exercise<br>Volume | ボラティリティ<br>Volatility<br>% |  |
|---------------------------|--------------------------------|---------------------------------------------|-------------------|-------------|------------|----------------|-----------------------------|------------------------|-----------------|-------------------|----------------------|-----------------------------------|----------------------------|--|
|                           |                                |                                             |                   |             |            |                |                             |                        | 前 日 比<br>Change |                   |                      |                                   |                            |  |
| 27.03                     | 99.500                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                                 | 0.0000                     |  |
| 27.06                     | 97.375                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                                 | 0.0000                     |  |
| 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                                  | 97.750                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                     | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 26.12                                  | 97.875                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                     | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 26.12                                  | 98.000                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                     | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 26.12                                  | 98.125                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                     | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 26.12                                  | 98.250                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                     | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 26.12                                  | 98.375                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                     | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 26.12                                  | 98.500                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                     | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 26.12                                  | 98.625                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                     | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 26.12                                  | 98.750                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                     | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 26.12                                  | 98.875                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                     | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 26.12                                  | 99.000                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                     | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 26.12                                  | 99.125                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                     | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 26.12                                  | 99.250                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                     | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 26.12                                  | 99.375                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                     | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 26.12                                  | 99.500                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                     | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 26.12                                  | 99.625                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                     | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 27.03                                  | 97.625                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 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                                                     | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 計 Totals                               | ----                           | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | ----                                                  | ----                 | ----                              | ----                       |  |

日付 (Date)

2026年09月08日

( September 08.2026 )

8ページ

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

発行所 (Issued by)

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

所在地 (Registered Office)

東京都千代田区丸の内 1-8-2

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

電話 (Telephone) 03-4578-2400

URL https://www.tfx.co.jp

E-mail info@tfx.co.jp

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

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

3.権利行使数量は当日の権利行使申告 ( = 割当通知 ) に係る数量。(Exercise Volume is based on today's report.)

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

無担保コールオーバーナイト3ヵ月金利先物プットオプション (ブロック取引分)

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

| 限 月<br>Contract<br>Months | 権 利 行 使<br>価 格<br>Strike Price | 前 日<br>清 算 価 格<br>Settle.<br>(Previous Day) | 始 値<br>Open Price | 高 値<br>High | 安 値<br>Low | 終 値<br>Closing | 公 式 終 値<br>Official Closing | 清 算 価 格<br>Sett. Price |                 | 取 引 数 量<br>Volume | 建 玉 数 量<br>Open Int. | 権 利 行 使 数 量<br>Exercise<br>Volume | ボラティリティ<br>Volatility<br>% |  |
|---------------------------|--------------------------------|---------------------------------------------|-------------------|-------------|------------|----------------|-----------------------------|------------------------|-----------------|-------------------|----------------------|-----------------------------------|----------------------------|--|
|                           |                                |                                             |                   |             |            |                |                             |                        | 前 日 比<br>Change |                   |                      |                                   |                            |  |
| 27.03                     | 99.500                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 27.06                     | 97.375                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                 | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 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](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](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                     | 97.750                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.12                     | 97.875                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.12                     | 98.000                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.12                     | 98.125                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.12                     | 98.250                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.12                     | 98.375                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.12                     | 98.500                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.12                     | 98.625                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.12                     | 98.750                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.12                     | 98.875                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.12                     | 99.000                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.12                     | 99.125                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.12                     | 99.250                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.12                     | 99.375                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.12                     | 99.500                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 26.12                     | 99.625                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                            | 0.0000                     |  |
| 27.03                     | 97.625                         | 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                     |  |
| 計 Totals                  | ----                           | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | ----              | ----                 | ----                         | ----                       |  |

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

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

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

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

電話 (Telephone) 03-4578-2400

URL https://www.tfx.co.jp

E-mail info@tfx.co.jp

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

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

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

3.権利行使数量は当日の権利行使申告 (= 割当通知) に係る数量。(Exercise Volume is based on today's report.)

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

## 無担保コールオーバーナイト3ヵ月金利先物コールオプション

## Call Options on Three-month TONA Futures

| 限 月<br>Contract<br>Months | 権 利 行 使<br>価 格<br>Strike Price | 前 日<br>清 算 価 格<br>Settle.<br>(Previous Day) | 始 値<br>Open Price | 高 値<br>High | 安 値<br>Low | 終 値<br>Closing | 公 式 終 値<br>Official Closing | 清 算 価 格<br>Sett. Price |                 | 取 引 数 量<br>Volume | 建 玉 数 量<br>Open Int. | 権 利 行 使 数 量<br>Exercise<br>Volume | ボラティリティ<br>Volatility<br>% |  |
|---------------------------|--------------------------------|---------------------------------------------|-------------------|-------------|------------|----------------|-----------------------------|------------------------|-----------------|-------------------|----------------------|-----------------------------------|----------------------------|--|
|                           |                                |                                             |                   |             |            |                |                             |                        | 前 日 比<br>Change |                   |                      |                                   |                            |  |
| 27.03                     | 99.500                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                                 | 0.0000                     |  |
| 27.06                     | 97.375                         | 0.000                                       | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | 0.000                  | 0.000           | 0                 | 0                    | 0                                 | 0.0000                     |  |
| 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                                  | 97.750                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                      | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.12                                  | 97.875                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                      | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.12                                  | 98.000                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                      | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.12                                  | 98.125                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                      | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.12                                  | 98.250                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                      | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.12                                  | 98.375                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                      | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.12                                  | 98.500                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                      | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.12                                  | 98.625                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                      | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.12                                  | 98.750                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                      | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.12                                  | 98.875                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                      | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.12                                  | 99.000                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                      | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.12                                  | 99.125                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                      | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.12                                  | 99.250                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                      | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.12                                  | 99.375                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                      | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.12                                  | 99.500                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                      | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 26.12                                  | 99.625                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                      | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 27.03                                  | 97.625                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 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                                                      | ----                 | ----                         | ----                       |  |
| 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 |                                                        |                      |                                   |                            |  |
| 27.03                                  | 99.500                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                      | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 27.06                                  | 97.375                         | ----                                        | ----              | ----        | ----       | ----           | ----                        | ----                   | ----            | 0                                                      | ----                 | ----                              | ----                       |  |
| 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                                                      | ----                 | ----                              | ----                       |  |