

ユーロ円3カ月金利先物オプション



金融取

金融取のユーロ円 3 ヶ月金利先物オプション

●ユーロ円 3 ヶ月金利先物オプション取引とは

- ・ユーロ円 3 ヶ月金利先物オプション取引とは、原資産であるユーロ円 3 ヶ月金利先物を当初設定した特定の価格(以下、権利行使価格)で買ったり(コールオプション)、売ったり(プットオプション)することができる権利を取引するものです。
- ・オプションの買い手は、オプション料を支払うことで、将来の円資金取引のレートを現時点で予約できる権利(義務ではない)を取得し、金利の変動リスクに保険をかけるような効果が得られることとなります。

●ユーロ円 3 ヶ月金利先物オプションの商品概要

ユーロ円 3 ヶ月金利先物オプション	
原資産	ユーロ円 3 ヶ月金利先物
取引対象	ユーロ円 3 ヶ月金利先物コールオプションおよびプットオプション
取引単位	ユーロ円 3 ヶ月金利先物の 1 取引単位 (元本金額 1 億円)
価格の表示方法	ユーロ円 3 ヶ月金利先物の最小変動幅 (0.005) 刻みの指数
権利行使価格の刻み・設定	ユーロ円 3 ヶ月金利先物の前営業日の公式終値に最も接近する 0.125 の整数倍の数値を ATM(アット・ザ・マネー)として、0.125 刻みで上下 6 種類ずつ、合計 13 種類(上場時)
最小変動幅・価値	0.005 で 1,250 円
限月設定	四半期毎の限月(3、6、9、12 月限)を 5 限月分(1 年 3 ヶ月)
権利行使期間	取引開始日から取引最終日まで(アメリカンタイプ) 取引最終日にはイン・ザ・マネー銘柄について自動権利行使
取引最終日	限月第 3 水曜日の 2 営業日前
最終決済日	取引最終日の翌営業日
新たな限月の取引開始日	取引最終日の翌営業日
取引の成立方法	オークション方式
ストラテジー取引	なし
ブロック取引	あり(最低申込数量: 100 枚)

●ユーロ円 3 ヶ月金利先物オプションの取引時間

取引時間	8:30 - 8:45	プレオープン
	8:45 - 11:30	日中取引
	11:30 - 12:30	取消・数量削減専用時間
	12:30 - 15:30	日中取引
	15:30 - 20:00	夜間取引
取引最終日限月の取引時間	8:30 - 8:45	プレオープン
	8:45 - 11:00	日中取引

金利先物等取引は、差し入れた証拠金以上の取引金額を扱うため、取引対象である金利の変動等により差し入れた証拠金以上の損失が発生する可能性があります。限月によっては、平時から流動性の低いものもあります。投資の際には、金融商品取引業者より交付される契約締結前交付書面等の内容を十分理解した上で、ご自身の判断で行うことが重要です。