

項目	内容	備考								
1. 対象取引	<ul style="list-style-type: none"> デルタニュートラル呼値が可能なオプション取引と対象原資産の組合せは次のとおりです。 <table border="1" data-bbox="533 387 1556 587"> <thead> <tr> <th>オプション取引</th> <th>デルタニュートラル呼値の対象原資産取引</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>国債証券先物オプション取引</td> <td>権利行使対象国債証券先物取引</td> </tr> <tr> <td>指数オプション取引</td> <td>対象指数を同一とする指数先物取引</td> </tr> <tr> <td>有価証券オプション取引</td> <td>対象有価証券</td> </tr> </tbody> </table>	オプション取引	デルタニュートラル呼値の対象原資産取引	国債証券先物オプション取引	権利行使対象国債証券先物取引	指数オプション取引	対象指数を同一とする指数先物取引	有価証券オプション取引	対象有価証券	
オプション取引	デルタニュートラル呼値の対象原資産取引									
国債証券先物オプション取引	権利行使対象国債証券先物取引									
指数オプション取引	対象指数を同一とする指数先物取引									
有価証券オプション取引	対象有価証券									
2. 呼値の方法	<ul style="list-style-type: none"> 取引参加者がデルタニュートラル呼値を行う場合には、オプション取引に係る呼値に係る指示事項に加えて、デルタ、対象原資産値段、及び対象原資産の売り買いの別について指示することとします。 デルタとは、原資産の価格変動に対するオプションの価格変動率をいい、取引参加者は 0.01 から 1 までの間の当取引所がその都度定める範囲内の小数点以下第二位までの数値から、デルタを指示することとします。 デルタを指示することにより、対象原資産取引の約定数量は、次のとおり定まります。 対象原資産取引の約定数量 = [オプションの発注数量×デルタ×受渡単位] (小数点以下四捨五入) - [オプションの約定後の残数量×デルタ×受渡単位] (小数点以下四捨五入) ただし、有価証券オプション取引において、計算された対象原資産の約定数量に受渡単位未満の数量が生じた場合には四捨五入。 	<ul style="list-style-type: none"> 有価証券オプション取引の原資産取引を信用取引で行う場合は、その旨も指示する必要があります。 計算の結果、対象原資産の約定数量が0となった場合には、原資産の約定は成立しません。 								
3. 取引契約締結の方法	<ul style="list-style-type: none"> デルタニュートラル呼値が行われたときには、オプション取引の銘柄、デルタ、対象原資産値段、対象原資産の売り買いの別のすべての条件が合致するデルタニュートラル呼値ごとに個別競争取引を行い、オプションに係る呼値の競合により取引を成立させるものとします。 デルタニュートラル呼値により成立する対象原資産の取引は立会によらない取引となります。 	<ul style="list-style-type: none"> 個別競争取引において、原資産の取引条件は関係しません。 対象原資産について、当取引所が定める値幅を超える値段における約定は認めないこととします。 								