

ストラテジー取引の種類一覧

平成21年10月 5日  
株式会社東京証券取引所

ストラテジー取引の種類	買いストラテジー注文により成立する取引	インプライドイン	インプライドアウト	ストラテジー値段	デルタニューtral呼値
ジェリーロール	期近限月において同じ行使価格でコールの売付け及びプットの買付け、期先限月においてコールの買付け及びプットの売付けがそれぞれ1単位成立する取引			期近限月のプットの値段 - 期近限月のコールの値段 + 期先限月コールの値段 - 期先限月のプットの値段	
コールバタフライ	同一限月において低い行使価格と高い行使価格で1単位コールの買付け、中間の行使価格で2単位のコールの売付けが成立する取引	○		低い行使価格のコールの値段 - 中間の行使価格のコールの値段×2 + 高い行使価格のコールの値段	○
プットバタフライ	同一限月において低い行使価格と高い行使価格で1単位プット買付け、中間の行使価格で2単位のプットの売付けが成立する取引	○		低い行使価格のプットの値段 - 中間の行使価格のプットの値段×2 + 高い行使価格のプットの値段	○
コールスプレッド	同一限月においてコールの買付け、より高い行使価格でコールの売付けがそれぞれ1単位成立する取引	○	○	低い行使価格のコールの値段 - 高い行使価格のコールの値段	○
プットスプレッド	同一限月においてプットの買付け、より低い行使価格でプットの売付けがそれぞれ1単位成立する取引	○	○	高い行使価格のプットの値段 - 低い行使価格のプットの値段	○
コールカレンダーズプレッド	期近限月においてコールの売付け、期先限月において期近限月と同一の行使価格でコールの買付けがそれぞれ1単位成立する取引	○	○	- 期近限月のコールの値段 + 期先限月のコールの値段	○
プットカレンダーズプレッド	期近限月においてプットの売付け、期先限月において期近限月と同一の行使価格でプットの買付けがそれぞれ1単位成立する取引	○	○	- 期近限月のプットの値段 + 期先限月のプットの値段	○

ストラテジー取引の種類	買いストラテジー注文により成立する取引	インプライドイン	インプライドアウト	ストラテジー値段	デルタニュートラル呼値
コールダイアゴナルカレンダースプレッド	期近限月においてコールの売付け、期先限月において期近限月と異なる行使価格でコールの買付けがそれぞれ1単位成立する取引	○	○	－期近限月のコールの値段 ＋期先限月のコールの値段	○
プットダイアゴナルカレンダースプレッド	期近限月においてプットの売付け、期先限月において期近限月と異なる行使価格でプットの買付けがそれぞれ1単位成立する取引	○	○	－期近限月のプットの値段 ＋期先限月のプットの値段	○
ガッツ	同一限月においてコールの買付け、より高い行使価格でプットの買付けがそれぞれ1単位成立する取引			低い行使価格のコールの値段 ＋高い行使価格のプットの値段	○
2x1 レシオコールスプレッド	同一限月において1単位のコールの売付け、より高い行使価格で2単位コールの買付けが成立する取引	○		－低い行使価格のコールの値段 ＋高い行使価格のコールの値段×2	○
2x1 レシオプットスプレッド	同一限月において1単位のプットの売付け、より低い行使価格で2単位プットの買付けが成立する取引	○		－高い行使価格のプットの値段 ＋低い行使価格のプットの値段×2	○
アイアンバタフライ	同一限月において低い行使価格のプットの売付け、高い行使価格のコールの売付け、中間の行使価格のプット及びコールの買付けがそれぞれ1単位成立する取引			－低い行使価格のプットの値段 ＋中間の行使価格のコールの値段 ＋中間の行使価格のプットの値段 －高い行使価格のコールの値段	○
コンボ	同一限月においてコールの売付け、より低い行使価格のプットの買付けがそれぞれ1単位成立する取引			低い行使価格のプットの値段 －高い行使価格のコールの値段	○
ストラングル	同一限月においてプットの買付け、より高い行使価格のコールの買付けがそれぞれ1単位成立する取引	○	○	低い行使価格のプットの値段 ＋高い行使価格のコールの値段	○
コールラダー	同一限月においてコールの買付け、より高い行使価格のコールの売付け、中間の行使価格のコールの売付けがそれぞれ1単位成立する取引	○		低い行使価格のコールの値段 －中間の行使価格のコールの値段 －高い行使価格のコールの値段	○
プットラダー	同一限月においてプットの売付け、より高い行使価格のプットの買付け、中間の行使価格のプットの売付けがそれぞれ1単位成立する取引	○		－低い行使価格のプットの値段 －中間の行使価格のプットの値段 ＋高い行使価格のプットの値段	○

ストラテジー取引の種類	買いストラテジー注文により成立する取引	インプライドイン	インプライドアウト	ストラテジー値段	デルタニューtral呼値
ストラドルカレンダーズプレッド	期近限月において同一行使価格のプットの売付け及びコールの売付け、期先限月において同一行使価格（期近限月と同じ行使価格）のコールの買付け及びプットの買付けがそれぞれ1単位成立する取引			- 期近限月のプットの値段 - 期近限月のコールの値段 + 期先限月のプットの値段 + 期先限月のコールの値段	○
ダイアゴナルストラドルカレンダーズプレッド	期近限月において同一行使価格のプットの売付け及びコールの売付け、期先限月において同一行使価格（期近限月と異なる行使価格）のコールの買付け及びプットの買付けがそれぞれ1単位成立する取引			- 期近限月のプットの値段 - 期近限月のコールの値段 + 期先限月のプットの値段 + 期先限月のコールの値段	○
ストラドル	同一限月において同一行使価格のプット及びコールの買付けがそれぞれ1単位成立する取引	○	○	コールの値段 + プットの値段	○
プットコンドル	同一限月において任意の行使価格のプットの買付け、より高い行使価格のプットの売付け、さらに高い行使価格のプットの売付け、さらに一段と高い行使価格のプットの買付けがそれぞれ1単位成立する取引			低い行使価格のプットの値段 - より高い行使価格のプットの値段 - さらに高い行使価格のプットの値段 + さらに一段と高い行使価格のプットの値段	○
コールコンドル	同一限月において任意の行使価格のコールの買付け、より高い行使価格のコールの売付け、さらに高い行使価格のコールの売付け、さらに一段と高い行使価格のコールの買付けがそれぞれ1単位成立する取引			低い行使価格のコールの値段 - より高い行使価格のコールの値段 - さらに高い行使価格のコールの値段 + さらに一段と高い行使価格のコールの値段	○
アイアンコンドル	同一限月において任意の行使価格のプットの売付け、より高い行使価格のプットの買付け、さらに高い行使価格のコールの買付け、さらに一段と高い行使価格のコールの売付けがそれぞれ1単位成立する取引			- 低い行使価格のプットの値段 + より高い行使価格のプットの値段 + さらに高い行使価格のコールの値段 - さらに一段と高い行使価格のコールの値段	○

ストラテジー取引の種類	買いストラテジー注文により成立する取引	インプライドイン	インプライドアウト	ストラテジー値段	デルタニュートラル呼値
ボックス	同一限月において同一行使価格のコールの買付け及びプットの売付け、より高い行使価格でプットの買付け及びコールの売付けがそれぞれ1単位成立する取引			-低い行使価格のプットの値段 +低い行使価格のコールの値段 +高い行使価格のプットの値段 -高い行使価格のコールの値段	
シンセティックアンダーライニング	同一限月において同一行使価格のコールの買付け及びプットの売付けがそれぞれ1単位成立する取引			-プットの値段 +コールの値段	
3-Way: コールスプレッド対プット	同一限月取引において、コールの買付け、より高い行使価格コールの売付け、任意の行使価格のプットの売付けがそれぞれ1単位成立する取引			低い行使価格のコールの値段 -高い行使価格のコールの値段 -任意の行使価格のプットの値段	○
3-Way: プットスプレッド対コール	同一限月取引において、プットの買付け、より低い行使価格プットの売付け、任意の行使価格のコールの売付けがそれぞれ1単位成立する取引			高い行使価格のプットの値段 -低い行使価格のプットの値段 -任意の行使価格のコールの値段	○
3-way: ストラドル対コール	同一限月取引において、同一行使価格のプットの買付け及びコールの買付け、任意の行使価格のコールの売付けがそれぞれ1単位成立する取引			同一の行使価格のプットの値段 +同一の行使価格のコールの値段 -任意の行使価格のコールの値段	
3-way: ストラドル対プット	同一限月取引において、同一行使価格のプットの買付け及びコールの買付け、任意の行使価格のプットの売付けがそれぞれ1単位成立する取引			同一の行使価格のプットの値段 +同一の行使価格のコールの値段 -任意の行使価格のプットの値段	
コールの買付け	コールの買付けが1単位成立する取引			コールの値段	○
プットの買付け	プットの買付けが1単位成立する取引			プットの値段	○