

先物オプション取引の予備コード設定について

2017年10月10日

証券コード協議会

先物・オプション取引識別コード仕様において、現物オプション取引（例：株価指数オプション取引）の「プット／コール区分、限月の予備コード」は規定されていますが、先物オプション取引（例：長期国債先物オプション取引）の「プット／コール現先区分、限月の予備コード」は現在規定されていません。

このため、当協議会では、株式会社大阪取引所からの要請を受け、権利行使価格の追加設定の増加に対応すべく、下記のとおり、先物オプション取引の「プット／コール現先区分、限月の予備コード」を新たに規定する方針です。先物・オプション取引識別コード仕様の改定は後日実施いたしますが、実務上の必要性を考慮して予めご連絡申し上げます。

記

1. 先物・オプション取引識別コードの構成

先物・オプション取引識別コードの構成は従前のとおり変更ありません。

①	②	③	④	⑤
特殊取引	プット／コール現先区分	限 月	権利行使価格等	対象指数等
1	□	□ □□	□□	□□

2. 先物オプション取引のプット／コール現先区分

コード

プットオプション取引（先物） 1 及び 5

コールオプション取引（先物） 2 及び 7

先物オプション取引のプット／コール現先区分の予備コードとして5及び7を追加します。予備コード5及び7は、先物オプション取引において新たな（銘柄権利行使価格）が設定される場合で、かつ同一限月内で、権利行使価格を表すコードに既に同じコードが設定されている場合に使用することとします。

なお、株式会社東京商品取引所に上場している金先物オプション取引は、プット／コールオプション（現物）を従前どおり使用することとします。

3. 先物オプション取引の限月

先物オプション取引において、新たな銘柄（権利行使価格）が設定される場合で、かつ、同一限月内で、「プット／コール現先区分」及び「権利行使価格を表すコード」にて既に同じコードが設定されている場合、限月の下2けたは次の月数コードを使用することとします。

月数コード		月数コード		月数コード	
1月	13	5月	17	9月	21
2月	14	6月	18	10月	22
3月	15	7月	19	11月	23
4月	16	8月	20	12月	24

【事例】長期国債先物オプション取引

桁数	1	2	3	4	5	6	7	8	9
区分	特殊取引	プット／コール現先区分	限月		権利行使価格等		対象指数等		
長期国債先物オプション取引(新)	1	【通常】 プット:1 コール:2 【予備】 プット:5 コール:7	限月(年) (10年サイクルの1桁) 2016年:1 2017年:2 .	限月(月) (月数を使用)		権利行使価格 2桁 権利行使価格を0.5で除した商の下2桁	対象指数等 2桁 01		
					通常				
				1月	01	13			
				2月	02	14			
				.	.	.			

4. 実施日

2018年2月13日（火）（予定）

以上

本件問合せ先

【証券コード全般について】

証券コード協議会

050-3377-7830（直通）

【長期国債先物オプション取引のコード設定について】

株式会社大阪取引所

市場企画部

050-3377-8636（直通）