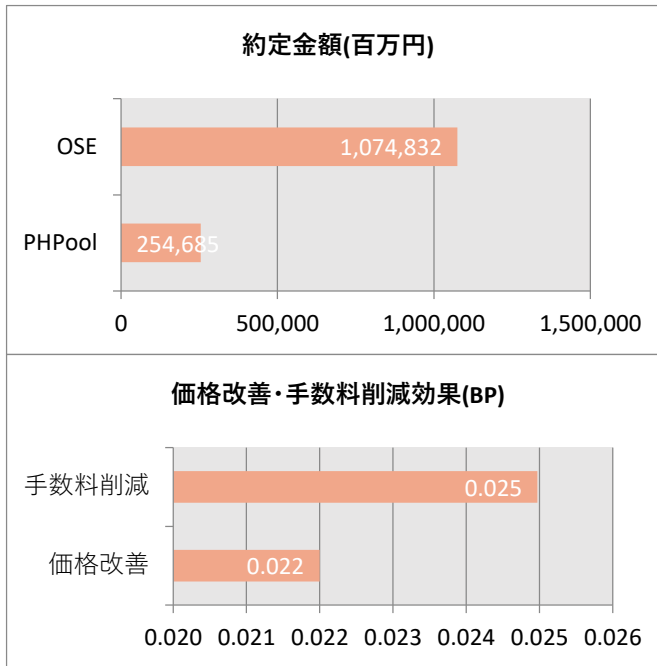


SOR執行評価：指数先物（PHPool約定分）

評価結果サマリ

評価対象期間	2024/03/11 - 03/29
月間合計約定金額(百万円)	1,329,517
月間合計約定件数	79,506
一日あたりの平均約定金額(百万円)	88,634
PHPoolの約定金額(百万円)	254,685
PHPoolの約定件数	21,753
一日あたりの平均約定金額(百万円)	16,979
改善効果計算対象の約定金額(百万円)	224,519
改善効果計算対象の約定件数	18,965
月間改善金額合計(円)	497,470
価格改善効果(BP)	0.02
約定一件あたり価格改善金額(円)	26.23
月間手数料削減金額合計(円)	636,000
手数料削減効果(BP)	0.03
約定一件あたり手数料削減金額(円)	29.24
比較価格が存在した約定件数	18,965
改善した約定件数	18,818
同価格での約定件数	0
劣後した約定件数	147



OSE:大阪取引所立会市場、PHPool:フリップ証券のダークプール

価格改善効果は、約定金額と、発注・約定時点における大阪取引所立会市場の気配価格(買注文の場合は売気配、売注文の場合は買気配) から算出した想定約定金額を比較し、ベースポイントBP (1BP=0.01%) の単位で表記しています。

商品別改善効果

PHPoolでの商品別の約定金額と価格改善した約定の改善効果を記載しています。

単位：約定金額は百万円、改善効果はBP

商品名	約定金額	改善効果
日経225先物	54,589	0.01
日経225mini	163,712	0.02
TOPIX先物	3,153	0.37
ミニTOPIX先物	2,668	0.17
JPX日経400先物	232	0.04
東証G250先物	110	1.36
NYダウ先物	56	0.03

商品別・セッション別改善率

PHPoolで約定した枚数に対するOSE気配価格より有利な価格で約定した枚数の割合を商品別、セッション別で記載しています。

商品名	日中	夜間
日経225先物	99.3%	99.8%
日経225mini	99.0%	99.5%
TOPIX先物	100.0%	100.0%
ミニTOPIX先物	98.9%	99.2%
JPX日経400先物	100.0%	100.0%
東証G250先物	100.0%	100.0%
NYダウ先物	100.0%	100.0%

OSE気配価格に劣後した約定

PHPoolで約定価格が約定時点でのOSE気配価格に劣後したと判定される約定の件数、約定金額、BPを掲載しています。

市場	約定金額(百万円)	約定件数	BP
PHPool	1,579	147	-1.44

先物SOR取引ご留意事項

- ・先物SOR発注時に対した価格が必ずしも約定時における有利な価格を保証するものではありません。
- ・約定価格がOSE気配価格と同値だった場合、OSE気配価格より有利な価格での流動性が十分でなかった可能性があります。
- ・約定価格がOSE気配価格より不利な価格だった場合、先物SOR発注から約定までのマイクロなレイテンシーや急激な価格変動により結果として立会市場の方が有利となった可能性があります。

©2024 QUICK Corp.

本レポートは、auカブコム証券株式会社の依頼により、株式会社QUICKが提供しています。本レポートおよび本レポートに含まれる情報（「本情報」）の著作権等の知的財産権は株式会社QUICKまたはその情報提供元に帰属します。本レポートの閲覧者（「閲覧者」）は、本レポートをご自身でのみ利用するものとし、第三者への提供、本情報の加工、編集、蓄積等を固く禁じます。本情報の内容につきましては、万全を期しておりますが、その正確性、信頼性等を保証するものではありません。閲覧者が本情報の利用または利用できないことにより被ったいかなる損害も、auカブコム証券株式会社、株式会社QUICKおよび情報提供元は一切責任を負いません。