

ガソリン現金決済先物取引 取引要綱

2017年4月

| 項目 | 内容 | |
|------------------------|--|---|
| 取引開始日 | 2017年5月8日（日中立会から） | |
| 市場 | 石油 | |
| 商品 | ガソリン | |
| 取引の種類 | 現金決済先物取引（限月） | |
| 取引の対象 | JIS K2202 の 2 号の品質基準に適合するレギュラーガソリン （バージガソリン、ローリーガソリンとも） | |
| 帳入値段 | 1 計算区域の最終約定値段。当該計算区域に約定値段がない場合は、直前計算区域 （新甫限月にあっては直前限月）の帳入値段。 | |
| 最終決済価格 | 調査対象先が発表する日々の価格（以下「調査価格」*という。）をもとに、その月間総計 を採取日数で除した価格（バージガソリン、ローリーガソリンのそれぞれについて算出） | |
| 限月 | 新甫発会日の属する月から起算した 7 月以内の各月（7 限月制） | |
| 新甫発会日 | 当月限取引最終日の翌営業日（日中立会から） | |
| 当月限取引最終日 | 当月限の最終営業日（日中立会まで） | |
| 最終決済日 | 当月限の翌月第一営業日 | |
| 取引単位 | バージガソリン：50 キロリットル | ローリーガソリン：10 キロリットル |
| 呼値及び呼値の単位 | 1 キロリットル当たり 10 円刻み | |
| 立会時間 | 日中立会 寄付板合わせ：午前 8 時 45 分 ザラバ取引：午前 8 時 45 分～午後 3 時 10 分 引板合わせ：午後 3 時 15 分 夜間立会 寄付板合わせ：午後 4 時 30 分 ザラバ取引：午後 4 時 30 分～翌日午前 5 時 25 分 引板合わせ：翌日午前 5 時 30 分 | |
| 証拠金 | SPAN証拠金を適用。JCCHが証拠金額計算の基礎となる値（変数）を決定。 | |
| サーキットブレーカー幅 （SCB 幅） | 上下 10,000 円 夜間立会開始時に前計算区域の帳入値段を基に設定 | |
| 即時約定可能値幅 （DCB 幅） | 上下 400 円 基準値段（原則として直近約定値段）を基に設定 | |
| 建玉制限 | 設定しない。 | |
| 希望受渡し | 現金決済先物取引の「受渡決済の特例」として「希望受渡し」*を導入。 * 売建玉を有する取引参加者と買建玉を有する取引参加者が合意し、取引所が認めた場合 には、受渡決済を行うことができる制度。 | |
| 建玉の交換取引制度 | 当社市場における同一上場商品構成品の建玉について、当事者間で合意した場合には、 一方の市場における売り又は買いの立会外取引と、もう一方の市場における買い又は売りの 立会外取引を重量ベースで対応させ、建玉の交換を行うことができる制度を検討。 | |
| SCO の組合せ 【限月間スプレッド】 | 全限月の組合せ（21種類） ②-①、③-①、③-②、④-①、④-②、④-③、⑤-①、⑤-②、⑤-③、⑤-④、 ⑥-①、⑥-②、⑥-③、⑥-④、⑥-⑤、⑦-①、⑦-②、⑦-③、⑦-④、⑦-⑤、⑦-⑥ | |
| SCO の組合せ 【商品間スプレッド】 | バージガソリン： 同一限月（原油を含む場合は、石油製品 n月-原油n-1月の組合せ）、同一取引 単位（50kl）同士の組合せ（6種類） ガソ（現物先物）- ガソ（現金決済） 灯油（現物先物）- ガソ（現金決済） 軽油（現物先物）- ガソ（現金決済） ガソ（現金決済）- 灯油（現金決済） ガソ（現金決済）- 軽油（現金決済） ガソ（現金決済）- 原油（現金決済） | ローリーガソリン： 同一限月、同一取引単位（10kl）同士の 組合せ（4種類） 東京ガソ - 東京灯油 東京ガソ - 東京軽油 東京ガソ - 中京ガソ 東京ガソ - 中京灯油 |

| 項目 | 内容 | |
|------------------------|---|--------------------------------|
| | ※ 組合せごとのSCOの開始日及び最終日については別紙参照。 | ※ 組合せごとのSCOの開始日及び最終日については別紙参照。 |
| スマートCXにおいて取引所が定める価格変動率 | 10% ※ ストップロス取引実施細則に定める価格変動率は、現物先物取引のガソリンと同じ10%とする。 | |

以上