

灯油現金決済先物取引 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	灯油	
取引の種類	現金決済先物取引（限月）	
取引の対象	JIS K2203の1号の品質基準に適合する灯油 （バージ灯油、ローリー灯油とも）	
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（バージ灯油、ローリー灯油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	バージ灯油：50キロリットル	ローリー灯油：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】	バージ灯油： 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）- 灯油（現金決済） 灯油（現物先物）- 灯油（現金決済） 軽油（現物先物）- 灯油（現金決済） ガソ（現金決済）- 灯油（現金決済） 灯油（現金決済）- 軽油（現金決済） 灯油（現金決済）- 原油（現金決済）	ローリー灯油： 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 東京灯油 - 東京軽油 東京灯油 - 中京ガソ 東京灯油 - 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	11% ※ ストップロス取引実施細則に定める価格変動率は、現物先物取引の灯油と同じ11%とする。	

以上