

金利先物等取引における平均単価の導入について

平成30年1月4日
株式会社東京金融取引所

平素は、本取引所の運営に関し、格別のご高配を賜り厚く御礼申し上げます。

当社は、市場利用者の利便性の向上を目的として、金利先物等取引において、取引参加者が特定投資家などの顧客に対して取引報告を行う際に、一定の条件のもと、平均単価の利用が可能となるよう、制度要綱を取りまとめました。

本件に係る制度要綱（案）は、別紙の通りです。

以 上

金利先物等取引における平均単価の導入について（案）

1. 趣旨

市場デリバティブ取引において、平均単価（同一日における同一銘柄の取引の単価の平均額）を利用するニーズが顕在化してきたことを踏まえ、顧客が特定投資家である場合で、かつ、法令に基づき契約締結時交付書面の交付を要しない場合など、一定の条件のもとで、平均単価の利用が可能となるよう取引所規則の変更を行います。

2. 概要

項目	内容	備考
1. 市場デリバティブ取引に係る決済のために授受する金銭の計算等における平均単価の利用	・取引参加者は、法令に基づき契約締結時交付書面の交付を要しない顧客や取引残高報告書に平均単価を記載することができる顧客との間で、市場デリバティブ取引の決済のために授受する金銭の計算等において、約定価格に代わり、平均単価を用いることができます。	・顧客からの個別の取引に関する照会に対して速やかに回答できる体制が整備されている場合に限る。
2. 市場デリバティブ取引又は清算建玉に関する通知書への平均単価の利用等	・取引参加者が、市場デリバティブ取引又は清算建玉に係る未決済勘定がある顧客に対して送付する通知書について、法令に基づき取引残高報告書に平均単価を記載することができる顧客である場合は、平均単価を用いることができます。 ・顧客が特定投資家などである場合で、かつ、法令に基づき取引残高報告書の交付を要しない場合には、取引に関する通知書の送付を要しないものとします。	・取引に関する通知書には、現行、個別単価を記載することが求められています。

3. 実施時期

平成 30 年 2 月を予定しております。