

取引所為替証拠金取引システム更改に係る制度について

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。

さて、本取引所は、システム処理能力の増強と投資家の多様な取引ニーズへの対応を目的として、平成 20 年 10 月を目途に、取引所為替証拠金取引システムを更改する予定です。

この更改に伴い、取引所為替証拠金取引に係る既存の制度の変更、新制度の導入を行います。

本件につきましては、本年 7 月にパブリックコメントの募集を行いました。新たに上場する金融指標等の詳細が決まりましたので、追加項目につき改めて実施するものです。

以 上

取引所為替証拠金取引システム更改に係る制度について(Ⅱ)

平成 20 年 8 月 22 日
東京金融取引所

項 目	内 容	備 考
I. 新システム導入の時期・目的	<ul style="list-style-type: none"> ・ 本取引所は、(1)システム処理能力の増強(2)投資家の多様な取引ニーズへの対応を目的とし、平成 20 年 10 月を目途に取引所為替証拠金取引に使用する取引所システムを更改する予定である。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 本取引所は、平成 17 年 7 月の取引所為替証拠金取引の上場にあたり、現行システムを導入した。
II. 取引関連項目		
1. 取引の仕組み		
(1) 追加する金融指標	<ul style="list-style-type: none"> ・ 取引所為替証拠金取引の対象とする金融指標として以下のものを追加する。 <ul style="list-style-type: none"> (a) 南アフリカ共和国通貨一単位あたりの日本円相当額から算出する金融指標(当該金融指標に係る取引所為替証拠金取引を「南アランド・日本円取引所為替証拠金取引」という) (b) トルコ共和国通貨一単位あたりの日本円相当額から算出する金融指標(当該金融指標に係る取引所為替証拠金取引を「トルコリラ・日本円取引所為替証拠金取引」という) (c) ノルウェー王国通貨一単位あたりの日本円相当額から算出する金融指標(当該金融指標に係る取引所為替証拠金取引を「ノルウェークローネ・日本円取引所為替証拠金取引」という) (d) 香港特別行政区通貨一単位あたりの日本円相当額から算出する金融指標(当該金融指標に係る取引所為替証拠金取引を「香港ドル・日本円取引所為替証拠金取引」という) (e) スウェーデン王国通貨一単位あたりの日本円相当額から算出する金融指標(当該金融指標に係る取引所為替証拠金取引を「スウェーデンクローナ・日本円取引所為替証拠金取引」という) (f) メキシコ合衆国通貨一単位あたりの日本円相当額から算出する金融指標(当該金融指標に 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 現行では、以下の 7 種類の取引所為替証拠金取引を上場している <ul style="list-style-type: none"> 米ドル・日本円取引所為替証拠金取引 ユーロ・日本円取引所為替証拠金取引 英ポンド・日本円取引所為替証拠金取引 豪ドル・日本円取引所為替証拠金取引 スイスフラン・日本円取引所為替証拠金取引 カナダドル・日本円取引所為替証拠金取引 NZドル・日本円取引所為替証拠金取引

項 目	内 容	備 考
	<p>係る取引所為替証拠金取引を「メキシコペソ・日本円取引所為替証拠金取引」という)</p> <p>(g) ポーランド共和国通貨一単位あたりの日本円相当額から算出する金融指標(当該金融指標に係る取引所為替証拠金取引を「ポーランドズロチ・日本円取引所為替証拠金取引」という)</p> <p>(h) 欧州経済通貨統合参加国通貨一単位あたりのアメリカ合衆国通貨相当額から算出する金融指標(当該金融指標に係る取引所為替証拠金取引を「ユーロ・米ドル取引所為替証拠金取引」という)</p> <p>(i) 連合王国通貨一単位あたりのアメリカ合衆国通貨相当額から算出する金融指標(当該金融指標に係る取引所為替証拠金取引を「英ポンド・米ドル取引所為替証拠金取引」という)</p> <p>(j) 連合王国通貨一単位あたりのスイス連邦通貨相当額から算出する金融指標(当該金融指標に係る取引所為替証拠金取引を「英ポンド・スイスフラン取引所為替証拠金取引」という)</p> <p>(k) アメリカ合衆国通貨一単位あたりのスイス連邦通貨相当額から算出する金融指標(当該金融指標に係る取引所為替証拠金取引を「米ドル・スイスフラン取引所為替証拠金取引」という)</p> <p>(l) アメリカ合衆国通貨一単位あたりのカナダ通貨相当額から算出する金融指標(当該金融指標に係る取引所為替証拠金取引を「米ドル・カナダドル取引所為替証拠金取引」という)</p> <p>(m) オーストラリア連邦通貨一単位あたりのアメリカ合衆国通貨相当額から算出する金融指標(当該金融指標に係る取引所為替証拠金取引を「豪ドル・米ドル取引所為替証拠金取引」という)</p> <p>(n) 欧州経済通貨統合参加国通貨一単位あたりのスイス連邦通貨相当額から算出する金融指標(当該金融指標に係る取引所為替証拠金取引を「ユーロ・スイスフラン取引所為替証拠金取引」という)</p> <p>(o) 欧州経済通貨統合参加国通貨一単位あたりの連合王国通貨相当額から算出する金融指標(当該金融指標に係る取引所為替証拠金取引を「ユーロ・英ポンド取引所為替証拠金取引」という)</p> <p>(p) ニュージーランド通貨一単位あたりのアメリカ合衆国通貨相当額から算出する金融指標(当該金融指標に係る取引所為替証拠金取引を「NZ ドル・米ドル取引所為替証拠金取引」という)</p> <p>(q) 欧州経済通貨統合参加国通貨一単位あたりのオーストラリア連邦通貨相当額から算出する</p>	

項 目	内 容	備 考
<p>(2) 対円取引</p> <p>① 取引対象</p> <p>② 呼び値の表示</p> <p>③ 取引単位</p>	<p>金融指標(当該金融指標に係る取引所為替証拠金取引を「ユーロ・豪ドル取引所為替証拠金取引」という)</p> <p>(r) 連合王国通貨一単位あたりのオーストラリア連邦通貨相当額から算出する金融指標(当該金融指標に係る取引所為替証拠金取引を「英ポンド・豪ドル取引所為替証拠金取引」という)</p> <p>・ 新たに上場する取引所為替証拠金取引の対象とする金融指標のうち、対円取引は上記(2)に掲げる(a)～(g)となる。</p> <p>・ 対円取引のうち、以下の種類の取引所為替証拠金取引の呼び値は、外国通貨一単位あたりの日本円相当額を100分の1日本円単位で表示する。 トルコリラ・日本円取引所為替証拠金取引 ポーランドズロチ・日本円取引所為替証拠金取引</p> <p>・ 対円取引のうち、以下の種類の取引所為替証拠金取引の呼び値は、外国通貨一単位あたりの日本円相当額を1,000分の5日本円単位で表示する。 南アランド・日本円取引所為替証拠金取引 ノルウェークローネ・日本円取引所為替証拠金取引 香港ドル・日本円取引所為替証拠金取引 スウェーデンクローナ・日本円取引所為替証拠金取引 メキシコペソ・日本円取引所為替証拠金取引</p> <p>・ 対円取引のうち、以下の種類の取引所為替証拠金取引の取引単位は、10,000 外国通貨単位とする。 トルコリラ・日本円取引所為替証拠金取引 ポーランドズロチ・日本円取引所為替証拠金取引</p>	

項 目	内 容	備 考
<p>④ 呼び値の最小変動幅</p> <p>(3) クロスカレンシー取引</p> <p>① 取引対象</p> <p>② 呼び値の表示</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・ 対円取引のうち、以下の種類の取引所為替証拠金取引の取引単位は、100,000 外国通貨単位とする 南アランド・日本円取引所為替証拠金取引 ノルウェークローネ・日本円取引所為替証拠金取引 香港ドル・日本円取引所為替証拠金取引 スウェーデンクローナ・日本円取引所為替証拠金取引 メキシコペソ・日本円取引所為替証拠金取引 ・ 対円取引のうち、以下の種類の取引所為替証拠金取引の呼び値の変動幅は 0.01 とする。 トルコリラ・日本円取引所為替証拠金取引 ポーランドズロチ・日本円取引所為替証拠金取引 ・ 対円取引のうち、以下の種類の取引所為替証拠金取引の呼び値の変動幅は 0.005 とする。 南アランド・日本円取引所為替証拠金取引 ノルウェークローネ・日本円取引所為替証拠金取引 香港ドル・日本円取引所為替証拠金取引 スウェーデンクローナ・日本円取引所為替証拠金取引 メキシコペソ・日本円取引所為替証拠金取引 ・ 新たに上場する取引所為替証拠金取引の対象とする金融指標のうち、クロスカレンシー取引は上記(2)に掲げる(h)～(r)となる。 ・ クロスカレンシー取引の取引所為替証拠金取引の呼び値は、基準通貨一単位あたりの計算通貨相当額を 10,000 分の 1 計算通貨単位で表示する。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 最小変動幅は、0.01 円×10,000=100 円に相当する。 ・ 最小変動幅は0.005円×100,000=500円に相当する。

項 目	内 容	備 考
③ 取引単位	<ul style="list-style-type: none"> ・ クロスカレンシー取引の取引所為替証拠金取引の取引単位は、10,000 基準通貨単位とする。 	
④ 呼び値の最小変動幅	<ul style="list-style-type: none"> ・ クロスカレンシー取引の取引所為替証拠金取引の呼び値の変動幅は 0.0001 とする 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 最小変動幅は 0.0001 計算通貨×10,000=1 計算通貨に相当する。
Ⅲ. 清算関連項目		
1. 建玉等		
(1) 建玉の保有方法	<ul style="list-style-type: none"> ・ 非マーケットメイカー及び為替証拠金取引顧客の建玉保有及びその決済方法として次のいずれかの方法を認める。 <ul style="list-style-type: none"> (1) 転売又は買戻しに係る取引の数量をその有する売建玉又は買建玉について先に成立した建玉から順番に減じる方法 (以下「先入先出法」という。) (2) 同一の取引所為替証拠金取引において、売建玉と買建玉を同時に保有し、非マーケットメイカー又はその顧客の申告に基づき建玉を減じる方法 (以下「指定決済法」という。) ・ マーケットメイカーは、先入先出法のみとする。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 現行では、すべての取引参加者及び為替証拠金取引顧客が先入先出法で建玉を決済している。
(2) 建玉の算定	<ul style="list-style-type: none"> ・ 指定決済法においては、売建玉・買建玉のそれぞれが建玉として算定される。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 建玉の算定は、為替証拠金取引参加者の取引口座毎に、委託を行っている場合は為替証拠金取引顧客口座毎に行う。
(3) 転売又は買戻しの申告	<ul style="list-style-type: none"> ・ 先入先出法を選択した非マーケットメイカー及び為替証拠金取引顧客は、転売又は買戻しの申告の必要はない。 ・ 指定決済法を選択した非マーケットメイカー及び為替証拠金取引顧客は、保有する建玉を減じるための取引 (転売又は買戻し) を行った場合に、本取引所の定める方法に基づき、転 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 転売又は買戻しの申告は、為替証拠金取引参加者の取引口座毎に、委託を行っている場合は、為替証拠金取引顧客口座毎に行う。

項 目	内 容	備 考
<p>2. 為替差金決済</p> <p>(1) 概要</p>	<p>売又は買戻しの別、減じる建玉及び数量を特定する情報等を本取引所に申告するものとする。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 本取引所は、指定決済法に基づく申告を受付けた場合には、当該申告が非マーケットメイカーの自己取引に係るものであるときは、申告の数量を非マーケットメイカーの取引口座の売建玉又は買建玉から、委託取引に係るものであるときは、為替証拠金取引顧客の取引口座の売建玉または買建玉から減じるものとする ・ 申告数量の上限は、同時に保有する売建玉及び買建玉数量のいずれか少ない数量とする。 ・ 指定決済法に基づく申告は、当該取引を行った取引日に限定せず、当該取引を行った取引日の翌取引日以降にも認める。 ・ 指定決済法に基づく申告は、対円取引、クロスカレンシー取引ともに当該取引を行った取引日中に行う場合には当該取引を行ったときから、当該取引を行った翌取引日以降に行う場合にはプレオープン時間帯から行うものとする。 ・ 指定決済法に基づく申告は、取引所為替証拠金取引の付合せ終了時刻の10分後までに行うものとする。 ・ 指定決済法に基づく申告によって保有する両建ての建玉を減じる場合、当該建玉について、当該申告を行なった日の前取引日分までの更新為替評価損益とスワップポイントが累計される。 <p>・ 非マーケットメイカー及び為替証拠金取引顧客の売建玉又は買建玉の決済は、対円取引、クロスカレンシー取引ともに、先入先出法あるいは指定決済法による建玉の結了がなされた建玉に係る決済為替差金が円通貨によって確定し、本取引所が定める決済期日に為替取引証拠金に振替えられる。</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・ 決済為替差金とは、先入先出法あるいは指定決済法による建玉の結了がなされた建玉にかかる、為替取引証拠金に振替えられる前の為替差金をいう。 ・ 為替証拠金清算参加者からの入出金指示がな

項 目	内 容	備 考
(2) 引直為替評価損益	<ul style="list-style-type: none"> 取引により新たに成立した取引所為替証拠金取引についてロールオーバーがなされた場合において、当該取引が成立した取引日の為替清算価格と当該取引の約定価格とを比較して差が生じているときは、当該価格の差に基づいて算出した正または負の計算上の数額である為替評価損益(引直為替評価損益)が発生するものとする。 	<p>ければ実際の入出金処理は発生しない。</p>
(3) 更新為替評価損益	<ul style="list-style-type: none"> 前取引日までの取引により成立した取引所為替証拠金取引についてロールオーバーがなされた場合において、当該ロールオーバーのなされた付合せ時間帯終了時の属する取引日の為替清算価格と当該取引日の前取引日の為替清算価格(前日為替清算価格)とを比較して差が生じているときは、当該価格の差に基づいて算出した正または負の計算上の数額である為替評価損益(更新為替評価損益)が発生するものとする。 	
(4) 決済為替評価損益	<ul style="list-style-type: none"> 先入先出法において、当該転売又は買戻しに係る約定価格と、以下の各号に定める価格とを比較して差が生じているときは、当該価格の差に基づいて算出した正又は負の計算上の数額である為替評価損益(決済為替評価損益)が発生するものとする。 <ul style="list-style-type: none"> (1) 当該建玉が転売又は買戻しが行われた取引日と同じ取引日に成立している場合は、当該取引の約定価格 (2) 当該建玉が当該転売又は買戻しの行われた取引日の前取引日までに成立している場合は前日為替清算価格 指定決済法において、以下の各号に定める数額を比較して差が生じているときは、当該差額に基づいて算出した正又は負の計算上の数額である決済為替評価損益が発生するものとする。 <ul style="list-style-type: none"> (1) 当該売建玉と買建玉の双方が、指定決済法に基づく申告が行われた取引日と同じ取引日に成立している場合は、当該取引の約定価格の差 (2) 当該売建玉と買建玉のうち一方が、指定決済法に基づく申告が行われた取引日の前 	<ul style="list-style-type: none"> 指定決済法において、売建玉と買建玉の双方が、当該申告が行われた取引日の前取引日までに成立しているとき、決済為替評価損益は零になる。

項 目	内 容	備 考
<p>(5) 為替差金</p>	<p>取引日までに成立し、かつ、他方が当該申告日に成立している場合は、約定価格と前日為替清算価格の差</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 為替差金決済の対象となる為替差金とは、取引所為替証拠金取引に係る建玉について発生した以下に掲げる計算上の数額の合計額をいう。 <ul style="list-style-type: none"> (1) 引直為替評価損益の数額 (2) 更新為替評価損益の累計額 (3) 決済為替評価損益の数額 (4) スワップポイントの数額の合計額 ・ 為替差金の算出は、上記(1)～(4)の為替差金の項目ごとに行う。 ・ 先入先出法あるいは指定決済法による建玉の結了がなされるまでの間のクロスカレンシー取引の為替差金は、対円取引の清算価格にて円通貨額を計算し、証拠金過不足や出金可能額の判定を行う。 ・ 先入先出法あるいは指定決済法による建玉の結了がなされた場合のクロスカレンシー取引の為替差金は、当該先入先出法あるいは指定決済法による建玉の結了がなされた取引日の対円取引の当日清算価格にて、円通貨額を確定する。 	
<p>(6) 決済に係る為替差金の振替</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・ 決済為替差金は、先入先出法あるいは指定決済法により建玉の結了がなされた取引日の決済期日の午前 10 時までに、為替取引証拠金に振り替えられるものとする。 	

以 上