

ユーロ円3カ月金利先物



金融取

金融取のユーロ円 3 ヶ月金利先物

●ユーロ円 3 ヶ月金利先物とは

ユーロ円 3 ヶ月金利先物とは、将来のある一定の日付から始まるユーロ円の 3 ヶ月金利を予想し、現時点での価格を決める取引です。これにより、将来の円資金取引のレートを現時点で予約する効果が得られ、将来起こり得る円の短・中期金利の変動リスクを軽減すること等が可能となります。

●ユーロ円 3 ヶ月金利先物の商品概要

ユーロ円 3 ヶ月金利先物	
取引対象	全銀協 TIBOR 運営機関 (JBATA) が公表する期間 3 ヶ月のユーロ円 TIBOR * ¹
取引単位 (想定元本)	元本金額 1 億円
価格の表示方法	100 から金利 (%、90/360 日ベース) を差し引いた数値
最小変動幅・価値	0.005 (0.005%) で 1,250 円 (1 億円 × 0.005% × 90 日 / 360 日 = 1,250 円)
限月設定	四半期毎の限月 (3、6、9、12 月限) を 20 限月 (5 年) 四半期以外のシリアル限月を直近 2 限月 * ²
取引最終日	限月第 3 水曜日の 2 営業日前
最終決済日	取引最終日の翌営業日
最終決済方法	差金決済
新たな限月の取引開始日	取引最終日の翌営業日
最終決済価格	JBATA が取引最終日に公表する期間 3 ヶ月のユーロ円 TIBOR の小数点以下第 3 位未満を四捨五入したものを 100 から差し引いた数値
取引の成立方法	オークション方式
ストラテジー取引	カレンダーズプレッド (インプライド機能あり) * ³
ブロック取引	あり (最低申込数量: 100 枚)

* 1: TIBOR (Tokyo InterBank Offered Rate) は全銀協 TIBOR 運営機関が毎営業日公表している、午前 11 時時点の東京市場での銀行間貸し出し金利です。

* 2: シリアル限月は、四半期限月を除いた月で設定します。例えば 4 月 1 日時点では 4 月限、5 月限、5 月 1 日では 5 月限、7 月限、6 月 1 日では 7 月限、8 月限 (6 月限は四半期限月として設定) です。

* 3: インプライド機能とは、ストラテジーでない通常の注文 (アウトライイト注文) と、ストラテジー注文を連動させて、相互の流動性を活用することでストラテジーおよびアウトライイト双方で取引が成立するチャンスを高める機能です。複数のアウトライイト注文からストラテジー注文を合成する機能をインプライドイン、ストラテジー注文から複数のアウトライイト注文を派生させる機能をインプライドアウトといいます。

●ユーロ円 3 ヶ月金利先物の取引時間

取引時間	8:30	—	8:45	プレオープン
	8:45	—	11:30	日中取引
	11:30	—	12:30	取消・数量削減専用時間
	12:30	—	15:30	日中取引
	15:30	—	20:00	夜間取引
取引最終日限月の取引時間	8:30	—	8:45	プレオープン
	8:45	—	11:00	日中取引

金利先物等取引は、差し入れた証拠金以上の取引金額を扱うため、取引対象である金利の変動等により差し入れた証拠金以上の損失が発生する可能性があります。限月によっては、平時から流動性の低いものもあります。投資の際には、金融商品取引業者より交付される契約締結前交付書面等の内容を十分理解した上で、ご自身の判断で行うことが重要です。