

限日現金決済先物取引における理論現物価格決定細則の変更について

1. 変更の概要

現行、限日現金決済先物取引（ゴールドスポット及びプラチナスポット）の帳入値段は、当該限日現金決済先物取引の対象となる現物先物取引の1番限月（当月限納会日にあっては2番限。以下同じ。）及び6番限月の帳入値段をもとにフォワードレート（当社市場内における想定上の貸借に係る利率をいう。）を算出し、当該利率と現物先物取引の1番限月の帳入値段から算出した理論価格としています。

今般、限日現金決済先物取引の理論現物価格の算出対象とする限月について、流動性が低く、かつ受渡しを望まない者の手仕舞いなどの内部要因の取引を受けることで大きく価格が変動する可能性のある現物先物取引の1番限を外し、代わりに2番限（及び6番限）を対象に限日現金決済先物取引の理論価格（帳入値段）を算出することとします。

2. 変更の内容

- ・第2条（理論現物価格の定義）及び第3条（理論現物価格の算出方法）

限日現金決済先物取引の理論現物価格を算出する際の現物先物取引の対象限月について、1番限を対象外とし2番限（及び6番限）とする旨変更します。

3. 実施時期

2018年5月7日に施行します。