

平成28年8月31日

お客様各位

株式会社アステム

東京商品取引所システム更改に伴う取引ルール変更のお知らせとご注意

拝啓 時下ますます御健勝のこととお慶び申し上げます。

平素は格別のご高配を賜り、厚く御礼申し上げます。

さて、株式会社東京商品取引所では、平成28年9月20日（火）に、現行の取引システムを、JPX（日本取引所グループ）の新取引システムに移行するシステム更改を予定しております。これに伴い、現行システム取引最終日の平成28年9月16日（金）16：30から、翌9月17日（土）4：00までの夜間取引は休止となります。また、平成28年9月16日の日中取引終了時点において、有効期限が平成28年9月20日以降となっている未約定のご注文につきましては、全てキャンセルされます（スマートCXのストップロス注文を除く）。

有効期限が平成28年9月20日以降のご注文に関しましては、新システム稼働となる同日の日中取引以降に再度ご注文下さいますよう、何卒よろしくお願い申し上げます。

取引ルールの変更についての主なポイントは下記のとおりとなりますのでお知らせ致します。

記

変更予定日 平成28年（2016年）9月20日 火曜日

項目	次期システム	現行システム	備考
取引時間	日中立会 8時45分～15時15分 夜間立会 16時30分～翌暦日5時30分 (ゴムは19時まで)	日中立会 9時00分～15時15分 夜間立会 16時30分～翌暦日4時00分 (ゴムは19時まで)	日中立会の取引開始を15分繰上げ夜間立会の取引終了を1時間30分延長（ゴムは現行どおり）
注文受付開始時間	日中立会 8時00分から 夜間立会 16時15分から	日中立会 8時30分から 夜間立会 16時15分から	日中立会の注文受付時間を30分繰上げ
寄板合わせ	立会開始時8時45分及び16時30分に寄板合わせを実施	立会開始時9時00分及び16時30分に寄板合わせを実施	
ザラバ	日中立会 8時45分～15時10分 夜間立会 16時30分～翌暦日5時25分 (ゴムは16時30分～18時55分)	日中立会 9時00分～15時15分 夜間立会 16時30分～翌暦日4時00分 (ゴムは16時30分～19時00分)	引板合わせの5分前にザラバは終了 引板合わせまでの5分間は注文受付のみで約定は成立しない
引板合わせ	5分間の注文受付時間を設け、立会終了時 日中立会 15時15分 夜間立会 翌暦日5時30分 (ゴムは19時00分)	—	日中立会及び夜間立会の最後に引板合わせを実施
板合わせの約定値段	最も高い\0のある値段に1tick加えた値段から、最も低い\0のある値段に1tick減じた値段のうち、約定数量が最大となる値段に約定ルールが一部変更	最も高い\0のある値段から、最も低い\0のある値段のうち、約定数量が最大となる値段	
訂正・取消不可時間帯（Non Cancel Period = NCP）	寄板合わせ前及び引板合わせ前に、訂正・取消注文を受付けない時間帯（1分間）を設定。ただし、日中立会終了時の引板合わせを除く。	—	

項目		次期システム		現行システム		備考	
帳入値 段	通常日	終値		算出基準時間帯のVWAP(出来高加重平均)		終値に変更	
	当月限納会日	日中立会におけるVWAP(出来高加重平均)		算出基準時間帯のVWAP(出来高加重平均)			
	ミニ 取引	通常日	変更なし		標準取引の帳入値段と同値		
		取引 最終日	標準取引の帳入値段と同値		標準取引の当月限納会日の日中立会始値 (最終決済価格と同じ)		標準取引の当月限納 会日の前営業日
ミニ 取引	最終決済価格	変更なし		標準取引の当月限納会日の日中立会始値			
	取引最終日	標準取引の当月限納会日の前営業日の日中立会 で取引終了		標準取引の当月限納会日の夜間立会 で取引終了			
新甫発会日		当月限納会日の翌計算区域の日中立会から新 甫発会		当月限納会日の翌計算区域の夜間立会から新 甫発会		新甫発会は日中立会 からに変更	
大納会における 夜間立会		年末の取引最終日(大納会)に翌計算区域の 夜間立会を実施		夜間立会を行わない			
発注可能値段		サーキットブレーカー(CB)幅の範囲内		前計算区域の帳入値段から上下2,000tick内			
CB発動の条件		市場状況を勘案し取引所が必要と認めた場合		CB幅外で注文が対当した場合			
CBの時間		市場状況を勘案し取引所が必要と認めた時間		5分間			
即時約定可能値幅 (DCB = Dynamic Circuit Breaker)の導入		直近約定値段を基準とする即時約定可能値幅 を導入。当該幅外で注文が対当した場合、30 秒間、立会の一時中断(DCB)。DCB中は注文 受付を行い、板合わせから再開。ただし、日中 立会開始時及び夜間立会開始時における寄板 合わせについては、当値幅は設定しない。引板 合わせ時には当値幅内で注文が対当した場 合に約定成立。		—			
即時約 定可能 値幅 (DCB 幅)及び CB幅	商品	DCB幅	CB幅	CB幅(当初)	CB幅(最大拡大時)	次期システム稼働当初 の値であり、稼働後も 市場状況を勘案し、定 期的に見直しされま す。DCB幅を定期見直 しにより変更する場 合は日中立会から反映 し、CB幅を定期見直 しにより変更する場 合は夜間立会から反映 します。	
	金(標準・ミニ・限 日)	40円	800円	150円	600円		
	銀	1.0円	30.0円	6.0円	24.0円		
	白金(標準・ミニ)	40円	800円	200円	800円		
	パラジウム	30円	300円	100円	400円		
	石油市場※1)	400円	10000円	2400円	9600円		
	中京石油市場※2)	400円	10000円	2400円	9600円		
	ゴム	1.5円	20.0円	5.0円	20.0円		
	一般大豆	500円	4800円	400円	1200円		
	小豆	100円	700円	350円	700円		
とうもろこし	250円	1500円	500円	1500円			
注文の名称変更	指値注文			LO(リミット・オーダー)			
	成行注文			MO(マーケット・オーダー)		全量約定を保証する ものではありません	
	対当値段条件付注文			MTLO(マーケット・トゥ・リミットオーダー)		挙動が変更になります	
対当値段条件付注文 (MTLO)の仕様	反対サイド(売注文であれば買側、買注文であ れば売側)に注文がない場合は注文がキャン セルされる。		反対サイドに注文がない場合は、同サイドの最良 気配値よりも1tick有利な価格のLOとして登録さ れる。				
SO注文(ストップ・オー ダー)のお取扱い	取引所のシステムでは廃止されますが、当社シ ステムの特殊注文にてご用意致します。		取引所のシステムで用意している注文の一種				
引板合わせ時注文の導入	引板合わせ時を執行条件とする、引成注文、及 び引指注文の発注が可能。		—				

※1 石油市場: ガソリン・灯油・原油・軽油

※2 中京石油市場: 中京ガソリン・中京灯油

以上

【お問い合わせ先】 株式会社アステム 管理部 TEL: 06-4790-3401