

最終清算数値の計算例

1. 米ドル/日本円先物及びユーロ/日本円先物の場合

- WMR外国為替ベンチマークのうち、取引最終日の**午後5時**における取引対象指数のイントラデイ・スポットレートの**Mid Rate**を小数点以下第5位で四捨五入して得た数値

2. 中国オフショア人民元/日本円先物の場合

- WMR外国為替ベンチマークのうち、取引最終日の**午後5時**における取引対象指数のイントラデイ・スポットレートの**Mid Rate**。ただし、当該指数は以下のとおり算出する米ドル/日本円と米ドル/中国オフショア人民元の**クロスレート**とする。

① 中国オフショア人民元/日本円のOffer Rateを算出する（小数点第5位で四捨五入）。

- $CNH/JPY \text{ offer} = (USD/JPY \text{ offer}) \div (USD/CNH \text{ bid})$

例) $157.8100 \div 7.2764 = 21.6879226 \rightarrow 21.6879$

② 日本円/中国オフショア人民元のBid Rateを算出する（小数点第5位で四捨五入）。

- $CNH/JPY \text{ bid} = (USD/JPY \text{ bid}) \div (USD/CNH \text{ offer})$

例) $157.7800 \div 7.2768 = 21.6826077 \rightarrow 21.6826$

③ 上記で算出したものを算術平均する（小数点以下第5位で四捨五入）。

- $CNH/JPY \text{ mid} = (CNH/JPY \text{ bid} + CNH/JPY \text{ offer}) \div 2$

例) $(21.6879 + 21.6826) \div 2 = 21.68525 \rightarrow 21.6853$

	USDBID	USDASK
CNH	7.2764	7.2768
JPY	157.7800	157.8100