

電力先物取引における取引制度の一部見直しについて

2021年7月28日
株式会社東京商品取引所

I. 趣旨

株式会社東京商品取引所では、電力先物取引において、取引の機会を広く提供することによる利便性向上を目的に、以下の見直しを行うこととします。

II. 概要

項目	内容	備考
1. 先物取引に係る限月の延長	<ul style="list-style-type: none">電力先物取引の期限は、新甫発会日の属する月の翌月（直前の取引最終日が当月限の属する月の最終営業日になるときは、新甫発会日の属する月）から起算した24月以内の各月とし、24限月制とします。	<ul style="list-style-type: none">毎年4月時点で翌年度分の先物取引が行えるよう、現行の15限月制から24限月制とします。
2. 立会外取引等の申出価格の値幅拡大	<ul style="list-style-type: none">立会外取引の申出を行うことが可能な値幅（価格帯）を拡大することとし、以下の申出価格の値幅に係る算式におけるパラメーターNを「2,000」とします。 $\text{申出価格の値幅} = X \pm (Y \times N\%)$ (X：①直近約定値段、①がなければ前営業日の帳入値段、Y：前営業日の帳入値段)	<ul style="list-style-type: none">現行の特例運用について制度化し、完全システム対応するものです。EFP、EFS取引も同様とします。

III. 実施時期（予定）

2022年4月を目途とします。

以 上