

電力先物に係る週間物取引の追加及びLNG先物の呼値の単位の見直し等に伴う業務規程等の一部改正について

2023年11月2日
株式会社東京商品取引所

I. 趣旨

当社は、当社のエネルギー市場の電力先物について週間物取引を追加することとし、また、LNG先物について呼値の単位の見直しを行います。

これに伴い、業務規程等の一部改正を行い、2024年3月18日から施行します（詳細については、規則改正新旧対照表をご覧ください）。

II. 改正概要

1. 電力先物への週間物取引の追加について

(1) 取引の対象等

- ・エネルギー市場の電力の現金決済先物取引の対象に、週間物取引を加えます。
- ・取引の種類は現金決済先物取引とします。
- ・取引の対象は、一般社団法人日本卸電力取引所（以下JEPXといいます。）において取引される毎週土曜日から翌週金曜日までの東京エリア及び関西エリアのベースロード電力及び日中ロード電力とします。

(2) 先物取引の期限等

- ・取引の期限は、原則として新甫発会日が属する週の翌週から起算した5週以内の各週とし、5限月制とします。週間日中ロード電力について、対象週に平日（当社が指定します。以下同じ。）が一日もない場合は当該限月は設定しません。
- ・新甫発会日は、取引最終日の翌営業日とし、日中立会から新甫限月の取引を開始します。
- ・取引最終日は、週間ベースロード電力は、毎週金曜日の前営業日、また週間日中ロード電力は、毎週金曜日（平日でない場合は順次繰り上げます。）の前営業日とします。なお、当月限の取引は日中立会をもって終了します。
- ・最終決済日は取引最終日の翌営業日とします。

(3) 取引単位、呼値及び呼値の単位

(備考)

・業務規程第14条等

・業務規程第17条

・業務規程第16条

・業務規程第15条

・業務規程第75条

- ・取引単位について、週間ベースロード電力は、毎週土曜日から翌週金曜日までの暦日数×24時間×100キロワット時によって得られる電力量(kWh)、週間日中ロード電力は、毎週土曜日から翌週金曜日までの平日数×12時間×100キロワット時によって得られる電力量(kWh)とします。
 - ・呼値は、1キロワット時(1kWh)とします。
 - ・呼値の単位は、1銭とします。
- (4) 最終決済価格
- ・最終決済価格は、週間ベースロード電力については最終決済の対象となる土曜日から翌週金曜日までの各暦日(午前0時から午後12時まで)、週間日中ロードについては最終決済の対象となる土曜日から翌週金曜日までの各平日(午前8時から午後8時まで)におけるJEPXのスポット取引の発表価格の週間総計を発表価格採取数で除した価格とします。
- (5) 定率参加料
- ・電力先物の週間物取引の売買約定に係る定率参加料は売又は買1枚につき週間ベースロード電力は37円、週間日中ロード電力は12円とします。
- (6) 建玉制限等
- ・電力先物の週間物取引については、建玉制限を設けます。
 - 例：委託者及び海外顧客の建玉数量の制限
各限月(売建玉と買建玉との差引き数量)
 - ・東エリア・週間ベースロード電力 5,000枚
 - ・東エリア・週間日中ロード電力 7,000枚
 - ・委託者等の計算による1限月の建玉が1枚を超える場合は当社への報告を求めることとします。
- (7) 即時約定可能値幅等
- ・即時約定可能値幅の基準となる値段は、各限月の取引において、同一計算区域における直近の約定値段(直近の約定値段がない場合は前計算区域の帳入値段。ただし、新甫発会限月にあつては、当社がその都度定める取引開始日における基準値段)を採用します。
- ・業務規程第18条
 - ・エネルギー最終決済価格決定細則第4条等
 - ・取引参加料等に関する細則第3条
 - ・エネルギー市場管理細則第2条及び第3条
 - ・エネルギー市場管理細則第7条
 - ・システム売買実施細則別表3(第12条関係)

- ・即時約定可能値幅は、寄付板合わせは 6.00 円、ザラバ取引は 5.00 円、引板合わせは 6.00 円とします。

(8) サーキットブレーカー幅等

- ・サーキットブレーカー幅を設定するための基準値段は、前計算区域の帳入値段（新甫発会限月にあつては、当社がその都度定める取引開始日における基準値段）とします。
- ・サーキットブレーカー幅は 8.00 円とします。

- ・システム売買実施細則別表 4（第 14 条関係）

2. LNG 先物の呼値の単位変更について

- ・LNG 先物の呼値の単位を、1 円に変更します。

- ・業務規程第 18 条

3. その他

- ・その他、所要の改正を行うものとします。

Ⅲ. 施行日

- ・2024 年 3 月 18 日から施行します。
- ・ただし、売買システムの稼働に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、当該日に施行することが適当でない場合には、当該日から 3 月以内の日で、当社が別に定める日から施行します。

以 上