

# 会報

2020年4月 No.124号 (別冊)

## ■海外金融先物市場の主要金融先物・オプション商品の概要(2020年2月現在)

CME . . . . . (02)	ICE Futures Europe . . . (27)	HKEX . . . . . (40)
CBOT . . . . . (16)	Eurex . . . . . (32)	KRX . . . . . (41)
ICE Futures US . . . . . (19)	CurveGlobal . . . . . (35)	TAIFEX . . . . . (42)
NASDAQ PHLX . . . . . (22)	MOEX . . . . . (36)	
TMX . . . . . (23)	ASX 24 . . . . . (37)	
B3 . . . . . (25)	SGX - DT . . . . . (39)	(掲載頁)

本概要は、ご参考のために2020年2月末現在で作成したものであり、商品内容や取引方法の詳細については各取引所の説明書等によりご確認下さい。

参考資料：各取引所の Contract Specifications

## 1. シカゴ・マーカンタイル取引所(CME)

### (Chicago Mercantile Exchange)

#### (1) 金利先物

商品名	Three-Month Eurodollar Futures ユーロドル金利 (3 ヶ月) 先物	One-Month Eurodollar Futures ユーロドル金利(1 ヶ月)先物
取引開始	1981 年 12 月	1990 年 4 月
取引時間	日曜日～金曜日 5:00p. m. -4:00p. m. 最終取引日：ロンドン時間 11:00a. m.	左に同じ
取引単位	USD2,500×契約 IMM 指数	左に同じ
上場限月	四半期月の 40 限月及びシリアル 月の 4 限月 <sup>1</sup>	12 暦月
銘柄コード	GE	GLB
価格の表示方法(R)	契約 IMM 指数= 100 - R R は、限月第 3 水曜日の 3 ヶ月 LIBOR 金利	契約 IMM 指数= 100 - R R は、限月第 3 水曜日の 1 ヶ月 LIBOR
価格の最小変動幅	0.005(USD12.50 に相当)、最期近 限月は 0.0025(USD6.25 に相当)	0.0025(USD6.25 に相当)
値幅制限	なし <sup>2</sup>	左に同じ
建玉制限	全限月合計の買建と売建の差 1 万 枚以上の場合、建玉情報を報告 <sup>3</sup>	左に同じ
最終取引日	限月の第 3 水曜日の 2 ロンドン営 業日前 <sup>4</sup>	左に同じ
最終決済方法	差金決済 (最終取引日ロンドン時 間 11:00a. m. の ICE レートを基準)	差金決済(最終取引日ロンドン時 間 11:00a. m. の IBA LIBOR を基準)
最終決済日	最終取引日	最終取引日
2018 年出来高 (枚)	765,208,581	32,337
2019 年出来高 (枚)	687,072,595	451

IBA LIBOR は、ICE Benchmark Administration London Interbank Offered Rate の略称です。

<sup>1</sup> : 3、6、9 及び 12 月を「四半期月」と、その他の月を「シリアル月」といいます。以下同じ。

<sup>2</sup> : 一日の値幅制限はありませんが、サーキットブレーカーが設けてあります。

<sup>3</sup> : 取引目的、ヘッジ対象資産などについて報告します。

<sup>4</sup> : ロンドン営業日は、ロンドン市の銀行の営業日をいいます。

商品名	Three-Month SOFR Futures SOFR (3 ヶ月) 先物	One-Month SOFR Futures SOFR(1 ヶ月)先物
取引開始	2018 年 5 月	2018 年 5 月
取引時間	日曜日～金曜日 5:00p. m. -4:00p. m.	左に同じ
取引単位	USD2,500×契約等級 IMM 指数	USD4,167×契約等級 IMM 指数
上場限月	39 四半期月限月	13 暦月
RR 銘柄コード	SR3	SR1
価格の表示方法 (R)	契約 IMM 指数は、100-R。R は契約参照四半期中の複利 SOFR 金利	契約 IMM 指数は、100-R。R は、契約受渡月中の平均 SOFR 金利
価格の最小変動幅	最終取引日まで 4 か月以内の限月が 0.0025 (USD6.25 に相当)、その他の限月が 0.005 (USD12.50 に相当)	最期近限月が 0.0025 (USD10.4175 に相当)、その他の限月が 0.005 (USD20.835 に相当)
値幅制限	なし <sup>2</sup>	左に同じ
建玉制限	全限月合計の 1 万枚以上の場合、建玉情報を報告 <sup>3</sup>	左に同じ
最終取引日	限月の第 3 水曜日の直前の取引所営業日	左に同じ
最終決済方法	差金決済 (最終取引日の直後の米国債市場営業日の最終決済価格を参照)	左に同じ
最終決済日	最終取引日	最終取引日
2018 年出来高 (枚)	1,096,606	
2019 年出来高 (枚)	9,102,848	

SOFR は、Secured Overnight Financing Rate の略です。

参照四半期は、限月の 3 ヶ月前の第 3 水曜日から (その日を含む) 限月の第 3 水曜日まで (その日を含まず) の期間です。

商品名	<b>Quarterly IMM SONIA Futures</b> 四半期ごと IMM SONIA 先物	<b>MPC SONIA Futures</b> MPC SONIA 先物
取引開始	2018 年 10 月	2018 年 10 月
取引時間	日曜日～金曜日 5:00p. m. -4:00p. m. 最終取引日：ロンドン時間 9:00a. m.	左に同じ
取引単位	GBP2, 500 指数ポイント	GBP2, 500 指数ポイント
取引サイズ	GBP2, 500×契約等級 IMM 指数（契約等級 IMM 指数）	左に同じ
上場限月	20 四半期月。但し、限月は、参照四半期の最初の月を表す。	英中央銀行が MPC 告示日を公表した直近の 4 参照間隔 最初の直近の上場契約は、限月が 2018 年 10 月（受渡月＝2018 年 11 月）
銘柄コード	SON	MPC
価格の表示方法 (R)	契約 IMM 指数：100-R R＝契約参照四半期中 <sup>5</sup> の複利日次 SONIA 金利	契約等級 IMM 指数：100-R R＝契約参照間隔 <sup>6</sup> 中の複利日次 SONIA 金利
価格の最小変動幅	取引最終日まで 4 ヶ月以内の契約が 0.0025 IMM 指数ポイント（£6.25 に相当）； その他が 0.005 IMM 指数ポイント。（£12.50 に相当） 最小最終決済変動：0.0001 IMM 指数ポイント	0.005 指数ポイント（£12.50 に相当）、但し、(i)その限月の参照間隔が始まる日の直前の月曜日、その月曜日が営業日である場合、又は(ii)当該月曜日が営業日でない場合、当該月曜日の翌営業日いずれかの時点において、0.0025 指数ポイント（£6.25 に相当）
建玉制限	報告水準 500 枚、説明責任基準 1000 枚	左に同じ
最終取引日	受渡月の第 3 水曜日	契約参照間隔の最終日の翌銀行営業日のロンドン 9:00a. m.
最終決済方法	差金決済	左に同じ

<sup>5</sup>：受渡月の 3 ヶ月前の第 3 水曜日から（その日を含む）受渡月の第 3 水曜日まで（その日を含まず）の間隔です。

<sup>6</sup>：限月の直前の予定された英中央銀行 MPC 告示日から（その日を含む）受渡月の予定された MPC 告示日まで（その日を含まず）の間隔です。MPC 告示日は、英中央銀行により時々公表されます。

2018 年出来高 (枚)	298,611
2019 年出来高 (枚)	2,212,780

SONIA は、英ポンド翌日物指数平均金利 (Sterling Overnight Index Average) の略です。SONIA は、ベンチマーク管理者である英国中央銀行からのライセンスに基づき使用されます。

SONIA は、信用、流動性その他のリスクが最小である場合の英ポンドの短期ホールセール資金に金利が支払われる年当たりの金利の測度です。英国銀行休日でない週日 (英国銀行日) について、SONIA は、適格英ポンド建て預金取引に支払われる金利の取引数量加重四分位平均として計算されます。

IMM は、国際通貨市場 (International Monetary Market) の略です。

MPC は、金融政策委員会 (Monetary Policy Committee) の略です。

Quarterly IMM SONIA (SON) futures と MPC SONIA futures との主な違いは、SON futures 契約における金利エクスポージャーの間隔が契約参照四半期であり、それは、典型的には、13 週に及びます。具体的には、ある受渡月について、参照四半期は、その受渡月の 3 ヶ月前の第 3 水曜日から (その日を含む) その受渡月の第 3 水曜日まで (その日を除く) です。契約の参照四半期の最初の日及び最終の日が決定し、取引所がその契約を上場すれば、参照四半期は、その後発表された予定されていないロンドン銀行休日に関わらず、契約最終決済まで固定され続けます。MPC SONIA futures は、MPC 会合の日付間のエクスポージャーを管理するに当たって、より精密さを必要とする市場参加者のニーズに適合するよう設計されています。参照四半期は、受渡月の 3 ヶ月前の第 3 水曜日から (その日を含む) 受渡月の第 3 水曜日まで (その日は含まず) の間隔です。

参照間隔は、限月の予定された MPC 告示日から (その日を含む) 受渡月の予定された MPC 告示日まで (その日は含まず) の間隔です。

## (2) 通貨先物

商品名	Japanese Yen Futures 日本円通貨先物 <sup>7</sup>	Euro FX Futures ユーロ FX 通貨先物 <sup>8</sup>
取引開始	1972 年 5 月	1998 年 5 月
取引時間	日曜日～金曜日 5:00p. m. -4:00p. m. 最終取引日 : 9:16a. m.	左に同じ
取引単位	12, 500, 000 円	EUR125, 000
上場限月	3 連続暦月及び四半期月の 20 限月	左に同じ
銘柄コード	6J	6E
価格の表示方法	1 円当たりの米ドル表示(または 100 円当たりの米セント表示)	1EUR 当たりの米ドル表示
価格の最小変動幅	0. 0000005 (100 円当たり 0. 005 セント) (USD6. 25 に相当) <sup>9</sup>	0. 00005 (USD6. 25 に相当) <sup>9</sup>
値幅制限	なし <sup>2</sup>	左に同じ
建玉制限	全限月合計の買建と売建の差 1 万枚以上の場合、建玉情報を報告 <sup>3</sup>	左に同じ
最終取引日	限月の第 3 水曜日の 2 営業日前	左に同じ
最終決済方法	受渡決済	左に同じ
最終決済日	限月の第 3 水曜日	左に同じ
2018 年出来高 (枚)	36, 979, 311	68, 785, 137
2019 年出来高 (枚)	32, 573, 773	52, 490, 124

<sup>7</sup> : 取引単位が半分 (6, 250, 000 円) の E-Mini 日本円通貨先物及び取引単位が 1, 250, 000 円の E-Micro 日本円通貨先物も上場されています。

<sup>8</sup> : 取引単位が半分 (EUR62, 500) の E-Mini ユーロ FX 通貨先物及び取引単位が EUR12, 500 の E-Micro ユーロ FX 通貨先物も上場されています。

<sup>9</sup> : 一定の条件で半分幅も可能です。

商品名	<b>Swiss Franc Futures</b> スイスフラン通貨先物	<b>British Pound Futures</b> 英ポンド通貨先物
取引開始	1972年5月	1972年5月
取引時間	左に同じ	左に同じ
取引単位	CHF125,000	GBP62,500
上場限月	四半期月の20限月	3連続暦月及び四半期月の20限月
銘柄コード	6S	6B
価格の表示方法	1CHF当たりの米ドル表示	1GBP当たりの米ドル表示
価格の最小変動幅	0.0001 (USD12.50に相当) <sup>9</sup>	0.0001(USD6.25に相当)
値幅制限	左に同じ	左に同じ
建玉制限	左に同じ	左に同じ
最終取引日	左に同じ	左に同じ
最終決済方法	左に同じ	左に同じ
最終決済日	左に同じ	左に同じ
2018年出来高(枚)	7,262,353	32,439,027
2019年出来高(枚)	7,146,431	30,542,256

商品名	<b>Canadian Dollar Futures</b> カナダドル通貨先物	<b>Australian Dollar Futures</b> 豪ドル通貨先物
取引開始	左に同じ	1987年1月
取引時間	左に同じ	左に同じ
取引単位	CAD100,000	AUD100,000
上場限月	左に同じ	左に同じ
銘柄コード	6C	6A
価格の表示方法	1CAD当たりの米ドル表示	1AUD当たりの米ドル表示
価格の最小変動幅	0.00005(USD5.00に相当) <sup>9</sup>	0.0001(USD10.00に相当)
値幅制限	左に同じ	左に同じ
建玉制限	全限月合計の買建と売建の差 6,000枚以上の場合、建玉情報を 報告 <sup>3</sup>	左に同じ
最終取引日	限月の第3水曜日の1営業日前	限月の第3水曜日の2営業日前
最終決済方法	左に同じ	左に同じ
最終決済日	左に同じ	左に同じ
2018年出来高(枚)	21,019,365	28,062,547

2019 年出来高 (枚)	20, 006, 463	25, 229, 626
---------------	--------------	--------------

商品名	<b>New Zealand Dollar Futures</b> ニュージーランドドル通貨先物	<b>Mexican Peso Futures</b> メキシコペソ通貨先物
取引開始	1997 年 5 月	1995 年 4 月
取引時間	左に同じ	左に同じ
取引単位	NZD100, 000	MXN500, 000
上場限月	四半期月の 6 限月	13 暦月及びその後の四半期月の 2 限月
銘柄コード	6N	6M
価格の表示方法	1NZD 当たりの米ドル表示	1MXN 当たりの米ドル表示
価格の最小変動幅	左に同じ	0. 00001 (USD5. 00 に相当)
値幅制限	左に同じ	左に同じ
建玉制限	全限月合計の買建と売建の差 6, 000 枚以上の場合、建玉情報を報告 <sup>3</sup>	スポット限月 4. 5 万枚。全限月合計の買建と売建の差 6, 000 枚以上の場合、建玉情報を報告 <sup>3</sup>
最終取引日	左に同じ	左に同じ
最終決済方法	左に同じ	左に同じ
最終決済日	左に同じ	左に同じ
2018 年出来高 (枚)	7, 552, 938	17, 081, 210
2019 年出来高 (枚)	6, 974, 345	15, 064, 180

商品名	<b>South Africa Rand Futures</b> 南アフリカランド通貨先物	<b>Brazilian Real Futures</b> ブラジルリアル通貨先物
取引開始	1997 年 5 月	1995 年 11 月
取引時間	左に同じ	左に同じ
取引単位	ZAR500, 000	BRL100, 000
上場限月	13 暦月及びその後の四半期月の 2 限月	60 連続暦月
銘柄コード	6Z	6L
価格の表示方法	1ZAR 当たりの米ドル表示	1BRL 当たりの米ドル表示
価格の最小変動幅	0. 000025 (USD12. 500 に相当)	0. 00005 (USD5 に相当)
値幅制限	左に同じ	左に同じ
建玉制限	スポット限月 2 万枚先物相当。全限月合計の買建と売建の差 6, 000	ネット 3 万枚先物相当



	枚以上の場合、建玉情報を報告 <sup>3</sup>	
最終取引日	左に同じ	限月の直前の月で、ブラジル中央銀行が月末 (EOM) の現金受渡しの BRL/USD の商業為替レートを公表する日の最終営業日
最終決済方法	左に同じ	左に同じ
最終決済日	左に同じ	左に同じ
2018 年出来高 (枚)	593,301	1,624,599
2019 年出来高 (枚)	707,052	2,177,897

商品名	<b>Russian Ruble Futures</b> ロシアルーブル通貨先物	<b>EFX/BP Cross Rates Futures</b> ユーロ/英ポンド・クロス通貨先物
取引開始	2003 年 1 月	2007 年 1 月
取引時間	日曜日～金曜日 5:00p. m. -4:00p. m. 最終取引日：モスクワ時間 11:00a. m.	日曜日～金曜日 5:00p. m. -4:00p. m. 最終取引日：9:16a. m.
取引単位	RUB2,500,000	EUR125,000
上場限月	12 暦月及びその後の四半期月の 16 限月	3 連続暦月及び四半期月の 6 限月
銘柄コード	6R	RP
価格の表示方法	1RUB 当たりの米ドル表示	1EUR 当たりの GBP 表示
価格の最小変動幅	0.000005 (USD12.5 に相当)	0.00005 (GBP6.25 に相当)
値幅制限	左に同じ	左に同じ
建玉制限	ネット 6 万枚先物相当	スポット限月 2 万枚先物相当。 全限月合計の買建と売建の差 6,000 枚以上の場合、建玉情報を 報告 <sup>3</sup>
最終取引日	限月の 15 日	限月の第 3 水曜日の 2 営業日前
最終決済方法	差金決済	受渡決済
最終決済日	最終取引日の翌日	限月の第 3 水曜日
2018 年出来高 (枚)	769,150	1,064,898
2019 年出来高 (枚)	1,055,559	1,184,463

商品名	<b>EFX/JY Cross Rates Futures</b> ユーロ/円クロス通貨先物
取引開始	2007年1月
取引時間	左に同じ
取引単位	左に同じ
上場限月	四半期月の6限月
銘柄コード	RY
価格の表示方法	1EUR当たりのJPY表示
価格の最小変動幅	0.01(JPY1,250に相当)
値幅制限	左に同じ
建玉制限	左に同じ
最終取引日	左に同じ
最終決済方法	左に同じ
最終決済日	左に同じ
2018年出来高(枚)	1,044,615
2019年出来高(枚)	895,395

(3) 金利先物オプション

商品名	<b>Options on Three-Month Eurodollar Futures</b>
	ユーロドル金利(3ヵ月)先物オプション
取引開始	1985年3月
取引時間	7:20a. m. -2:00p. m. (GLOBEX 日曜日～金曜日 5:00p. m. -4:00p. m. ) 四半期 月限月の最終取引日：ロンドン時間 11:00a. m.
取引単位	ユーロドル金利(3ヵ月)先物 1取引単位(USD1,000,000)
上場限月	四半期月の16限月及びシリアル月の4限月。 ミッドカーブ・オプション(1年、2年、3年、4年及び5年)は、四半期 月の4限月及びシリアル月の4限月。ミッドカーブ・オプション(3ヵ 月、6ヵ月及び9ヵ月)は、4四半期月限月及び2シリアル月限月。週 次1年、週次2年及び週次3年の各ミッドカーブ・オプションは、週ご と。
原商品	限月が四半期月のオプションは同限月の先物。 限月がシリアル月のオプションはその限月直後の四半期月限月の先物 (例：限月が1月のオプションは3月限月の先物)。四半期月限月のミッ ドカーブ・オプション(1年、2年、3年、4年及び5年)は、オプション 限月直後の四半期月から1年後、2年後、3年後、4年後又は5年後を 限月とする先物。シリアル月のミッドカーブ・オプション(1年、2年、 3年、4年及び5年)は、限月の次の四半期月限月の先物(例：2017年1 月又は2月に限月となるシリアル月のミッドカーブ・オプション(1年) の場合、2018年3月を限月とする先物)。3ヵ月ミッドカーブ・オプシ ョンは、オプション期日に最も近い次の四半期月から3暦月後に期日と なる先物。6ヵ月ミッドカーブ・オプションは、オプション期日に最も 近い次の四半期月から6暦月後に期日となる先物。9ヵ月ミッドカー ブ・オプションは、オプション期日に最も近い次の四半期月から9暦月 後に期日となる先物。週次ミッドカーブ・オプションは、直近の満了し ていない四半期ミッドカーブ・オプションから1年後、2年後又は3年 後に満了となる四半期月限月先物。
銘柄コード	Globex GE
価格の最小変動幅	IMM 指数ポイントで価格提示。原商品が最期近限月の場合、限月が最初 の2四半期月限月若しくは最初の4シリアル限月でプレミアムが5ティ ック以下の場合、キャビネット取引の場合は0.0025(USD6.25に相当)； その他全て0.005(USD12.50に相当)；ミッドカーブは0.005(USD12.50 に相当)；3ヵ月ミッドカーブ・オプションは、0.05以下のプレミアム で取引される場合、0.0025(6.25ドルに相当)と、0.05を超えるプレ

	ミアムで取引される場合、0.005 (12.50 ドルに相当) とする。6 ヶ月と 9 ヶ月ミッドカーブ・オプションは、0.005 (12.50 ドルに相当) とする。
値幅制限	なし
建玉制限	なし
最終取引日	四半期月限月は原商品と同日。シリアル限月は限月の第 3 水曜日の前週の金曜日 ミッドカーブ・オプションはオプション期日の属する暦月の第 3 水曜日の前週の金曜日。週次ミッドカーブ・オプションは、四半期月限月又はシリアル限月の 1 年、2 年又は 3 年ミッドカーブ・オプションの期日ではない金曜日。
権利行使期間	アメリカン
自動権利行使	あり
権利行使価格	0.25 (一定の期近限月は 0.125) 刻み
2018 年出来高 (枚)	356,735,941 (うちミッドカーブ・オプションは 183,150,415)
2019 年出来高 (枚)	424,692,800 (うちミッドカーブ・オプションは 145,928,255)

## (4) 通貨先物オプション

商品名	Options on Japanese Yen Futures 日本円通貨先物オプション <sup>10</sup>	Options on Euro FX Futures ユーロ FX 通貨先物オプション <sup>10</sup>
取引開始	1986 年 3 月	1998 年 5 月
取引時間	7:20a. m. -2:00p. m. (GLOBEX 日曜日 ～金曜日 5:00p. m. -翌日 4:00p. m.) 最終取引日 : 9:00a. m.	左に同じ
取引単位	日本円通貨先物 1 取引単位 (12, 500, 000 円)	ユーロ FX 通貨先物 1 取引単位 (EUR125, 000)
上場限月	四半期月の 4 限月、シリアル月の 3 限月及び週ごとの 4 限月	左に同じ
原商品	直近の四半期月限月の先物で、最 終取引日がオプションの最終取引 日から 3 営業日以後のもの。週ご とのオプションは、その月の直近 の先物。	左に同じ
銘柄コード	OpenOutcry:1JY, 2JY, 3JY, 4JY, 5JY Globex:1JY, 2JY, 3JY, 4JY, 5JY	OpenOutcry:1EU, 2EU, 3EU, 4EU, 5EU Globex:1EU, 2EU, 3EU, 4EU, 5EU
価格の最小変動幅	0. 000001 (USD12. 50 に相当) <sup>11</sup>	0. 00005 (USD6. 25 に相当) 週次は 0. 0001 (USD12. 50 に相当) <sup>11</sup>
値幅制限	先物が値幅制限に達したとき、オ プション取引も停止される。	左に同じ
建玉制限	全限月合計の買建と売建の差 1 万 枚以上の場合、建玉情報を報告 <sup>3</sup>	左に同じ
最終取引日	限月が四半期月又は暦月のものは 限月の第 3 水曜日の前々週の金曜 日。週ごとのものは暦月のオプシ ョンの最終取引日に当たらない水 曜日及び金曜日。	左に同じ
権利行使期間	ヨーロピアン <sup>12</sup>	左に同じ
自動権利行使	あり	あり
権利行使価格	0. 00005 刻みの上下 8 価格	0. 01 (期近 7 限月は 0. 005) 刻み
2018 年出来高 (枚)	3, 131, 431	8, 711, 729

<sup>10</sup> : プレミアム・クォーテッドとボラティリティ・クォーテッドが上場されています。

<sup>11</sup> : 取引の形態(キャビネット・トレード)や一定の条件により、半分又は異なる幅も可能です。

<sup>12</sup> : 2016 年 8 月 8 日以後は、ヨーロピアンだけが新規上場されています。

2019 年出来高 (枚)	2, 425, 824	6, 006, 230
---------------	-------------	-------------

商品名	<b>Options on Swiss Franc Futures</b> スイスフラン通貨先物オプション	<b>Options on British Pound Futures</b> 英ポンド通貨先物オプション
取引開始	1985 年 2 月	1985 年 2 月
取引時間	左に同じ	左に同じ
取引単位	スイスフラン通貨先物 1 取引単位 (CHF125, 000)	英ポンド通貨先物 1 取引単位 (GBP62, 500)
上場限月	左に同じ	左に同じ
原商品	左に同じ	左に同じ
銘柄コード	OpenOutcry:CHU Globex:BHU	OpenOutcry:1BP~5BP Globex:1BP~5BP
価格の最小変動幅	0. 0001 (USD12. 50 に相当) <sup>9</sup>	0. 0001 (USD6. 25 に相当) <sup>9</sup>
値幅制限	左に同じ	左に同じ
建玉制限	左に同じ	左に同じ
最終取引日	左に同じ	左に同じ
権利行使期間	左に同じ	左に同じ
自動権利行使	あり	あり
権利行使価格	0. 01 (期近 7 限月は 0. 005) 刻み	0. 01 刻み
2018 年出来高 (枚)	30, 519	3, 244, 177
2019 年出来高 (枚)	47, 026	2, 017, 648

商品名	<b>Options on Australian Dollar Futures</b> 豪ドル通貨先物オプション <sup>10</sup>	<b>Options on Canadian Dollar Futures</b> カナダドル通貨先物オプション <sup>10</sup>
取引開始	1988 年 1 月	1988 年 1 月
取引時間	左に同じ	左に同じ
取引単位	豪ドル通貨先物 1 取引単位 (AUD100, 000)	カナダドル通貨先物 1 取引単位 (CAD100, 000)
上場限月	左に同じ	左に同じ
原商品	左に同じ	左に同じ
銘柄コード	OpenOutcry:AD1~AD5 Globex:AD1~AD5	OpenOutcry:CD1~CD5 Globex:CD1~CD5
価格の最小変動幅	0. 0001 (USD10. 00 に相当) <sup>9</sup>	0. 0001 (USD10. 00 に相当) <sup>9</sup>
値幅制限	左に同じ	左に同じ
建玉制限	左に同じ	左に同じ

最終取引日	左に同じ	左に同じ
権利行使期間	左に同じ	左に同じ
自動権利行使	あり	あり
権利行使価格	当初 0.01 刻み (追加は 0.005 刻み 期近で市場価格に近い場合 0.0025、期近で OTM は 0.005、期 近でなく OTM は 0.01)	左に同じ
2018 年出来高 (枚)	1,580,352	1,872,860
2019 年出来高 (枚)	1,177,534	1,185,872

## 2. シカゴ商品取引所(CBOT)

### (Chicago Board of Trade)

#### (1) 金利先物

商品名	<b>30 Day Fed Funds Futures</b> フェド・ファンド(30日)先物
取引開始	1988年10月
取引時間	5:00p. m. -4:00p. m. (日曜日～金曜日) 最終取引日：4:00p. m.
取引単位	USD4, 167×契約 IMM 指数
上場限月	36 暦月
銘柄コード	ZQ
価格の表示方法	契約 IMM 指数=100- R R は、限月中の日次有効フェド・ファンド平均金利
価格の最小変動幅	0.005(USD20.835に相当) 最期近限月は0.0025(USD10.4175に相当)
値幅制限	なし <sup>1</sup>
建玉制限	全限月合計で買建と売建の差3,000枚の場合建玉情報を報告 <sup>2</sup>
最終取引日	限月の最終営業日
最終決済方法	差金決済(毎日の翌日物 Federal Fund rate の限月中の平均に基づいた最も近似の1/10 ベーシス・ポイント)
最終決済日	最終取引日の翌営業日
2018年出来高(枚)	65,336,892
2019年出来高(枚)	89,714,542

商品名	<b>10-Year USD MAC Swap Futures</b> USD MAC スワップ(10年)先物 <sup>3</sup>
取引開始	2002年6月
取引時間	5:00p. m. -4:00p. m. (日曜日～金曜日) 最終取引日：2:00p. m.
取引単位	USD100,000
上場限月	四半期月の4限月
固定金利	MAC 管理者(CME)が定める金利
変動金利	3ヵ月 LIBOR

<sup>1</sup> : 一日の値幅制限はありませんが、サーキットブレーカーが設けてあります。

<sup>2</sup> : 取引目的、ヘッジ対象資産などについて報告します。

<sup>3</sup> : 10-Year Deliverable Interest Rate Swap Futures から名称変更しました。



銘柄コード	NIU
額面価格	100
価格の最小変動幅	1/64 (USD15.625 に相当)
値幅制限	なし
建玉制限	なし (5,000 枚以上は報告要)
最終取引日	限月の第3水曜日の2 ロンドン営業日前
最終決済方法	受渡決済
最終決済日	限月の第3水曜日
2018 年出来高 (枚)	516,443
2019 年出来高 (枚)	599,489

MAC は Market Agreed Coupon の略です。

USD 建ては 2 年物、5 年物、20 年物及び 30 年物、ユーロ建ては 2 年物及び 5 年物も上場されています。

## (2) 金利先物オプション

商品名	<b>30 Days Fed Funds Futures Options</b> フェド・ファンド(30日)先物オプション
取引開始	2003年3月
取引時間	7:20a. m. -2:00p. m. (月曜日～金曜日) GLOBEX5:00p. m. -4:00p. m. (日曜日～金曜日)
取引単位	フェド・ファンド(30日)先物 1取引単位 (USD5,000,000)
上場限月	暦月から24限月。ミッドカーブ・オプション(6ヵ月及び1年)は、暦月から3限月。
原商品	同限月の先物。ミッドカーブ・オプション(6ヵ月又は1年)は、オプション限月からそれぞれ6ヵ月又は1年後を限月とする先物。
銘柄コード	FFC(コール)、FFP(プット)、ミッドカーブはFF3、FF6、FF9、FF1 (GLOBEXはOZQ、ミッドカーブはZQ3、ZQ6、ZQ9、ZQ1)
価格の最小変動幅	0.0025(USD10.4175に相当)
値幅制限	なし
建玉制限	3,000枚以上の場合建玉情報を報告 <sup>2</sup>
最終取引日	限月の最終営業日
権利行使期間	アメリカン
自動権利行使	あり
権利行使価格	0.0625刻み(上下10ずつ) 0.1250刻み(上下5ずつ)
2018年出来高(枚)	19,257
2019年出来高(枚)	79,019

### 3. ICE Futures U.S.(旧ニューヨーク商品取引所(NYBOT))

#### (1) 通貨先物

商品名	<b>Euro/Japanese Yen Futures</b> ユーロ・日本円通貨先物
取引開始	2011年6月
取引時間	8:00p. m. ~翌日 5:00p. m. 最終取引日:9:16a. m. (CT)
取引単位	EUR125,000 <sup>1</sup>
上場限月	四半期月
銘柄コード	KEJ
価格の表示方法	1EUR 当たりの日本円表示
価格の最小変動幅	0.005 (625円に相当)
値幅制限	なし
建玉制限	なし
最終取引日	限月の第3水曜日の2営業日前
最終決済方法	受渡決済
最終決済日	限月の第3水曜日
2018年出来高(枚)	6,712
2019年出来高(枚)	4,573

<sup>1</sup> : EUR1,000,000 も上場されています。

## (2) 通貨指数先物

商品名	<b>US Dollar Index Futures</b> 米ドル指数先物
取引開始	1985 年 11 月
取引時間	8:00p. m. ~翌日 5:00p. m. 最終取引日 : 10. 16a. m.
取引単位	USD1,000×米ドル指数
上場限月	四半期月の 4 限月
銘柄コード	DX
価格の表示方法	米ドル指数 (小数点以下第三位)
価格の最小変動幅	0.005 (USD5 に相当)
値幅制限	なし
建玉制限	なし
最終取引日	限月の第 3 水曜日の 2 営業日前
最終決済方法	ユーロ、日本円、英ポンド、カナダドル、スウェーデンクローナ及びスイスフランの 6 通貨 (指数内のウエートに応じて) に対して受渡決済
最終決済日	限月の第 3 水曜日
2018 年出来高 (枚)	6,448,251
2019 年出来高 (枚)	4,652,640

## (3) 通貨指数先物オプション

商品名	<b>Options on US Dollar Index Futures</b> 米ドル指数先物オプション
取引開始	1986年9月
取引時間	8:00p. m. -5:00p. m.
取引単位	米ドル指数先物 1 取引単位 (USD1,000×米ドル指数)
上場限月	四半期月の4限月及びシリアル月の2限月
原商品	四半期月の限月は同じ、シリアル月は次の四半期月限月の先物
銘柄コード	DX
価格の最小変動幅	0.005 (USD5.00に相当)
値幅制限	なし
建玉制限	なし
最終取引日	限月の第3水曜日の前々週の金曜日
権利行使期間	アメリカン
自動権利行使	あり
権利行使価格	米ドル指数取引ポイント 1.00 刻み
2018年出来高(枚)	5,708
2019年出来高(枚)	9,775

#### 4. NASDAQ PHLX(旧フィラデルフィア証券取引所)

##### 通貨オプション

商品名	U.S. Dollar settled Japanese Yen Currency Options 日本円通貨オプション(米ドル差 金決済)	U.S. Dollar settled Euro Currency Options ユーロ通貨オプション(米ドル差 金決済)
取引開始	2007年8月	2007年1月
取引時間	9:30a. m. -4:00p. m.	左に同じ
取引単位	1,000,000円	EUR10,000
上場限月	四半期月の4限月及びシリアル月の期近2限月	左に同じ
銘柄コード	XDN	XDE
価格の最小変動幅	0.01(USD1.00に相当)	左に同じ
値幅制限	なし	左に同じ
建玉制限	60万枚	120万枚
最終取引日	限月の第3金曜日	左に同じ
権利行使期間	ヨーロッパ	左に同じ
権利行使価格	0.005刻み	左に同じ
最終決済方法	最終取引日の12:00正午のニュー ヨーク連銀の買いレートに基づく 米ドルによる差金決済	左に同じ
オプション消滅日	限月の第3金曜日の次の土曜日	左に同じ
2018年出来高(枚)	2,172	23,245
2019年出来高(枚)	795	5,253

## 5. TMX(モントリオール取引所)

### (TMX)

#### (1) 金利先物

商品名	<b>Three-Month Canadian Bankers' Acceptance Futures</b> カナダ BA 手形(3 ヶ月)先物
取引開始	1988 年 4 月
取引時間	2:00a. m. -4:30p. m. 最終取引日 10:15a. m.
取引単位	額面 CAD1,000,000 の BA 手形(3 ヶ月)
上場限月	四半期月の 12 限月及びシリアル月の期近 2 限月
銘柄コード	BAX
価格の表示方法	100 から年利率(%)を引いた数値
価格の最小変動幅	0.01(CAD25.00 に相当) 期近 10 限月は 0.005(CAD12.50 に相当)
値幅制限	なし
最終取引日	限月の第 3 水曜日の 2 ロンドン営業日前
最終決済方法	最終取引日 10:15a. m. の CDOR に提示される 3 ヶ月カナダ BA 手形平均ビッドレートに基づく差金決済
2018 年出来高 (枚)	29,018,180
2019 年出来高 (枚)	29,816,722

## (2) 金利先物オプション

商品名	<b>Options on Three-Month Canadian Bankers' Acceptance Futures</b> カナダ BA 手形(3 ヶ月)先物オプション
取引開始	1994 年 4 月
取引時間	2:00a. m. -4:30p. m. 最終取引日 10:15a. m.
取引単位	カナダ BA 手形(3 ヶ月)先物 1 取引単位(CAD1, 000, 000)
上場限月	四半期月の 8 限月及びシリアル月の期近 2 限月。ミッドカーブ・オプション(1 年及び 2 年)は、四半期月の 4 限月及びシリアル月の 2 限月。
原商品	通常のオプションは同じ限月の先物。四半期限月のミッドカーブ・オプションは 1 年後又は 2 年後を限月とする先物。シリアル月のミッドカーブ・オプションはその限月直後の四半期月限月から 1 年後又は 2 年後を限月とする先物。
銘柄コード	OBX (ミッドカーブ・オプションは、シリアル月が OBW、1 年が OBY、2 年が OBZ)
価格の最小変動幅	0.005(CAD12.50 に相当)キャビネット取引は 0.001(CAD2.50 に相当)
値幅制限	なし
最終取引日	限月の第 3 水曜日の 2 ロンドン営業日前 <sup>1</sup> ミッドカーブ・オプションは限月の第 3 水曜日の前週の金曜日
権利行使期間	アメリカン
自動権利行使	あり
権利行使価格	0.125 刻み
2018 年出来高 (枚)	1, 095, 579
2019 年出来高 (枚)	1, 034, 240

CDOR は、Canadian Dollar Offered Rate の略称です。

<sup>1</sup> : ロンドン営業日は、ロンドン市の銀行の営業日をいいます。



## 6. B3 (旧 BM&FBOVESPA)

### (1) 通貨先物

商品名	<b>U.S. Dollar Futures</b> 米ドル先物
取引開始	1987 年 4 月
取引時間	9:00a. m. -6:00p. m.
取引単位	USD50,000
上場限月	暦月
銘柄コード	DOL
価格の表示方法	USD1,000 当たりの BRL 表示
価格の最小変動幅	USD1,000 当たり BRL0.50
値幅制限	5%
建玉制限	1 万枚又は限月当たりの全建玉の 20%のどちらか大きい方
最終取引日	限月の前月の最終営業日
最終決済方法	差金決済
最終決済日	限月の最初の営業日
2018 年出来高 (枚)	91,695,866
2019 年出来高 (枚)	94,587,950

## (2) 通貨先物オプション

商品名	<b>Options on U.S. Dollar Spot</b> 米ドル・スポット・オプション
取引開始	1998年7月
取引時間	9:00a. m. -6:00p. m.
取引単位	USD50,000
上場限月	暦月
原商品	USD50,000
銘柄コード	DOL
価格の最小変動幅	USD1,000 当たり BRL0.001
値幅制限	なし
建玉制限	限月当たりの全建玉の20%又は2,500枚のいずれか大きい方
最終取引日	限月の前月の最終営業日
権利行使期間	ヨーロピアン
自動権利行使	あり
2018年出来高(枚)	8,826,246
2019年出来高(枚)	10,166,813

## 7. ICE フューチャーズ・ヨーロッパ(ICE Futures Europe)

### (1) 金利先物-1

商品名	<b>Three Month Sterling (Short Sterling) Interest Rate Futures</b> 英ポンド金利(3ヵ月) 先物	<b>Three Month EURIBOR Interest Rate Futures</b> EURIBOR 金利(3ヵ月) 先物	<b>Three Month Euro Swiss Franc (Euroswiss) Interest Rate Futures</b> ユーロスイスフラン金利 (3ヵ月)先物
取引開始	1982年11月	1998年12月	1991年2月
取引時間	7:30a.m. -6:00p.m. 最終取引日: 11:00a.m.	1:00a.m. -9:00p.m. 最終取引日: 10:00a.m.	7:30a.m. -6:00p.m. 最終取引日: 11:00a.m.
取引単位	GBP1,250×利率指数	EUR2,500×利率指数	CHF2,500×利率指数
上場限月	四半期月の24限月及 びシリアル月の2限 月	四半期月の24限月及 びシリアル月の4限 月	四半期月の16限月
銘柄コード	L	I	S
価格の表示方法	100から年利率(%)を 引いた数値	左に同じ	左に同じ
価格の最小変動幅	0.005(GBP6.25に相 当)	0.005(EUR12.50に相 当)	0.01(CHF25.00に相当)
値幅制限	なし	なし	なし
建玉制限	なし	なし	なし
最終取引日	限月の第3水曜日	限月の第3水曜日の2 営業日前	限月の第3水曜日の2営業 日前
最終決済方法	差金決済(最終取引日 11:00a.m.のICE LIBORを基準)	差金決済(最終取引日 10:00a.m.のEMMI EURIBORを基準)	差金決済(最終取引日 11:00a.m.のICE LIBORを 基準)
最終決済日	最終取引日の翌営業 日	左に同じ	左に同じ
2018年出来高(枚)	216,984,337	226,441,372	7,397,204
2019年出来高(枚)	177,433,667	185,435,139	6,631,148

ICE LIBORは、ICE Benchmark Administration Limited London Interbank Offered Rateの略称です。

EMMI EURIBORは、European Money Markets Institute Euribor Rateの略称です。

EBF (European Banking Federation)は、2014年6月20日、European Money Markets Instituteに名称変更しました。

商品名	Three-Month SONIA Index Futures SONIA (3 ヶ月) 先物	One-Month SONIA Index Futures SONIA (1 ヶ月) 先物
取引開始	2018 年 6 月	2017 年 12 月 1 日
取引時間	日曜日～金曜日 7:30a. m. -6:00p. m. 最終取引日：ロンドン時間 6:00p. m.	左に同じ
取引単位	GBP2, 500×利率指数	GBP2, 500×利率指数
上場限月	24 四半期月	24 暦月
銘柄コード	S03	SOA
価格の表示方法	100 から金利を引いた数値	左に同じ
価格の最小変動幅	最期近四半期月限月が 0.0025 (GBP6.25 に相当)、その他の限月 が 0.005 (GBP12.50 に相当)	左に同じ
最終取引日	次の四半期限月の第 3 水曜日の前 営業日	限月の最終営業日
最終決済方法	最終取引日の翌営業日に公表され る EDSP に基づく差金決済	毎営業日ベンチマーク管理者又は その計算代理人により計算・公表さ れる 1 ヶ月英ポンド預金の SONIA に 基づく差金決済
最終決済日	最終取引日	最終取引日の翌営業日
2018 年出来高 (枚)	539,034	173,905
2019 年出来高 (枚)	2,922,791	409,940

EDSP は、Exchange Delivery Settlement Price の略です。ベンチマーク管理者が毎営業日計算する SONIA に基づき、ベンチマーク管理者が毎営業日計算する SONIA 金利決定の公表日のロンドン時間 11:00 までに決定されます。EDSP は、当該経過期間の複利 SONIA 金利に基づき、100 からこの金利を差し引いた数値です。

## (1) 金利先物-2

商品名	<b>Two Year Euro Swapnote Futures</b> ユーロ・スワップノート(2年)先物	<b>Five Year Euro Swapnote Futures</b> ユーロ・スワップノート(5年)先物	<b>Ten Year Euro Swapnote Futures</b> ユーロ・スワップノート(10年)先物
取引開始	2001年3月	左に同じ	左に同じ
取引時間	7:00a. m. -6:00p. m. 最終取引日: 10:00a. m.	左に同じ	左に同じ
取引単位	EUR100,000	左に同じ	左に同じ
上場限月	四半期月の2限月	左に同じ	左に同じ
固定金利	6.00%(年1回利払い)	左に同じ	左に同じ
銘柄コード	TWS	0	P
額面価格	100	左に同じ	左に同じ
価格の最小変動幅	0.005(EUR5.00に相当)	0.01(EUR10.00に相当)	左に同じ
値幅制限	なし	なし	なし
建玉制限	なし	なし	なし
最終取引日	実行日の2営業日前	左に同じ	左に同じ
実行日	限月の第3水曜日	左に同じ	左に同じ
最終決済方法	想定元本及び想定金利をICEスワップレートから算出する割引率で割り引いて算出する現在価値に基づく差金決済	左に同じ	左に同じ
2018年出来高(枚)	287,410	172,105	13,759
2019年出来高(枚)	68,576	76,379	6,133

これらのほか、30年物も上場されています。

(2) 金利先物オプション

商品名	<b>Options on Three Month Sterling (Short Sterling) Futures</b> 英ポンド金利(3 ヶ月)先物オプション	<b>Options on Three Month EURIBOR Futures</b> EURIBOR(3 ヶ月)先物オプション
取引開始	1987 年 11 月	1999 年 1 月
取引時間	7:30a. m. -6:00pm. 最終取引日 : 11:00a. m. <sup>1</sup>	7:00a. m. -6:00pm. 最終取引日 : 10:00a. m. <sup>1</sup>
取引単位	英ポンド金利(3 ヶ月)先物 1 取引単位	EURIBOR(3 ヶ月)先物 1 取引単位
上場限月	四半期月の 8 限月及びシリアル月の 4 限月。 ミッドカーブ・オプション(1 年、2 年、3 年、4 年及び 5 年)は、四半期月の 4 限月及びシリアル月の 4 限月。1 年及び 2 年の各週次ミッドカーブ・オプションは週ごと。	左に同じ
原商品	限月が四半期月のオプションは同限月の先物。 限月がシリアル月のオプションはその限月直後の四半期月限月の先物(例: 限月が 1 月のオプションは 3 月限月の先物)。四半期月限月のミッドカーブ・オプション(1 年、2 年、3 年、4 年及び 5 年)は、オプション限月直後の四半期月から 1 年後、2 年後、3 年後、4 年後又は 5 年後を限月とする先物。シリアル月のミッドカーブ・オプション(1 年、2 年、3 年、4 年又は 5 年)は、限月の次の四半期月限月の先物 (例: 2017 年 1 月又は 2 月に限月となるシリアル月のミッドカーブ・オプション(1 年)の場合、2018	左に同じ

<sup>1</sup> : 2015 年 2 月 16 日より後に上場されたシリアル月及びミッドカーブの限月は、16:15a. m.

	年3月限月の先物)。週次ミッドカーブ・オプションは、直近の満了していない四半期月ミッドカーブ・オプションから1年後又は2年後に満了となる四半期月限月先物。	
銘柄コード	L (ミッドカーブ・オプションはM、M2、M3、M4、M5)	I (ミッドカーブ・オプションはK、K2、K3、K4、K5)
価格の最小変動幅	0.0025 (GBP3.125 に相当)	0.0025 (EUR6.25 に相当)
値幅制限	なし	なし
最終取引日	限月の第3水曜日 (シリアル月は限月の第3水曜日の直前の金曜日) <sup>2</sup>	限月の第3水曜日の2営業日前 <sup>2</sup>
オプション料授受の時期	権利行使日の翌営業日又は権利行使期間満了日	左に同じ
権利行使期間	アメリカン	左に同じ
自動権利行使	あり	あり
権利行使価格	0.125 刻み	左に同じ
2018 年出来高 (枚)	46,329,671 (うちミッドカーブ・オプション 16,978,682)	35,359,081 (うちミッドカーブ・オプション 21,660,991)
2019 年出来高 (枚)	60,182,324 (うちミッドカーブ・オプション 14,013,963)	28,484,399 (うちミッドカーブ・オプション 15,160,693)

<sup>2</sup> :2015年2月16日より後に上場されたシリアル月及びミッドカーブの限月は、限月の第3水曜日の前週の金曜日。

## 8. ユーレックス(Eurex)

### (1) 金利先物

商品名	<b>Three-Month EURIBOR Futures</b> EURIBOR (3 ヶ月) 先物
取引開始	1998 年 9 月
取引時間	8:00a. m. -7:00p. m. 最終取引日 : 11:00a. m.
取引単位	EUR1, 000, 000
上場限月	暦月の 6 限月及び四半期月の 22 限月
銘柄コード	FEU3
価格の表示方法	100 から年利率 (%) を引いた数値
価格の最小変動幅	0. 0025 (EUR6. 25 に相当)
値幅制限	なし
建玉制限	なし
最終取引日	限月の第 3 水曜日の 2 営業日前
最終決済方法	差金決済 (最終取引日 11:00a. m. の EMMI Euribor を基準)
最終決済日	最終取引日と同じ。
2018 年出来高 (枚)	70, 761
2019 年出来高 (枚)	31, 359



## (2) 金利先物オプション

商品名	<b>Options on Three-Month EURIBOR Futures</b> EURIBOR (3 ヲ月) 先物オプション
取引開始	1998 年 9 月
取引時間	8:00a. m. -7:00p. m. 最終取引日 : 11:00a. m. (最終取引日が金曜日の場合 5:15p. m.)
取引単位	Eurex EURIBOR(3 ヲ月)先物 1 取引単位 (EUR1, 000, 000)
上場限月	期近 6 曆月及びそれに続く四半期月の 6 限月。ミッドカーブ・オプション(1 年、2 年、3 年及び 4 年)は、期近 6 曆月及びそれに続く四半期月の 2 限月。
原商品	四半期月限月の通常のオプションは同じ限月の先物。シリアル月は、その限月に続く四半期月限月の先物。四半期月限月のミッドカーブ・オプションは 1 年後、2 年後、3 年後及び 4 年後を限月とする先物。シリアル月のミッドカーブ・オプションはその限月直後の四半期月限月から 1 年後、2 年後、3 年後及び 4 年後を限月とする先物。
銘柄コード	OEU3 ミッドカーブ・オプションは OEM1~OEM4
価格の最小変動幅	0. 005 (EUR12. 50 に相当)
値幅制限	なし
建玉制限	なし
最終取引日	四半期月限月は限月の第 3 水曜日の 2 取引所営業日前、その他及びミッドカーブ・オプションの限月は限月の第 3 水曜日の前金曜日
権利行使期間	アメリカン
自動権利行使	あり
権利行使価格	0. 125 刻み
2018 年出来高 (枚)	610
2019 年出来高 (枚)	439

(3) 通貨先物（ローリング・スポット(注)）

商品名	<b>EUR/USD Rolling Spot</b> ユーロ／米ドル・ローリング・スポット
取引開始	2018年5月
取引時間	00:00a. m. -05:00p. m.
取引単位	EUR100,000
銘柄コード	RSEU
価格の表示方法	EUR1 当たりの USD 表示
価格の最小変動幅	EUR1 当たり 0.00001 (USD1 に相当)
最終決済方法	現物決済
2018 年出来高 (枚)	4,770
2019 年出来高 (枚)	8,480

注：FX のスポット・ポジションを手仕舞いするまで毎日ロールする取引をいいます。他に、AUD/USD、EUR/CHF、EUR/GDP、EUR/JPY、GBP/CHF、GBP/USD のローリング・スポットが上場されています。

## 9. CurveGlobal

### 金利先物

商品名	<b>Three-Month SONIA Index Futures</b> SONIA (3 ヶ月) 先物
取引開始	2018 年 6 月
取引時間	寄付 : 6:30a. m. -7:30p. m. 通常取引 : 7:30a. m. -18:00p. m. 最終取引日 : ロンドン時間 8:30p. m.
取引単位	GBP500,000
上場限月	25 四半期月及び 4 シリアル月限月
銘柄コード	S03
価格の表示方法	100 から金利を引いた数値
価格の最小変動幅	0.005 (GBP6.25 に相当)
日次決済価格	DSP
最終取引日	限月の第 3 水曜日
最終決済方法	EDSP に基づく差金決済
最終決済日	最終取引日
2018 年出来高 (枚)	556,728
2019 年出来高 (枚)	966,444

DSP は、Daily Settlement Price の略です。DSP は、ロンドン時間 16:15 に算出され、そのすぐ後に公布されます。ロンドン時間 16:15 前の 1 分間に 5 又はそれより多くの取引が行われた場合、当該期間の全ての取引の価格の取引数量加重平均から派生します。取引データが十分でない場合、公正価値モデルを使って決定されます。

## 10. モスクワ取引所 (MOEX)

### (Moscow Exchange)

通貨先物

商品名	<b>U.S. Dollar/Russian Ruble Futures</b> 米ドル・ロシアルーブル先物
取引開始	2010年7月
取引時間	10:00a. m. -6:45p. m.、7:00p. m. -11:50p. m.、8:00a. m. -9:00a. m.
取引単位	USD1,000
上場限月	四半期月から5年間
銘柄コード	SI
価格の表示方法	USD1,000当たりのRUB表示
価格の最小変動幅	USD1当たり0.001(RUB1に相当)
値幅制限	なし
最終取引日	限月の15日
最終決済方法	Interfaxが公表するUSD/RUB_UTS_TOMでの差金決済
2018年出来高(枚)	496,225,103
2019年出来高(枚)	384,155,770

## 11. ASX 24

### ASX 24 (旧 Sydney Futures Exchange)

#### (1) 金利先物

商品名	ASX 90 Day Bank Accepted Bill Futures ASX BA 手形(90日)先物	ASX 30 Day Interbank Cash Rate Futures ASX 30日銀行間金利先物	ASX 90 Day New Zealand Bank Bill Futures ASX ニュージーランド BA 手形(90日)先物 <sup>1</sup>
取引開始	1979年10月	2003年8月	1986年12月
取引時間	3月第2日曜から11月第1日曜までは 5:08p. m. -7:00a. m. 及び8:28a. m. -4:30p. m. 11月第1日曜から3月第2日曜までは 5:08p. m. -7:30a. m. 及び8:28a. m. -4:30p. m. 最終取引日: 12:00a. m.	3月第2日曜から11月第1日曜は 5:14p. m. -7:00a. m. 及び8:34p. m. -4:30p. m. 11月第1日曜から3月第2日曜は 5:14a. m. -7:30a. m. 及び8:34a. m. -4:30p. m. 最終取引日: 4:30p. m.	(ニュージーランド時間) 5:40p. m. -7:00a. m. 8:30a. m. -4:30p. m. 最終取引日: 12:00a. m.
取引単位	額面 AUD1,000,000 の BA 手形(90日)	AUD3,000,000	NZD1,000,000
上場限月	四半期月から20限月	暦月から18限月	四半期月の20限月
銘柄コード	IR	IB	BB
価格の表示方法	100から年利率(%)を引いた数値	左に同じ	左に同じ
価格の最小変動幅	0.01%(約AUD24.00に相当)	0.005%(約AUD12.33に相当)	0.01%(約NZD24.00に相当)
値幅制限	なし	なし	なし
建玉制限	清算会員のNTAの2倍まで	清算会員のNTAの2倍まで	清算会員のNTAの2倍まで
最終取引日	最終決済日の1営業日前	限月の最終営業日	限月9日より後の最初の水曜日
最終決済方法	受渡決済(オーストラ	差金決済(オーストラリ	Reuter NZが公表する3

<sup>1</sup> : 2004年3月にニュージーランド先物オプション取引所(NZFOE)からSFEに移管されました。

	リアの銀行などが発行する決済日後 85-95 日間で満期となる額面 AUD1,000,000 を 1 枚の BA 手形又は電子 BA 手形 (EBA)、譲渡性預金 (NCD) 又は電子 NCD (ECD))	ア準備銀行が毎日公表する銀行間翌日物金利の限月中の平均数値に基づく)	ヵ月物 FRA 決済レートに基づく決済価格 <sup>2</sup> に基づく差金決済
最終決済日	限月の第 2 金曜日	最終取引日の 2 営業日後	最終取引日の翌営業日
2018 年出来高 (枚)	32,850,509	1,604,936	1,956,974
2019 年出来高 (枚)	33,492,955	6,789,536	2,459,705

FRA は、forward rate agreement の略です。

NTA は、Net Tangible Assets の略です。

<sup>2</sup> :  $1,000,000 \times 365 / [365 + (P \times 90 / 100)]$  ただし P は年利率で表示された決済レート。

## 12. シンガポール取引所デリバティブ市場(SGX-DT)

### (Singapore Exchange Derivatives Trading)

#### 通貨先物

商品名	<b>SGX INR/USD Futures</b> SGX インドルピー/米ドル通貨先物	<b>USD/CNH Futures</b> 米ドル/中国元通貨先物
取引開始	2013 年 11 月	2014 年 10 月
取引時間	7:25a. m. -7:30p. m. 、 7:50p. m. -4:45a. m. 最終取引日 : 2:35p. m.	7:25a. m. -5:55p. m. 、 6:15p. m. -4:45a. m. 最終取引日 : 11:00a. m.
取引単位	INR2, 000, 000	USD100, 000
上場限月	12 暦月	暦月 13 限月及びそれに続く四半期 月の 8 限月
銘柄コード	IU	UC
価格の表示方法	INR100 当たりの米ドル・セント表示	USD1 当たりの CNH 表示
価格の最小変動幅	0. 010 (USD2. 00 に相当)	CNH0. 0001 (CNH10 に相当)
値幅制限	なし	なし
建玉制限	全限月合計で 1 万枚ネット	USD/CNH の先物とオプションを合わせ、 ネットで 1 万枚
最終取引日	限月の最終営業日の 2 営業日前	限月の第 3 水曜日の 2 営業日前
最終決済方法	RBI USDINR 参照レートによる差金決済	TMA が最終取引日の 11:15a. m. に公表する価格による差金決済
最終決済日	限月の最終営業日の 2 営業日後	限月の第 3 水曜日
2018 年出来高 (枚)	12, 814, 105	5, 338, 643
2019 年出来高 (枚)	13, 930, 092	9, 069, 418

RBI は、Reserve Bank of India の略称です。

TMA は、Treasury Markets Association of Hong Kong の略称です。

### 13. 香港取引所・清算会社(HKEX)

(Hong Kong Exchanges and Clearing Limited)

通貨先物

商品名	<b>USD/CNH Futures</b> 米ドル/中国元通貨先物
取引開始	2012年9月
取引時間	8:30a. m. -4:30p. m.、 1:00a. m. -11:45p. m. 最終取引日：11:00a. m.
取引単位	USD100,000
上場限月	当月1限月、暦月の3限月及び四半期月の6限月
銘柄コード	CUS
価格の表示方法	USD1あたりのRMB表示
価格の最小変動幅	RMB0.0001(RMB10に相当)
値幅制限	なし
建玉制限	当限月の最終取引日5日間2,000枚かつ全限月合計8,000枚
最終取引日	最終決済日の2営業日前
最終決済価格	TMAが最終取引日の11:15a. m. に公表する価格
最終決済方法	受渡決済
最終決済日	限月の第3水曜日
2018年出来高(枚)	1,755,130
2019年出来高(枚)	1,938,891



#### 14. 韓国取引所 (KRX)

##### (Korea Exchange)

通貨先物

商品名	<b>U.S. Dollar Futures</b> 米ドル通貨先物	<b>Japanese Yen Futures</b> 日本円通貨先物
取引開始	1999 年 4 月	2006 年 5 月
取引時間	9:00a. m. -3:45p. m. 最終取引日 : 11:30a. m.	9:00a. m. -3:45p. m. 最終取引日 : 11:30a. m.
取引単位	USD10, 000	1, 000, 000 円
上場限月	12 連続暦月及びそれに続く 8 四半期 月限月合わせて 20 限月	6 連続暦月 (4 シリアル月及び 2 四 半期月限月)
銘柄コード	UD	JPY
価格の表示方法	1USD 当たりの韓国ウォン表示	100 円当たりの韓国ウォン表示
価格の最小変動幅	0. 1 (KRW1, 000 に相当)	0. 1 (KRW1, 000 に相当)
値幅制限	なし	なし
建玉制限	必要な場合に設定	必要な場合に設定
最終取引日	限月の第 3 月曜日	限月の第 3 月曜日
最終決済方法	受渡決済	受渡決済
最終決済日	最終取引日の 2 営業日後	最終取引日の 2 営業日後
2018 年出来高 (枚)	74, 821, 050	683, 645
2019 年出来高 (枚)	85, 556, 591	840, 461

## 15. 台湾先物取引所 (TAIFEX)

### (Taiwan Futures Exchange)

通貨先物

商品名	<b>USD/CNT FX Futures</b> USD/CNT FX 先物	<b>USD/CNH FX Futures</b> USD/CNH FX 先物
取引開始	2015 年 7 月	2015 年 7 月
取引時間	8:45a. m. -4:15p. m. 最終取引日 : 11:00a. m.	左に同じ
取引単位	USD20, 000	USD100, 000
上場限月	当月、翌歴月、続く 4 四半期月	左に同じ
銘柄コード	RTF	RHF
価格の表示方法	1USD 当たりの RMB	左に同じ
価格の最小変動幅	0. 0001 (RMB2 に相当)	0. 0001 (RMB10 に相当)
値幅制限	前日決済価格から +/- 7%	左に同じ
建玉制限	あり	左に同じ
最終取引日	限月の第 3 水曜日	左に同じ
最終決済方法	台北外国為替市場開発基金が公表する USD/CNY (TW) 固定による差金決済	TMA が 11:30a. m. に公表するスポット USD/CNY (HK) 固定による差金決済
最終決済日	最終取引日と同じ	左に同じ
2018 年出来高 (枚)	283, 451	66, 743
2019 年出来高 (枚)	289, 375	75, 333