

「当委員会が対円NDFに係る下記の取引慣行を推奨することについてご意見・情報の募集のご案内」(平成23年12月5日)に対するコメントの結果等について

平成24年6月27日
東京外国為替市場委員会

標題につきまして、当委員会では対円NDF取引の「推奨案」について、平成23年12月5日から平成24年1月31日にかけて公表し、広く意見の募集を行いました。

合計8件のコメントをお寄せいただき、その後、当委員会にて検討を進めて参りました。

つきましては、皆様から寄せられたご意見を踏まえ、別紙のとおりにすることと致しました。

本件に関してお寄せいただいたコメントの概要及びそれに対する当委員会の考え方については、別添の表にまとめましたのでご参照ください。

御協力ありがとうございました。

以上

対円NDFのフィキシング・レートの算出方法について

平成24年6月27日
東京外国為替市場委員会

標題につきまして、当委員会では対円NDF取引の「推奨案」について、平成23年12月5日から平成24年1月31日にかけてこれを公表して広く意見の募集を行い、皆様から寄せられたご意見を踏まえ、下記のとおりと致しましたのでご案内申し上げます。

記

1. 対円NDFのフィキシング・レートの算出方法について

東京市場でのNDF取引量・取引ニーズの益々の増加を目的に、対円NDFのフィキシング・レート算出方法について、現在東京で行われている対円NDFビジネス慣行を踏まえ、以下のとおり推奨する。

- (1) アジア通貨^(注1)に関しては、各エマージング通貨の対ドル・フィキシング・レートと、当該フィキシング・レート公表直後に対応するトムソン・ロイター社“JPNU”ページのミーン・レートをを用いて対円NDFのフィキシング・レートの算出を行う。
- (2) 欧米通貨^(注2)に関しては、各エマージング通貨の対ドル・フィキシング・レートと、以下のいずれかをを用いて対円NDFのフィキシング・レートの算出を行う。
 - ① 翌営業日の東京9時のトムソン・ロイター社“JPNU”ページのミーン・レート
 - ② WMR Closing(GMT16:00)のミーン・レート
- (3) 本件は、東京市場の利用者ニーズ、取引実態調査を踏まえ、現時点において、委員会がプラクティカルと考えるものを提案するものです。当該プラクティスは、市場参加者を拘束するものではなく、今後の取引実態等の変化に照らして市場の状況をモニターする中で適宜見直しを行って参ります。

(注1) アジア通貨：各エマージング通貨の対ドル・フィキシングが東京時間 9:00～17:00 であるもの

(注2) 欧米通貨：各エマージング通貨の対ドル・フィキシングが上記(注1)の時間以外であるもの

2. 関連資料リンク

- 「当委員会が対円NDFに係る下記の取引慣行を推奨することについてご意見・情報の募集のご案内」(平成23年12月5日)に対するコメントの結果等について
- 当委員会が対円NDFに係る下記の取引慣行を推奨することについてご意見・情報の募集のご案内

以上