

- **金利参照期間の開始日が属する月を限月として表示**します。
- 例として、2021年**12月限月**取引の取引日程等は以下のとおりです。
 - ✓ 取引開始日は2017年3月15日(水)、取引最終日は2022年3月15日(火)
 - ✓ 金利参照期間の**開始日は2021年12月15日(水)**、終了日は2022年3月15日(火)
 - ✓ 最終清算数値を定める日は2022年3月16日(水)、最終決済期日は2022年3月17日(木)

2017年3月15日
(水)

2021年12月15日
(水)

2022年3月15日
(火)

2022年3月16日
(水)

2022年3月17日
(木)

取引開始日

金利参照期間開始日

金利参照期間終了日
取引最終日

金利参照期間終了日の
TONA(確報値)公表
最終清算数値算出日

最終決済期日

取引期間：5年

金利参照期間：3ヵ月

取引スケジュール・金利参照期間についての設例

2022年											2023年				
3/16(水)	...	6/14(火)	6/15(水)	6/16(木)	...	9/20(火)	9/21(水)	9/22(木)	...	12/20(火)	12/21(水)	12/22(木)	...	3/14(火)	
2022年3月限の取引期間		最終清算 数値 算出日		最終決済 期日											
2022年3月限の 金利参照期間															
2022年6月限の取引期間							最終清算 数値 算出日		最終決済 期日						
		2022年6月限の 金利参照期間													
2022年9月限の取引期間											最終清算 数値 算出日		最終決済 期日		
						2022年9月限の 金利参照期間									
2022年12月限の取引期間															
											2022年12月限の 金利参照期間				

(※) 金利参照期間が2022年3月16日(水)から6月14日(火)までの場合、参照対象となる具体的な金利値は2022年3月16日(水)から3月17日(木)にかけてのオーバーナイト物として算出され、3月17日(木)午前に発表される3月16日(水)の確報値から、2022年6月14日(火)から6月15日(水)にかけてのオーバーナイト物として算出され、6月15日(水)午前に発表される6月14日(火)の確報値までとなります。

取引最終日前後のスケジュールについての設例

① 通常パターン

月	火	四半期月の第3水曜日	木	金
	<ul style="list-style-type: none"> 金利参照期間終了日 取引最終日 	<ul style="list-style-type: none"> 金利参照期間終了日分のTONA確報値公表 最終清算数値算出日 	<ul style="list-style-type: none"> 最終決済期日 	

② 第3水曜日の前日が祝日の場合

月	火・祝	四半期月の第3水曜日	木	金
<ul style="list-style-type: none"> 取引最終日←繰り上げ 	<ul style="list-style-type: none"> 金利参照期間終了日(※1) 	<ul style="list-style-type: none"> 金利参照期間終了日分のTONA確報値公表 最終清算数値算出日 	<ul style="list-style-type: none"> 最終決済期日 	

③ 第3水曜日が祝日の場合

月	火	四半期月の第3水曜日・祝	木	金
	<ul style="list-style-type: none"> 金利参照期間終了日 取引最終日 	(※2)	<ul style="list-style-type: none"> 金利参照期間終了日分のTONA確報値公表 最終清算数値算出日→繰り下げ 	<ul style="list-style-type: none"> 最終決済期日→繰り下げ

④ 第3水曜日の翌日が祝日の場合

月	火	四半期月の第3水曜日	木・祝	金
	<ul style="list-style-type: none"> 金利参照期間終了日 取引最終日 	<ul style="list-style-type: none"> 金利参照期間終了日分のTONA確報値公表 最終清算数値算出日 		<ul style="list-style-type: none"> 最終決済期日→繰り下げ

⑤ 第3水曜日の前日・第3水曜日が祝日の場合

月	火・祝	四半期月の第3水曜日・祝	木	金
<ul style="list-style-type: none"> 取引最終日←繰り上げ 	<ul style="list-style-type: none"> 金利参照期間終了日(※1) 	(※2)	<ul style="list-style-type: none"> 金利参照期間終了日分のTONA確報値公表 最終清算数値算出日→繰り下げ 	<ul style="list-style-type: none"> 最終決済期日→繰り下げ

(※1) 金利参照期間の終点(第3水曜日の前日)が祝日の場合でも、金利参照期間の短縮・延長は行わない。
 (※2) 金利参照期間の始点(第3水曜日)が祝日の場合でも、翌限月取引の金利参照期間は同日から開始する。