

円資金決済規則

第1章 総則

(目的)

第1条 本規則は、株式会社東京金融取引所（以下「本取引所」という。）の業務規程（以下「業務規程」という。）、本取引所の業務方法書（以下「業務方法書」という。）並びに本取引所のユーロ円3ヵ月金利先物オプションに関する業務規程及び受託契約準則の特例（以下「オプション特例」という。）に基づき、本取引所が清算参加者及び業務規程第2条第4号に規定する提携外国清算機関（以下「提携外国清算機関」という。）との間で行う金銭の授受のうち、金利先物等取引及び清算建玉の値洗い及び最終決済に関して行う円資金の授受、オプション料の授受及び外国建玉の清算に関して行う円資金の授受（以下「円資金決済」という。）の方法について、業務規程第2条第8号に規定する提携契約（以下「提携契約」という。）に定めるもののほか、必要な事項を定める。

（平成3年7月8日、平成8年4月11日、平成10年12月1日、平成12年12月1日、平成16年4月1日、平成17年7月1日、平成19年9月30日 変更）

(定義)

第2条 本規則において、次の各号に掲げる用語の意義は、当該各号の定めるところによる。

- (1) 円値洗い差金 本取引所が、業務方法書第49条第3項に定めるところにより、清算参加者との間で授受する金銭のうち本邦通貨（以下「円」という。）で行うものをいう。
- (2) 円差金決済金 本取引所が、業務方法書第54条、第69条、第71条、第73条、第75条、第76条の2及び第76条の6に定めるところにより、同方法書第51条第1項に規定する差金決済を行うにあたり、清算参加者との間で授受する金銭のうち円で行うものをいう。
- (3) 円差金 円値洗い差金、円差金決済金及び第9号に規定するオプション料受払差金をいう。
- (4) 円調整金 本取引所が、提携外国清算機関との間で授受する業務方法書第28条第2項に定める金銭のうち円で行うものをいう。
- (5) 円決済銀行 本取引所が、円資金決済を行うために、業務方法書第98条の規定

- により定めて登録した金融機関をいう。
- (6) 本取引所の円決済口座 本取引所が、円資金決済のために、各円決済銀行の本邦にある1営業所に開設する預金口座をいう。
- (7) 即時に支払いが可能な資金 預金の受入業務を営む金融機関が、その預金規定に定めるところにより、これを預金として受入れた後、預金の払戻しが直ちに可能な資金として取り扱う円資金をいう。
- (8) 円資金の決済期日 ①円値洗い差金については、業務方法書第46条又は第47条の規定により当該円値洗い差金の授受をなすべき日、円差金決済金については、業務規程第4条第1項に規定する決済期日、次号に規定するオプション料受払差金については、業務方法書第77条第1項及び第3項の規定により当該オプション料受払差金の授受をなすべき日をいう。②円調整金については、円調整金算出に係る外国建玉と同一条件の清算建玉が発生した取引日の日中取引時間帯の属する営業日の翌営業日をいう。
- (9) オプション料受払差金 本取引所が、業務方法書第79条第1項に定めるところにより、清算参加者との間で授受する金銭をいう。

(平成3年2月15日、平成3年7月8日、平成4年5月1日、平成4年7月14日、平成8年4月11日、平成11年3月23日、平成15年5月9日、平成16年4月1日、平成17年12月20日、平成19年9月30日、平成19年12月3日、平成20年4月28日、平成24年4月23日 変更)

(対象金銭)

第3条 本取引所が円決済銀行を通じて決済する金銭は、円値洗い差金、円差金決済金、オプション料受払差金及び円調整金とする。

(平成3年7月8日、平成8年4月11日、平成17年12月20日 変更)

第2章 円決済銀行の指定

(平成17年7月1日 追加)

(清算参加者による円決済銀行の指定)

第4条 清算参加者は、本取引所が円決済銀行として登録している1行に対し、円資金決済に係る処理を依頼しなければならない。

2 清算参加者は、前項の依頼を行うときは、円資金決済のための預金口座（以下「清算

参加者の円資金決済口座」という。)を当該円決済銀行の本邦にある1営業所に開設したうえ、当該銀行に別表第1の様式による「円資金振替依頼書」及び本取引所宛の別表第2の様式による「円資金決済に関する届出書」(以下「円資金決済届出書」という。)を提出しなければならない。

- 3 清算参加者からの第1項の依頼を受諾した円決済銀行は、前項の円資金振替依頼書及び円資金決済届出書の記載内容を確認したうえ、円資金決済届出書を本取引所に提出するものとする。

(平成8年4月11日、平成16年4月1日 変更)

(本取引所による円決済銀行の指定)

第5条 本取引所は、円決済銀行に対し、円調整金に係る処理を依頼する。

- 2 本取引所は、前項の依頼を行うときは、円調整金の決済のための預金口座(以下「本取引所の円調整金決済口座」という。)を当該円決済銀行の本取引所の円決済口座を開設した営業所に開設する。このとき、当該円決済銀行は、円資金決済の円滑かつ確実な履行を図るために、当該本取引所の円調整金決済口座に融資極度額を設定するものとする。また、当該融資限度額及びその他の融資条件は、本取引所と当該円決済銀行との間で別途定めるところによる。
- 3 本取引所からの第1項の依頼を受諾した円決済銀行(前条第3項に規定する円決済銀行を含め以下「指定円決済銀行」という。)は、本取引所と円調整金に係る契約(以下「業務委託契約」という。)を締結しなければならない。

(平成8年4月11日 変更)

(届出事項の変更)

第6条 清算参加者は、円資金決済届出書により届け出た事項について変更を行おうとするときは、本取引所に対し指定円決済銀行を通じて、あらかじめその内容を書面により報告しなければならない。

(平成8年4月11日、平成16年4月1日 変更)

(清算参加者と指定円決済銀行との間の契約の解約)

第7条 清算参加者又は指定円決済銀行は、円資金振替依頼書に基づく契約(以下「円資金決済契約」という。)を解約しようとするときは、解約する日(日本の銀行休業日又はニューヨークの銀行休業日にあたらぬ営業日に限る。)を定めてその3月前までに、相手方に対し書面により通知を行わなければならない。この場合、解約の効力は当該解

約日と定められた日を円資金の決済期日とする円資金決済契約に基づく処理を終了したときをもって発生するものとする。

- 2 清算参加者又は指定円決済銀行は、前項の通知を行ったときは、遅滞なく本取引所に対し書面により報告しなければならない。
- 3 指定円決済銀行は、本取引所に対しその円決済銀行としての登録の取消を請求する場合には、同時にその旨を円資金決済契約を締結している清算参加者に書面により通知するものとし、この場合、当該指定円決済銀行は当該清算参加者に対し、第1項に従い登録取消日を解約日とする円資金決済契約の解約通知をなしたものとみなす。
- 4 清算参加者は、自己又は指定円決済銀行が第1項又は前項の通知を発した日から1月以内に、第4条に定めるところにより、あらたに指定円決済銀行を指定したうえ、本取引所に円資金決済届出書を提出しなければならない。この場合、あらたな指定円決済銀行との間の円資金決済契約は、第1項又は前項の解約の効力発生日の翌営業日を円資金の決済期日とする処理からこれを適用し、その効力を生ずるものとする。

(平成8年4月11日、平成15年4月28日、平成16年4月1日 変更)

(指定円決済銀行の登録取消による円資金決済契約等の解約)

第8条 本取引所は、指定円決済銀行について円決済銀行としての登録を取り消したときは（指定円決済銀行の登録取消請求に基づく場合を除く。）、当該円決済銀行との間で円資金決済契約を締結している清算参加者及び当該円決済銀行に直ちに通知するものとする。この場合、当該円資金決済契約は、登録取消通知の発信時をもって自動的に解約されたものとする。

- 2 前項の通知を受けた清算参加者は、第4条に定めるところにより、他の円決済銀行に円資金決済に係る処理を直ちに依頼するものとする。
- 3 第1項に規定する場合で当該指定円決済銀行が業務委託契約を締結しているときは、当該業務委託契約は、第1項に規定する登録取消通知の発信時をもって自動的に解約されたものとする。

(平成8年4月11日、平成15年5月9日、平成16年4月1日 変更)

第3章 円差金の決済

(清算参加者への円差金の通知)

第9条 本取引所は、円差金に係る円資金の決済期日（本章においては、以下単に「円資

金の決済期日」という。)の午前9時までに、清算参加者との間で授受すべき円差金の額を清算参加者に通知する。

(平成8年4月11日、平成16年4月1日 変更)

(指定円決済銀行への受払処理の依頼)

第10条 本取引所は、円資金の決済期日の午前9時までに、本取引所の円決済口座を開設している指定円決済銀行の営業所(以下「指定円決済銀行の取りまとめ店」という。)に、第12条及び第13条に規定する処理を行うよう依頼する。ただし、本取引所は、清算参加者が当該指定円決済銀行を指定円決済銀行として指定していないときは、当該依頼を行わない。

2 本取引所は、指定円決済銀行の取りまとめ店に対する別表第3の様式による「市場デリバティブ取引 差金・受渡決済金受払依頼書」(以下「受払依頼書」という。)を交付することにより、前項の依頼を行う。

3 本取引所は、指定円決済銀行の取りまとめ店に第1項の依頼をした後においては、第29条に規定する場合を除き、その取消又は訂正を行わない。

(平成8年4月11日、平成11年10月26日、平成16年4月1日、平成17年7月1日、平成20年4月28日 変更)

(清算参加者の資金手当て)

第11条 円差金を支払うべき清算参加者(以下「円差金支払い方清算参加者」という。)は、円資金の決済期日の午前11時までに、円差金の支払いに必要な資金を、当該清算参加者の円資金決済口座に即時に支払いが可能な資金により手当てしておかなければならない。

(平成8年4月11日、平成16年4月1日 変更)

(清算参加者の円資金決済口座からの引落)

第12条 指定円決済銀行は、円資金の決済期日の午前11時までに、円差金支払い方清算参加者の円資金決済口座から受払依頼書に記載された金額を引落したうえで、同額を本取引所の円決済口座に即時に支払いが可能な資金により入金するものとする。

(平成8年4月11日、平成11年10月26日、平成16年4月1日 変更)

(清算参加者の円資金決済口座への入金)

第13条 指定円決済銀行は、円資金の決済期日の午後2時までに、本取引所の円決済口

座から受払依頼書に記載された金額を引落したうえで、同額を、円差金を受取るべき清算参加者（以下「円差金受取り方清算参加者」という。）の円資金決済口座に即時に支払いが可能な資金により入金するものとする。

（平成 8 年 4 月 11 日、平成 11 年 10 月 26 日、平成 16 年 4 月 1 日 変更）

（取引所への通知方法）

第 14 条 指定円決済銀行の取りまとめ店は、第 12 条又は前条に規定する受払処理を実行した旨の通知を、当該円資金の決済期日の午後 3 時までには、本取引所に対し別表第 3 の様式による「受払実行済通知書」を提出する方法により行うものとする。

（平成 5 年 6 月 1 日、平成 8 年 4 月 11 日 変更）

（清算参加者への通知）

第 15 条 指定円決済銀行は、第 12 条及び第 13 条に規定する受払処理に関し、当該清算参加者に対して通知することを要しないものとする。

（平成 8 年 4 月 11 日、平成 16 年 4 月 1 日 変更）

第 4 章 （削除）

（平成 17 年 12 月 20 日 変更）

第 16 条から第 22 条まで （削除）

（平成 8 年 4 月 11 日、平成 15 年 4 月 28 日、平成 16 年 4 月 1 日、平成 17 年 12 月 20 日 変更）

第 5 章 円調整金の決済

（平成 8 年 4 月 11 日 追加）

(指定円決済銀行への受払処理の依頼)

第 23 条 本取引所は、円調整金に係る円資金の決済期日（本章においては、以下単に「円資金の決済期日」という。）の決済期日の午前 9 時までに、本取引所の円調整金決済口座を開設している指定円決済銀行の取りまとめ店に、次条及び第 25 条に規定する処理を行うように依頼する。

2 本取引所は、指定円決済銀行の取りまとめ店に対する別表第 3 に適当な修正を加えた様式による受払依頼書を交付することにより、前項の依頼を行う。

(平成 8 年 4 月 11 日 追加、平成 11 年 10 月 26 日 変更)

(本取引所の円調整金決済口座からの引落)

第 24 条 提携外国清算機関が円調整金の支払い方となるときは、指定円決済銀行は、円資金の決済期日の業務委託契約に規定する時刻までに、本取引所の円調整金決済口座から受払依頼書に記載された金額を引落としたうえで、同額を本取引所の円決済口座に即時に支払いが可能な資金により入金するものとする。

(平成 8 年 4 月 11 日 追加、平成 11 年 10 月 26 日、平成 19 年 9 月 30 日 変更)

(本取引所の円調整金決済口座への入金)

第 25 条 提携外国清算機関が円調整金の受取り方となるときは、指定円決済銀行は、円資金の決済期日の業務委託契約に規定する時刻までに、本取引所の円決済口座から受払依頼書に記載された金額を引落としたうえで、同額を本取引所の円調整金決済口座に即時に支払いが可能な資金により入金するものとする。

(平成 8 年 4 月 11 日 追加、平成 11 年 10 月 26 日、平成 17 年 12 月 20 日、平成 19 年 9 月 30 日 変更)

(取引所への通知方法)

第 26 条 指定円決済銀行の取りまとめ店は、第 24 条又は前条に規定する受払処理を実行した旨の通知を、当該円資金の決済期日の午後 3 時までに、本取引所に対し別表第 3 の様式による「受払実行済通知書」を提出する方法により行うものとする。

(平成 8 年 4 月 11 日 追加)

第6章 事故処理

(平成8年4月11日 変更)

(受払不能時の通知方法)

第27条 指定円決済銀行の取りまとめ店は、円差金支払い方清算参加者が当該清算参加者の円資金決済口座に資金を手当てしないため第12条に規定する受払処理ができない場合又は提携外国清算機関が円調整金の支払い方になっているにもかかわらず提携契約に定めるところにより資金を手当てしないため第24条に規定する受払処理ができない場合には、円資金の決済期日の午前11時までに本取引所に対しその旨の通知を電話により行った後、直ちに書面により通知するものとする。

(平成8年4月11日、平成16年4月1日、平成17年12月20日、平成19年9月30日 変更)

(取引所の円決済口座の資金手当て)

第28条 本取引所は、前条により本取引所の円決済口座の資金不足が発生するときは、その不足する額を、当該指定円決済銀行に開設している本取引所の円決済口座に即時に支払いが可能な資金により入金するものとする。

2 前項に規定する本取引所の円決済口座への入金は、円資金の決済期日の午前11時15分までに行うものとする。

(平成8年4月11日、平成13年1月4日 変更)

(清算参加者への支払拒絶)

第29条 円差金受取り方清算参加者が業務規程、オプション特例、取引所為替証拠金取引に関する業務規程の特例、取引所株価指数証拠金取引に関する業務規程の特例、業務方法書、証拠金及び未決済取引の引継ぎ等に関する規則、取引所為替証拠金取引に関する証拠金及び未決済取引の引継ぎ等に関する規則、取引所株価指数証拠金取引に関する証拠金及び未決済取引の引継ぎ等に関する規則、為替取引証拠金決済規則、株価指数取引証拠金決済規則又はこの規則の定めるところにより本取引所に対して支払い、又は預託をすべき金銭を、その履行期限までに支払わず、又は預託をしないときは、本取引所は当該円差金受取り方清算参加者に対する円差金の支払いを拒絶することができる。

2 本取引所は、前項の定めるところにより、円差金受取り方清算参加者への円差金の支払いを拒絶するときは、第10条の規定に従い本取引所が既に指定円決済銀行に対して依頼した当該清算参加者に係る受払依頼書の訂正を、円資金の決済期日の午前11時30

分までに当該指定円決済銀行に対し、申し入れるものとする。

- 3 本取引所は、前項の訂正を行ったときは、速やかに当該指定円決済銀行に対する受払依頼書を再作成し、交付するものとする。

(平成3年7月8日、平成8年4月11日、平成11年10月26日、平成16年4月1日、平成17年7月1日、平成17年12月20日、平成22年10月1日 変更)

(手続に関する時刻の変更)

第29条の2 本取引所は、前3条に規定する場合その他真にやむを得ないと判断するときは、第3章及び第5章に規定する手続に関する時刻を変更することができる。

- 2 本取引所は、前項の規定により手続に関する時刻を変更したときは、その旨を直ちにすべての清算参加者及び指定円決済銀行に通知するものとする。

(平成20年4月28日 追加)

第7章 雑則

(平成8年4月11日 変更)

(預金規定の適用除外)

第30条 清算参加者は、円差金の本取引所に対する支払いについて、清算参加者の円資金決済口座に係る指定円決済銀行の預金規定にかかわらず、指定円決済銀行に当座小切手の振出又は預金通帳、預金払戻請求書の提出を行わないものとする。

- 2 前項の規定は、本取引所の清算参加者に対する支払いに、これを準用する。ただし、「清算参加者」とあるのは「本取引所」と、「本取引所」とあるのは「清算参加者」と、「清算参加者の円資金決済口座」とあるのは「本取引所の円決済口座」と読み替えるものとする。

- 3 本取引所は、円調整金について、本取引所の円調整金決済口座に係る指定円決済銀行の預金規定にかかわらず、当該指定円決済銀行に当座小切手の振出又は預金通帳、預金払戻請求書の提出を行わないものとする。

(平成8年4月11日、平成16年4月1日、平成17年12月20日 変更)

(規則の改正)

第 31 条 本取引所は、清算参加者及び円決済銀行に事前に通知したうえ、本規則を改正することができる。

(平成 8 年 4 月 11 日、平成 16 年 4 月 1 日 変更)

(必要事項の決定等)

第 32 条 本取引所は、円差金に係る円資金決済を適正かつ確実にを行うため、本規則に規定するもののほか必要な事項につき細則を定め、又は必要な措置を講ずることができる。

- 2 本取引所は、前項の細則を定めたとき又は前項の措置を行ったときは、遅滞なく円決済銀行及び清算参加者に通知するものとする。
- 3 本取引所は、円調整金に係る円資金決済を適正かつ確実にを行うため、本規則及び提携契約に規定するもののほか必要な事項につき細則を定め、又は必要な措置を講ずることができる。
- 4 本取引所は、前項の細則を定めたとき又は前項の措置を行ったときは、遅滞なく本取引所が指定円決済銀行として指定している指定円決済銀行に通知するものとする。

(平成 8 年 4 月 11 日、平成 16 年 4 月 1 日、平成 17 年 12 月 20 日 変更)

(指定円決済銀行間の資金の決済)

第 33 条 本取引所は、本規則で規定する円資金決済に伴う指定円決済銀行の本取引所の円決済口座の残高の調整を行うため指定円決済銀行間で行われる資金の決済に関し必要な事項については、別途規則を定める。

(平成 8 年 4 月 11 日 変更)

(費用)

第 34 条 円差金に係る円資金決済を依頼した清算参加者は、当該円資金決済に係る指定円決済銀行の取扱手数料又はその他の費用を負担するものとし、その料率及び支払いの方法は、当該指定円決済銀行と清算参加者との間で別途合意するところによる。

(平成 8 年 4 月 11 日、平成 16 年 4 月 1 日、平成 17 年 12 月 20 日 変更)

(損害金の負担)

第 35 条 清算参加者、円決済銀行及び本取引所は、それぞれの責めにより生じた損害を負担する。

- 2 清算参加者は、本規則に規定する履行期限までに円資金決済を行わなかったときは、支払うべき金額に対し年 14%の割合の損害金を支払うものとする。この場合の計算方法は年 365 日の日割計算とする。

本規則に規定する円資金決済の履行期限が一定の日の一定の時刻をもって定められている場合において、清算参加者が同時刻までに履行しなかったときは、その日を 1 日分として計算した損害金を支払うものとする。

- 3 清算参加者、円決済銀行又は本取引所いずれの責めによるか明らかでないときは、当事者間で協議して決定する。

(平成 8 年 4 月 11 日、平成 16 年 4 月 1 日 変更)

附則

この変更規則は、平成元年 6 月 14 日から施行する。

附則

この変更規則は、平成 3 年 2 月 15 日から施行する。

附則

この変更規則は、平成 3 年 7 月 8 日から施行する。

附則

この変更規則は、平成 4 年 5 月 1 日から施行する。

附則

この変更規則は、平成 4 年 7 月 14 日から施行する。

附則

この変更規則は、平成 5 年 6 月 1 日から施行する。

附則

この変更規則は、平成 8 年 4 月 11 日から施行する。

附則

この変更規則は、平成 10 年 12 月 1 日から施行する。

附則

この変更規則は、平成 11 年 3 月 23 日から施行する。

附則

この変更規則は、平成 11 年 10 月 26 日から施行する。

附則

この変更規則は、本取引所が定める日から施行する。

(注)「本取引所が定める日」は平成 15 年 4 月 28 日

附則

この変更規則は、本取引所が定める日から施行する。

(注)「本取引所が定める日」は平成 15 年 5 月 9 日

附則

この変更規定は、平成 16 年 4 月 1 日から施行する。

附則

この変更規定は、平成 17 年 7 月 1 日から施行する。

附則

この変更規定は、平成 17 年 12 月 20 日から施行する。

附則

この改正規定は、平成 19 年 9 月 30 日から施行する。

附則

この改正規定は、平成 19 年 12 月 3 日から施行する。

附則

この変更規則は、平成 20 年 4 月 28 日から施行する。

附則

この変更規則は、平成 22 年 10 月 1 日から施行する。

附則

この変更規則は、平成 24 年 4 月 23 日から施行する。