金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書

第１章　総則

（目的）

第１条　この金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書（以下「本業務方法書」という。）は、株式会社日本証券クリアリング機構（以下「当社」という。）が行う金融商品債務引受業等及びこれに附帯する業務のうち金利スワップ取引を対象取引とするもの（以下「金利スワップ取引清算業務」という。）に関して必要な事項（次に掲げる事項を含む。）を定めることを目的とする。

（１）　当社による債務負担及び清算約定に関して、当社及び清算参加者の間で必要となる事項

（２）　当社に対して債務負担の申込みをする適格金利スワップ取引に関して、清算参加者及び他の清算参加者の間で必要となる事項

（３）　清算取次原取引に関して、清算委託者及び当該清算取次原取引の相手方である清算参加者又は他の清算委託者の間で必要となる事項

（４）　有価証券等清算取次ぎに関して、当社、清算参加者及び清算委託者の間で必要となる事項

（４）の２　クロスマージン制度に関して、当社、清算参加者及び清算委託者の間で必要となる事項

（５）　前各号に掲げるもののほか、当社が行う金利スワップ取引清算業務に関して、当社、清算参加者及び清算委託者の間で必要となる事項

２　本業務方法書等は、当社が行う金利スワップ取引清算業務についてのみ適用されるものとし、当社が行う金利スワップ取引以外の対象取引に係る金融商品債務引受業等その他の業務には適用されないものとする。

（定義）

第２条　本業務方法書等において使用する用語は、金融商品取引法（昭和２３年法律第２５号）及びＩＳＤＡ定義集において使用される用語の例によるほか、次の各号に掲げる用語の意義は、それぞれ当該各号に定めるところによる。

（１）　「移管」とは、次に掲げるいずれかのことをいう。

ａ　第５８条の５第４項の規定により、移管元清算委託者（第５８条の４第１項に規定する移管元清算委託者をいう。以下本号において同じ。）及び当該移管元清算委託者の受託清算参加者の間の清算委託取引を終了させこれに基づく債権債務を将来に向かって消滅させること。

ｂ　第５８条の５第６項の規定により、移管元清算委託者及び当該移管元清算委託者の受託清算参加者の間の清算委託取引を終了させこれに基づく債権債務を将来に向かって消滅させると同時に、移管先清算委託者（第５８条の４第１項に規定する移管先清算委託者をいう。）及び当該移管先清算委託者の受託清算参加者の間に当該清算委託取引と同一内容の法律関係を新たに成立させること。

ｃ　第５８条の７第４項の規定により、移管先清算委託者（第５８条の６第１項に規定する移管先清算委託者をいう。）及び当該移管先清算委託者の受託清算参加者の間に当社及び移管元清算参加者（同項に規定する移管元清算参加者をいう。）の間の清算約定（自己分）と同一の経済的効果を有する法律関係を新たに成立させること。

（１）の２　「委託当初証拠金」とは、受託清算参加者が、清算委託者の同意を得て、清算委託者から交付を受けた金銭（日本円及び当社が指定する通貨に限る。）又は代用有価証券を第６１条第１項第２号に掲げる当該清算委託者の債務を担保する目的で自ら保管する場合における当該金銭又は代用有価証券をいう。

（２）　「委託取引口座」とは、第５９条第２項に規定する委託取引口座をいう。

（２）の２　「一括コンプレッション」とは、第５３条の２の２の規定に基づき、当社が定める方法により、複数の清算参加者の清算約定について一括してコンプレッションを行うことをいう。

（２）の３　「円貨建清算約定」とは、清算約定のうち、想定元本及び決済通貨が日本円建てであるものをいう。

（３）　「親会社等」とは、ある法人等の親会社（当該法人等の財務及び事業の方針の決定を支配している他の法人等をいい、当該他の法人等の親会社を含む。以下本号において同じ。）及び当該法人等の親会社の子会社（当該法人等の親会社によって財務及び事業の方針の決定を支配されている他の法人等をいい、当該他の法人等の子会社を含む。）その他これらに類する者として当社が認める者をいう。

（４）　「親会社等保証」とは、清算参加者の親会社等が、当社が定める様式による保証に関する書面（当社が当該書面と内容が同一であると認める書面を含む。）を当社に提出することにより当該清算参加者の当社に対する債務を保証することをいう。

（４）の２　「解約手数料」とは、一括コンプレッション、参加者提案型コンプレッション又はＪＳＣＣ提案型コンプレッションにより清算約定がその終了日前に終了した場合において、当社と当該清算約定の当事者である清算参加者との間で授受される金銭をいう。

（４）の３　「外貨建清算約定」とは、清算約定のうち、想定元本及び決済通貨が日本円建て以外のものをいう。

（４）の４　「外貨本国営業日」とは、豪ドル建清算約定についてはシドニー営業日を、米ドル建清算約定についてはニューヨーク営業日を、ユーロ建清算約定についてはＴａｒｇｅｔ営業日をいう。

（４）の５　「外貨本国休業日」とは、外貨本国営業日以外の日をいう。

（４）の６　「カスタマーバッファー」とは、清算委託者が第４９条第１項に定める債務負担時所要証拠金又は第６９条第１項に定める日中証拠金所要額に足りる額を当社に預託又は交付していない場合に、第８４条の７に定めるところにより当該不足額に充当する目的で、受託清算参加者が当社に預託する当初証拠金をいう。

（４）の７　「カスタマーバッファー利用上限額」とは、カスタマーバッファーの充当を認める当社１営業日あたりの累計額の上限として受託清算参加者が設定し、第８４条の６の規定によ

り当社に対して申告した、委託取引口座ごとのカスタマーバッファーの充当上限額をいう。
（４）の８　「カスタマーバッファー未充当残高」とは、受託清算参加者が当社に預託したカスタマーバッファーの額から、第８４条の７第１項及び第２項の規定により当該清算参加者と清算受託契約を締結している清算委託者に係る委託取引口座に充当されているカスタマーバッファーの額を減じた額をいう。
（５）　「企業集団」とは、金融商品取引法第５条第１項第２号に規定する企業集団をいう。
（６）　「期限前終了」とは、コンプレッション以外の事由により清算約定がその終了日前に終了することをいう。
（７）　「期限前終了手数料」とは、清算約定が期限前終了した場合において、当該清算約定の当事者間で授受される金銭をいう。
（８）　「規則」とは、本業務方法書に基づいて当社が定める規則（名称の如何を問わない。また、規則が改正された場合には、当該改正を含む。）を総称していう。
（９）　「休業日」とは、第５条第１項に規定する休業日及び同条第２項に規定する臨時休業日を総称していう。
（９）の２　「金銭」とは、日本円、オーストラリア・ドル、米ドル及びユーロをいう。
（１０）　「金銭等」とは、金銭、有価証券又は債権その他の財物をいう。
（１０）の２　「金利先物清算約定」とは、清算約定のうち、金利先物取引に係る清算約定をいう。
（１０）の３　「金利先物取引」とは、証券取引等業務方法書第３条第２項第４号の２に規定する金利先物取引をいう。
（１１）　「金利スワップ清算基金」とは、各清算参加者が第１７条第１項に定める目的で当社に預託する金銭（日本円及び当社が指定する通貨に限る。）又は代用有価証券をいう。
（１２）　「金利スワップ清算資格」とは、本業務方法書等の定めるところにより清算約定について当社の相手方となるための資格であって、当社がその付与及び取消しを決定することができるものをいう。
（１３）　「金利スワップ取引」とは、金融商品取引法第２条第２２項第５号に掲げる店頭デリバティブ取引である金利スワップ取引をいう。
（１３）の２　「クーポン・ブレンディング」とは、第５３条の２の規定に基づき、当社が定める方法により、コンプレッションを行うことをいう。
（１３）の２の２　「クライアント・クリアリング」とは、受託清算参加者と同一の企業集団に含まれる者以外の清算委託者からの委託に基づく有価証券等清算取次ぎをいう。
（１３）の３　「クロスマージン承諾者」とは、第８４条の４第２項 の規定に従い、当社に対して、証券取引等業務方法書に定めるところにより当社に対して行われた国債証券先物取引又は金利先物取引の建玉をクロスマージン制度の対象とするための申請（以下「クロスマージンの申請」という。）に対する諾否の通知を行う清算参加者をいう。
（１３）の４　「クロスマージン申請者」とは、当社に対して、クロスマージンの申請を行う国債先物等清算参加者をいう。

（１３）の５　「クロスマージン制度」とは、国債証券先物取引又は金利先物取引のうち当社が定めるものに係る建玉について、本業務方法書等の定めるところにより、当初証拠金所要額を算出する制度をいう。

（１３）の６　「クロスマージン対象金利先物清算約定」とは、金利先物清算約定のうち、第８４条の４第３項の規定により自己取引口座又は委託取引口座に建玉が記録されているものをいう。

（１３）の７　「クロスマージン対象国債先物清算約定」とは、国債先物清算約定のうち、第８４条の４第３項の規定により自己取引口座又は委託取引口座に建玉が記録されているものをいう。

（１３）の８　「クロスマージンの承諾」とは、第８４条の４第２項の規定に従い、クロスマージンの申請に対して承諾の通知を行うことをいう。

（１３）の９　「クロスマージン利用者」とは、清算参加者又は清算委託者のうち、次のａからｄまでのいずれかに該当し、かつ、自らの計算による国債証券先物取引又は金利先物取引の建玉についてクロスマージン制度を利用する者であって、当社に対して第８４条の２に規定する届出が行われた者をいう。

ａ　国債先物等清算参加者

ｂ　国債先物等清算参加者に対して国債証券先物取引又は金利先物取引を委託した顧客

ｃ　国債先物等非清算参加者

ｄ　国債先物等非清算参加者に対して国債証券先物取引又は金利先物取引を委託した顧客

（１４）　「決済金額」とは、清算約定に関し、当社及び清算参加者の間で授受される金銭（金利スワップ清算基金、当初証拠金、変動証拠金及び変動証拠金に係る利息として授受される金銭を含まない。）の額（当該金銭のうち第８５条第２項又は第８５条の４第２項の規定により差引計算されるものについては、その差引計算後の額）をいう。

（１５）　「決済不履行」とは、清算約定に基づく債務その他本業務方法書等に基づく債務の全部若しくは一部をその履行期日までに履行しない場合又はそのおそれがある場合をいう。

（１５）の２　「豪ドル建清算約定」とは、清算約定のうち、想定元本及び決済通貨がオーストラリア・ドル建てのものをいう。

（１５）の３　「国債先物等承継」とは、第９４条の３の規定により、当社、国債先物等清算参加者及びクロスマージン利用者のうち第１３号の９ｂからｄまでに掲げる者（同号ｄに掲げる者については、その国債証券先物取引の委託先である国債先物等非清算参加者を含む。）の間で国債先物清算約定等に係る権利義務（国債先物清算約定、国債証券先物取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託及び国債証券先物取引の委託に係る権利義務をいう。以下同じ。）及び金利先物清算約定等に係る権利義務（金利先物清算約定、金利先物取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託及び金利先物取引の委託に係る権利義務をいう。以下同じ。）を新たに発生させるとともに、それに伴う金銭の授受及び権利義務の処理を行うことをいう。

（１５）の４　「国債先物等承継清算参加者」とは、国債先物等承継により発生する権利義務の当事者となる国債先物等清算参加者をいう。

（１５）の５　「国債先物清算約定」とは、清算約定のうち、国債証券先物取引に係る清算約定をいう。

（１５）の６　「国債先物等清算参加者」とは、証券取引等業務方法書第５条第３項に規定する国債先物等清算参加者をいう。

（１５）の７　「国債先物等非清算参加者」とは、証券取引等業務方法書第７３条の６第２項に規定する国債先物等非清算参加者をいう。

（１５）の８　「国債先物等バックアップ受託者」とは、第８４条の５第１項の規定により債権債務が成立した場合に、国債先物清算約定等に係る権利義務及び金利先物清算約定等に係る権利義務につき国債先物等承継を行う先として、第４５条の３に定めるところによりあらかじめクロスマージン利用者から指定を受けている国債先物等清算参加者をいう。

（１５）の９　「国債証券先物取引」とは、証券取引等業務方法書第３条第２項第３号に規定する国債証券先物取引をいう。

（１６）　「国際統一基準」とは、銀行法第二十六条第二項に規定する区分等を定める命令（平成１２年総理府・大蔵省令第３９号）第１条第４項、長期信用銀行法第十七条において準用する銀行法第二十六条第二項に規定する区分等を定める命令（平成１２年総理府・大蔵省令第４０号）第１条第４項又は信用金庫法第八十九条第一項において準用する銀行法第二十六条第二項に規定する区分等を定める命令（平成１２年総理府・大蔵省令第４１号）第３条第５項に規定する国際統一基準をいう。

（１７）　「国内基準」とは、銀行法第二十六条第二項に規定する区分等を定める命令第１条第５項、長期信用銀行法第十七条において準用する銀行法第二十六条第二項に規定する区分等を定める命令第１条第５項又は信用金庫法第八十九条第一項において準用する銀行法第二十六条第二項に規定する区分等を定める命令第３条第４項に規定する国内基準をいう。

（１８）　「固定的損失補填財源」とは、本業務方法書等の規定に従い破綻処理清算約定の通貨の種類ごとに按分された第一階層金利スワップ決済保証準備金、第二階層金利スワップ決済保証準備金及び破綻清算参加者以外の各清算参加者が当社に預託した金利スワップ清算基金（第二階層清算参加者負担限度額を上限とする。）をいう。

（１８）の２　「コンプレッション」とは、清算約定をその終了日前に終了させるとともに、新たな清算約定を成立させることをいう。

（１９）　「債務負担」とは、第４９条の規定により、当社と適格金利スワップ取引の当事者である各清算参加者との間でそれぞれ金利スワップ取引を成立させることをいう。

（１９）の２　「債務負担時所要証拠金不足額」とは、第６６条に規定する当初証拠金預託額と、有価証券清算取次ぎの委託に係る第５４条第１項（第５４条の２第１項において準用する場合を含む。）に規定する通知が行われた時点で、当該委託に係る委託取引口座に充当されているカスタマーバッファーの額との合計額が、第４９条に規定する債務負担時所要証拠金に不足する場合の当該不足額をいう。

（２０）　「差換当初証拠金」とは、当初証拠金のうち、受託清算参加者が、自己及び清算委託者のために、自己を当事者とする清算約定（委託分）について、自己の負担で当社に預託する

ものをいう。

（２０）の２　「参加者提案型コンプレッション」とは、第５３条の２の３の規定に基づき、当社が定める方法により、コンプレッションを行うことをいう。

（２１）　「自己資本額」とは、金融商品取引業者にあっては、金融商品取引業等に関する内閣府令（平成１９年内閣府令第５２号）第１条第４項第２号に規定する固定化されていない自己資本の額をいい、保険会社及び信用金庫以外の海外事業拠点を有する登録金融機関にあっては、国際統一基準に係る単体総自己資本比率の計算に用いる総自己資本の額（外国銀行にあっては、これに相当する額）をいい、保険会社以外の海外事業拠点を有しない登録金融機関及び海外事業拠点を有する信用金庫である登録金融機関にあっては、国内基準に係る単体自己資本比率の計算に用いる自己資本の額をいい、保険会社である登録金融機関にあっては、純資産額をいう。

（２２）　「自己資本規制比率」とは、金融商品取引法第４６条の６第１項に規定する自己資本規制比率をいう。

（２３）　「自己取引口座」とは、第５９条第２項に規定する自己取引口座をいう。

（２３）の２　「指定市場開設者」とは、証券取引等業務方法書第３条第２項第１号に規定する指定市場開設者のうち当社が定める者をいう。

（２３）の３　「シドニー営業日」とは、シドニーにおいて銀行が営業しており、かつオーストラリア・ドルの資金決済が行われている日をいう。

（２４）　「受託清算参加者」とは、清算委託者との間で清算受託契約を締結した清算参加者をいう。

（２４）の２　「承継」とは、第５３条の４第４項の規定により、当社及び清算参加者の間で清算約定（自己分）に係る権利義務を新たに発生させるとともに、それに伴う金銭の授受及び権利義務の処理を行うこと又は第５８条の３第４項、第９４条第６項若しくは第９４条の２第２項の規定により、当社、清算参加者及び清算委託者の間で清算約定（委託分）及び清算委託取引に係る権利義務を新たに発生させるとともに、それに伴う金銭の授受及び権利義務の処理を行うことをいう。

（２４）の３　「承継清算参加者」とは、承継により発生する権利義務の当事者となる清算参加者をいう。

（２４）の４　「証券取引等業務方法書」とは、当社が証券取引等清算業務に関して定める業務方法書をいう。

（２５）　「証拠金」とは、当初証拠金、委託当初証拠金及び変動証拠金を総称していう。

（２６）　「正味現在価値」とは、金利スワップ取引から生じる将来キャッシュフローを当社が定める方法で現在価値に割り引くことにより算出した値をいう。

（２６）の２　「新規債務負担時カスタマーバッファー利用可能額」とは、受託清算参加者に対して有価証券清算取次ぎの委託をしようとする清算委託者が利用可能なカスタマーバッファーの額（カスタマーバッファー利用上限額から、当該委託に係る第５４条第１項（第５４条の２第１項において準用する場合を含む。）に規定する通知を行った時点で当該委託に係る委託取引口座に充当されているカスタマーバッファーの額を減じた額（当該減じた額がカスタマー

バッファー未充当残高を超える場合には、当該カスタマーバッファー未充当残高)）をいう。

（２７）　「清算委託者」とは、清算参加者との間で清算受託契約を締結した者であって、当社に第４３条第２項の誓約書を提出した者（当社が定める要件を満たす者に限る。）をいう。

（２８）　「清算委託取引」とは、清算受託契約に基づく個別の有価証券等清算取次ぎの委託により成立する受託清算参加者及び清算委託者の間の法律関係であって、当該委託により成立する清算約定（委託分）と同一の経済的効果を有するものをいう。

（２８）の２　「清算委託取引（決済型)」とは、清算委託取引のうち、本業務方法書等の定めるところにより、変動証拠金の授受を行わず、損益差金の授受を行うものをいう。

（２８）の３　「清算委託取引（担保型)」とは、清算委託取引のうち、本業務方法書等の定めるところにより、変動証拠金の授受を行うものをいう。

（２９）　「清算参加者」とは、金利スワップ清算資格を有する者をいう。

（３０）　「清算参加者契約」とは、本業務方法書等をその内容に含む当社と清算参加者との間の契約をいい、当社が定める様式により締結されるものをいう。

（３１）　「清算受託契約」とは、金利スワップ取引を対象取引とする有価証券等清算取次ぎの委託を目的とした当社が定める様式により締結される清算委託者及び清算参加者間の契約（当該契約に基づく清算参加者及び清算委託者の間の合意を含む。）をいう。

（３２）　「清算取次原取引」とは、清算委託者と清算参加者又は他の清算委託者との間の金利スワップ取引であって、有価証券等清算取次ぎの基となる取引をいう。

（３３）　「清算取次口座」とは、第６０条第１項に規定する清算取次口座をいう。

（３４）　「清算約定」とは、当社が債務負担をすることにより成立する当社と清算参加者との間の金利スワップ取引をいう。

（３５）　「清算約定（委託分)」とは、清算約定のうち、受託清算参加者が清算委託者の有価証券等清算取次ぎの委託に基づき、当該清算委託者の計算により行うものをいう。

（３５）の２　「清算約定（決済型)」とは、清算約定のうち、本業務方法書等の定めるところにより、変動証拠金の授受を行わず、損益差金の授受を行うものをいう。

（３６）　「清算約定（自己分)」とは、清算約定のうち、清算参加者が自己の計算により行うものをいう。

（３６）の２　「清算約定（担保型)」とは、清算約定のうち、本業務方法書等の定めるところにより、変動証拠金の授受を行うものをいう。

（３６）の３　「損益差金」とは、次に掲げる金銭を総称していう。

ａ　第６１条の２第１項第１号に掲げる現在価値の変動に係るエクスポージャーを決済する目的で、当社営業日ごとに、当社及び清算参加者の間で授受される金銭

ｂ　第６１条の２第１項第２号に掲げる現在価値の変動に係るエクスポージャーを決済する目的で、当社営業日ごとに、当社及び受託清算参加者の間で授受される金銭

ｃ　第６１条の２第１項第３号に掲げる現在価値の変動に係るエクスポージャーを決済する目的で、当社営業日ごとに、受託清算参加者及び清算委託者の間で授受される金銭

（３６）の４　「損益差金等」とは、損益差金及び損益差金に係る調整金を総称していう。

（３６）の５　「損益差金に係る調整金」とは、第８３条の２第１項に規定する金銭をいう。
（３７）　「損失補填財源」とは、本業務方法書等の定めるところにより、清算参加者の破綻等により当社に生じる損失の補填に充てられるべき固定的損失補填財源及び流動的損失補填財源をいう。
（３８）　「第一階層金利スワップ決済保証準備金」とは、清算参加者の破綻等による損失の補填に充てるために、当社が規則で定めるところにより積み立てる額の準備金をいう。
（３９）　「第二階層金利スワップ決済保証準備金」とは、清算参加者の破綻等による損失の補填に充てるために、当社が規則で定めるところにより積み立てる額の準備金をいう。
（４０）　「第二階層清算参加者負担限度額」とは、第１０３条の規定により当社に預託した金利スワップ清算基金の取崩しを受ける各清算参加者ごとに、同条第１項の破綻清算参加者に係る破綻認定日の属する破綻処理単位期間の開始日の前当社営業日における当該各清算参加者の金利スワップ清算基金所要額をいう。
（４１）　「第三階層特別清算料」とは、第１０５条の規定により清算参加者から当社に支払われる金銭（日本円に限る。）をいう。
（４２）　「第三階層特別清算料担保金」とは、第１０７条第１項第１号に掲げる目的で、当該清算参加者が当社に預託する金銭（日本円に限る。）をいう。
（４３）　「第四階層特別清算料」とは、第１０６条の規定により清算参加者から当社に支払われる金銭をいう。
（４４）　「第四階層特別清算料担保金」とは、第１０７条第１項第２号に掲げる目的で、当該清算参加者が当社に預託する金銭をいう。
（４５）　「代用有価証券」とは、金利スワップ清算基金、当初証拠金、委託当初証拠金又は破綻時証拠金として代用預託することのできる有価証券として当社が定めるものをいう。
（４５）の２　「建玉」とは、証券取引等業務方法書第４５条の２第２項に規定する建玉をいう。
（４６）　「他の清算業務」とは、当社が行う金融商品債務引受業等及びこれに附帯する業務のうち金利スワップ取引清算業務以外のものをいう。
（４７）　「適格金利スワップ取引」とは、清算参加者間における当社が定める要件を満たす金利スワップ取引をいう。
（４８）　削除
（４９）　「当社営業日」とは、休業日以外の日をいう。
（５０）　「当初証拠金」とは、第６１条第１項第１号に掲げる債務を担保する目的で清算参加者又は清算委託者が当社に預託する金銭（日本円及び当社が指定する通貨に限る。）又は代用有価証券をいう。
（５１）　「特別清算料」とは、第三階層特別清算料及び第四階層特別清算料を総称していう。
（５２）　「特別清算料担保金」とは、第三階層特別清算料担保金及び第四階層特別清算料担保金を総称していう。
（５２）の２　「取引毎コンプレッション」とは、第５３条の規定に基づき、当社が定める方法により、コンプレッションを行うことをいう。

（５３）　「取引ポジション」とは、次のａ又はｂに掲げる金利スワップ取引の区分に応じ、当該ａ又はｂに定める金利スワップ取引上の地位の別をいう。

ａ　当事者の双方が変動金利の支払義務を負う金利スワップ取引　コンファメーション又は本業務方法書等の定めるところにより変動金利を支払うべき当該金利スワップ取引上の各地位の別

ｂ　上記ａ以外の金利スワップ取引　変動金利支払人又は固定金利支払人の別

（５４）　「日中証拠金」とは、当初証拠金のうち、第６７条から第７０条までの規定に従って預託されるものをいう。

（５４）の２　「日中証拠金算出時カスタマーバッファー利用可能額」とは、第６９条第１項に定める清算委託者の日中証拠金所要額を算出した時点で当該清算委託者の委託取引口座に充当可能なカスタマーバッファーの額（カスタマーバッファー利用上限額から、日中証拠金を算出した時点で当該委託取引口座に充当されているカスタマーバッファーの額を減じた額（当該減じた額がカスタマーバッファー未充当残高を超える場合には、当該カスタマーバッファー未充当残高））をいう。

（５４）の２の２　「ニューヨーク営業日」とは、ニューヨークにおいて銀行が営業しており、かつ米ドルの資金決済が行われている日をいう。

（５４）の３　削除

（５４）の４　「ノンヘッジ口座」とは、第５９条第７項の規定によりノンヘッジ口座として届出を受けた委託取引口座の種別をいう。

（５５）　「破綻時証拠金」とは、第１０８条第１項に定める債務を担保する目的で清算参加者が当社に預託する金銭（日本円及び当社が指定する通貨に限る。）又は代用有価証券をいう。

（５６）　「破綻処理単位期間」とは、清算参加者について破綻等が認定された場合（当該認定の時点で既に破綻処理単位期間が開始している場合を除く。）における当該清算参加者に係る破綻認定日から３０日を経過するまでの期間（当該期間中に他の清算参加者について破綻等が認定された場合には、当該期間は、当該他の清算参加者に係る破綻認定日から３０日を経過するまでの期間に延長されるものとし、延長後の期間中に他の清算参加者について破綻等が認定された場合も同様とする。）をいう。

（５７）　「破綻処理入札」とは、第９５条に規定する破綻処理入札をいう。

（５８）　「破綻清算参加者」とは、当社が破綻等を認定した清算参加者をいう。

（５９）　「破綻等」とは、次に掲げるいずれかの事由をいう。

ａ　支払不能（破産法（平成１６年法律第７５号）第２条第１１項に規定する支払不能をいう。）若しくはそのおそれ又は債務超過（破産法第１６条第１項に規定する債務超過をいう。）となったこと。

ｂ　手形交換所又は電子記録債権法（平成１９年法律第１０２号）第２条第２項に規定する電子債権記録機関による取引停止処分を受けたこと。

ｃ　支払の停止（破産法第１５条第２項の規定により支払不能を推定させる支払の停止をいう。）又はこれに準ずる事由が生じたこと。

ｄ　解散（合併による解散を除く。）したこと。

ｅ　破産手続開始、再生手続開始、更生手続開始、特別清算開始又は外国倒産処理手続の承認の申立て（外国の法令上これらに相当する申立てを含む。）があったこと。

ｆ　破産手続、再生手続、更生手続又は特別清算の開始の原因となる事実（外国の法令上これらに相当する事実を含む。）が生じたこと。

ｇ　国債証券先物取引の委託に関して指定市場開設者が定める先物・オプション取引口座設定約諾書の定めるところにより、又は有価証券等清算取次ぎの委託に関して証券取引等業務方法書第３９条の規定に従い締結された国債先物等清算受託契約書の定めるところにより、当然に期限の利益を喪失したこと（その清算参加者口座にクロスマージン対象国債先物清算約定又はクロスマージン対象金利先物清算約定が記録されている清算参加者（国債先物等清算参加者である者を除く。）に限る）。

（６０）　「破綻認定日」とは、清算参加者について当社が破綻等を認定した日をいう。

（６０）の２　「バックアップ受託者」とは、清算委託者に対し現に有価証券等清算取次ぎを行っている受託清算参加者について破綻等が認定された場合に、当該清算委託者の計算において成立している清算約定（委託分）及び清算委託取引に係る権利義務を承継する先として、第４５条の２に定めるところによりあらかじめ当該清算委託者から指定を受けている受託清算参加者（第１２条の２に規定する承認を受けた清算参加者に限る。）をいう。

（６１）　削除

（６２）　「非居住者」とは、外国為替及び外国貿易法（昭和２４年法律第２２８号）第６条第１項第６号に規定する非居住者をいう。

（６２）の２　「米ドル建清算約定」とは、清算約定のうち、想定元本及び決済通貨が米ドル建てのものをいう。

（６２）の３　「ヘッジ口座」とは、第５９条第７項の規定によりヘッジ口座として届出を受けた委託取引口座の種別をいう。

（６３）　「変動証拠金」とは、次に掲げる金銭を総称していう。

ａ　第６１条第１項第３号に掲げる債務を担保する目的で、当社営業日ごとに、当社及び清算参加者の間で授受される金銭

ｂ　第６１条第１項第４号に掲げる債務を担保する目的で、当社営業日ごとに、当社及び受託清算参加者の間で授受される金銭

ｃ　第６１条第１項第５号に掲げる債務を担保する目的で、当社営業日ごとに、受託清算参加者及び清算委託者の間で授受される金銭

（６３）の２　「変動証拠金等」とは、変動証拠金、変動証拠金に係る利息、決済金額その他清算約定に基づいて授受する金銭をいう。

（６４）　「法人等」とは、会社、組合その他これらに準ずる事業体（外国におけるこれらに相当するものを含む。）をいう。

（６５）　「本業務方法書等」とは、本業務方法書、規則及びＩＳＤＡ関連取扱文書を総称していう。

（６６）　「流動的損失補填財源」とは、本業務方法書等の規定に従い破綻処理清算約定の通貨の種類ごとに按分された第三階層特別清算料及び第四階層特別清算料をいう。

（６７）　「連結自己資本規制比率」とは、特別金融商品取引業者及びその子法人等の保有する資産等に照らし当該特別金融商品取引業者及びその子法人等の自己資本の充実の状況が適当であるかどうかを判断するための基準を定める件（平成２２年１２月金融庁告示第１２８号）第２条に規定する連結自己資本規制比率をいう。

（６８）　「役員」とは、会社法（平成１７年法律第８６号）第３２９条に規定する役員（株式会社以外の法人等にあっては、法令上株式会社における役員と同様に取り扱われている者）をいう。

（６８）の２　「ユーロ建清算約定」とは、清算約定のうち、想定元本及び決済通貨がユーロ建てのものをいう。

（６９）　「ＩＳＤＡ」とは、Ｉｎｔｅｒｎａｔｉｏｎａｌ　Ｓｗａｐｓ　ａｎｄ　Ｄｅｒｉｖａｔｉｖｅｓ　Ａｓｓｏｃｉａｔｉｏｎ，　Ｉｎｃ．（国際スワップ・デリバティブズ協会）をいう。

（７０）　「ＩＳＤＡ関連取扱文書」とは、当社が、規則の規定に基づき、清算約定にＩＳＤＡ基本契約及びＩＳＤＡ定義集を適用するにあたり必要な事項その他の事項に関し、清算参加者への通知又は公示により定めた文書であって、当社が定めるものをいう。

（７１）　「ＩＳＤＡ基本契約」とは、ＩＳＤＡが２００３年に公表した２００２　ＩＳＤＡ　Ｍａｓｔｅｒ　Ａｇｒｅｅｍｅｎｔ（ＩＳＤＡが公表した文書による変更、修正又は追加のうち当社が定めるものを含む。）で清算約定に適用されるものをいう。

（７２）　「ＩＳＤＡ定義集」とは、ＩＳＤＡが２０２１年に公表した２０２１　ＩＳＤＡ　Ｉｎｔｅｒｅｓｔ　Ｒａｔｅ　Ｄｅｒｉｖａｔｉｖｅｓ　Ｄｅｆｉｎｉｔｉｏｎｓ（ＩＳＤＡが公表した変更、修正又は追加のうち当社が定めるものを含む。）をいう。

（７２）の２　「ＪＳＣＣ提案型コンプレッション」とは、第５３条の２の４の規定に基づき、当社が定める方法により、二以上の清算参加者又は清算委託者に係る清算約定についてコンプレッションを行うことをいう。

（７３）　「Ｔａｒｇｅｔ営業日」とは、ユーロの資金決済システムであるｔｈｅ　Ｔｒａｎｓ－Ｅｕｒｏｐｅａｎ　Ａｕｔｏｍａｔｅｄ　Ｒｅａｌ－Ｔｉｍｅ　Ｇｒｏｓｓ　Ｓｅｔｔｌｅｍｅｎｔ　Ｅｘｐｒｅｓｓ　Ｔｒａｎｓｆｅｒ　Ｓｙｓｔｅｍが稼働しており、かつユーロの資金決済が行われている日をいう。

２　本業務方法書等において使用する用語のうち別表の「用語」欄に掲げる用語は、それぞれ同表の「条項」欄に掲げるＩＳＤＡ定義集の規定に係る「ＩＳＤＡ定義集」欄に掲げる用語をいうものとする。

３　金融商品取引法又はＩＳＤＡ定義集における用語の意義と本業務方法書等における用語の意義が異なる場合には、本業務方法書等における用語の意義が優先する。

（金融商品債務引受業等）

第３条　当社は、本業務方法書等に基づいて行う金利スワップ取引を対象取引とする金融商品債務引受業のほか、これに係る金融商品取引法第１５６条の６第１項の業務を行う。

（清算対象取引）

第４条　当社の金利スワップ取引清算業務の対象とする債務の起因となる取引（以下「清算対象取引」という。）は適格金利スワップ取引とする。

（休業日）

第５条　当社は、次に掲げる日を休業日とする。

（１）　日曜日

（２）　国民の祝日に関する法律（昭和２３年法律第１７８号）に規定する休日

（３）　土曜日

（４）　１月２日、同月３日及び１２月３１日

２　当社は、天災地変、戦争又は暴動等の社会的動乱、電気又は通信等の社会インフラの全面的な機能停止、裁判所等の公的機関による命令その他のやむを得ない事由により金利スワップ取引清算業務の全部を一日以上停止する必要があると認める場合に限り、その必要な限度において、臨時休業日を定めることができる。

３　当社は、金利スワップ取引清算業務の適切な遂行を確保するために必要があると認める場合に限り、その必要な限度において、金利スワップ取引清算業務の全部若しくは一部を臨時に停止し又は臨時に行うことができる。

４　前２項の場合には、当社は、すべての清算参加者に対し、あらかじめその旨を通知する。

（他の清算参加者又は他の清算委託者に対する意思表示の取扱い）

第６条　当社は、清算参加者又は清算委託者から、本業務方法書等の定めるところにより、他の清算参加者又は他の清算委託者に対する意思表示を受けた場合には、当該他の清算参加者又は他の清算委託者のために当該意思表示を受領するものとする。

２　当社は、当社が定める方法により、清算参加者及び清算委託者が前項の意思表示の有無及び内容を知ることができるようにする措置を講じるものとする。

（代用有価証券）

第７条　代用有価証券の代用価格は、当社が定める額とする。ただし、当社は、相場に著しい変動が生じた場合等、代用有価証券の担保価値を適正に評価するために特に必要があると認めた場合には、代用価格を臨時に変更することができる。

２　代用有価証券の預託の方法その他代用有価証券に関し必要な事項は、当社が定める。

第２章　清算参加者

第１節　金利スワップ清算資格の取得

（金利スワップ清算資格の取得の申請及び承認）

第８条　次に掲げる者は、当社が定めるところにより、当社に金利スワップ清算資格の取得の申請を行うことができる。

（１）　金融商品取引業者（金融商品取引法第２８条第１項第２号に掲げる行為に係る業務の登録を受けた者に限る。）

（２）　登録金融機関

２　当社は、前項の規定により金利スワップ清算資格の取得の申請を受けた場合において、次条の規定による審査（以下「承認審査」という。）により、金利スワップ清算資格の取得申請者（以下「取得申請者」という。）に対する金利スワップ清算資格の取得の承認を行うことが当社の金利スワップ取引清算業務の適切な遂行を確保する観点から適当であると認めるときは、取得申請者に対する金利スワップ清算資格の取得の承認を行う。

３　第１項の規定にかかわらず、特定承継金融機関等（預金保険法（昭和４６年法律第３４号。以下「預保法」という。）第１２６条の３４第３項第５号に定める特定承継金融機関等をいう。以下同じ。）は、当社が定めるところにより、当社に金利スワップ清算資格の取得の申請を行うことができる。この場合において、当社は、取得申請者に対する金利スワップ清算資格の取得の承認を行うことができる。

４　前２項の承認は、金利スワップ清算資格を取得すべき期日（以下本節において「資格取得予定期日」という。）を指定して行う。

５　親会社等から親会社等保証を受けようとする取得申請者（以下本節において「被保証取得申請者」という。）は、第１項の規定による金利スワップ清算資格の取得の申請に際し、当社が定める様式による当該親会社等の保証に関する書面（当社が当該書面と内容が同一であると認める書面を含む。）を当社に提出するものとする。

（金利スワップ清算資格の要件）

第９条　承認審査は、取得申請者に関する次に掲げる事項その他当社による金利スワップ取引清算業務の適切な遂行を確保する観点から必要と認める事項について、当社が通知又は公示により審査上の観点及び確認事項として定めるところにより行うものとする。

（１）　経営体制

当社が行う金利スワップ取引清算業務の運営に鑑みて適当でないと認められる者の支配又は影響を受けていないことなど、当社が行う金利スワップ取引清算業務について社会的な信用が十分に確保されると見込まれる健全な経営体制であること。

（２）　財務基盤

資格取得予定期日において、次のａ又はｂに掲げる取得申請者の区分に従い、当該ａ又はｂに定める基準に適合すると見込まれ、かつ、清算参加者として安定した収益力が見込まれること。

ａ　金融商品取引業者

（ａ）　自己資本額が５，０００万米ドル又は５０億円のいずれか低い額以上であること。

（ｂ）　自己資本規制比率が２００パーセント（その信用状況に照らし当社が必要と認める場合には２５０パーセント）を上回っていること。

（ｃ）　特別金融商品取引業者（金融商品取引法第５７条の５第２項の届出を行う者に限る。以下同じ。）にあっては、連結自己資本規制比率が２００パーセント（その信用状況に照らし当社が必要と認める場合には２５０パーセント）を上回っていること。

（ｄ）　相当の信用力を有すること。

ｂ　登録金融機関

（ａ）　自己資本額が５，０００万米ドル又は５０億円のいずれか低い額以上であること。

（ｂ）　国際統一基準行、農林中央金庫、国際統一基準金庫及び株式会社商工組合中央金庫（以下「国際統一基準行等」という。）にあっては、次のイからハまでに該当していること（外国銀行にあっては、これに準ずる場合に該当していること）。

イ　単体又は連結普通株式等Ｔｉｅｒ１比率（農林中央金庫及び国際統一基準金庫にあっては、単体又は連結普通出資等Ｔｉｅｒ１比率とする。以下同じ。）が４．５パーセント（その信用状況に照らし当社が必要と認める場合には５．６２５パーセント）を上回っていること。

ロ　単体又は連結Ｔｉｅｒ１比率が６パーセント（その信用状況に照らし当社が必要と認める場合には７．５パーセント）を上回っていること。

ハ　単体又は連結総自己資本比率が８パーセント（その信用状況に照らし当社が必要と認める場合には１０パーセント）を上回っていること。

（ｃ）　国際統一基準行等、外国銀行及び保険会社以外の登録金融機関（以下「国内基準行等」という。）にあっては、国内基準に係る単体又は連結自己資本比率が４パーセント（その信用状況に照らし当社が必要と認める場合には５パーセント）を上回っていること。

（ｄ）　保険会社にあっては、単体又は連結ソルベンシー・マージン比率が４００パーセント（その信用状況に照らし当社が必要と認める場合には５００パーセント）を上回っていること。

（ｅ）　相当の信用力を有すること。

（３）　業務執行体制

ａ　清算約定の決済、損失の危険の管理並びに法令、法令に基づく行政官庁の処分及び本業務方法書等の遵守に関し、適切な業務執行の体制を備えていること。

ｂ　破綻した清算参加者の清算約定の処理手続に参加できる業務執行の体制を備えていること（他者（当社が定める者に限る。）に対する当社が定める清算約定の処理手続への参加の委託により当該業務執行の体制を備えている場合を含む。）。

２　被保証取得申請者に係る承認審査は、前項第２号の事項に代えて、当該被保証取得申請者が、

資格取得予定期日において、次の各号に掲げる被保証取得申請者の区分に従い、当該各号に定める基準に適合すると見込まれ、かつ、清算参加者として安定した収益力が見込まれることについて行うものとする。

（１）　金融商品取引業者

ａ　自己資本額が５，０００万米ドル又は５０億円のいずれか低い額以上であること及び親会社等（当該被保証取得申請者のために親会社等保証を行う当該被保証取得申請者の親会社等に限る。以下本項において同じ。）の自己資本額（親会社等が金融商品取引業者又は登録金融機関でない場合には、これに相当する額）が５，０００万米ドル又は５０億円のいずれか低い額以上（親会社等が複数の清算参加者のために親会社等保証を行う場合には、５，０００万米ドル又は５０億円のいずれか低い額に親会社等保証を受ける清算参加者の数（親会社等が清算参加者である場合には当該数に１を加えた数）を乗じた額。次号において同じ。）であること。

ｂ　前項第２号ａの（ｂ）及び（ｃ）の基準に適合すること又は親会社等が同号ａの（ｂ）及び（ｃ）若しくは同号ｂの（ｂ）から（ｄ）までのいずれかの基準に適合すること（親会社等が金融商品取引業者又は登録金融機関でない場合には、これに準ずる場合に該当していること）。この場合、信用状況については、親会社等の信用状況により判断するものとする。

ｃ　親会社等が相当の信用力を有すること。

（２）　登録金融機関

ａ　自己資本額が５，０００万米ドル又は５０億円のいずれか低い額以上であること及び親会社等の自己資本額（親会社等が金融商品取引業者又は登録金融機関でない場合には、これに相当する額）が５，０００万米ドル又は５０億円のいずれか低い額以上であること。

ｂ　前項第２号ｂの（ｂ）の基準に適合すること又は親会社等が同号ａの（ｂ）及び（ｃ）若しくは同号ｂの（ｂ）から（ｄ）までのいずれかの基準に適合すること（親会社等が金融商品取引業者又は登録金融機関でない場合には、これに準ずる場合に該当していること）。この場合、信用状況については、親会社等の信用状況により判断するものとする。

ｃ　親会社等が相当の信用力を有すること。

３　第１項第３号ｂの委託の変更その他必要な事項は、当社が定める。

（金利スワップ清算資格の取得手続の履行）

第１０条　当社が第８条第２項の規定により金利スワップ清算資格の取得の承認を行った場合は、当該承認に係る取得申請者は、資格取得予定期日の前当社営業日までに、金利スワップ清算基金の預託その他当社が定める金利スワップ清算資格の取得手続を履行するものとする。

２　前項の取得申請者が資格取得予定期日の前当社営業日までに同項の手続を履行しない場合には、金利スワップ清算資格の取得申請を取り下げたものとみなす。

３　当社が第８条第３項の規定により金利スワップ清算資格の取得の承認を行った場合は、当該承認に係る取得申請者は、当社がその都度定める日までに、金利スワップ清算基金の預託その他当社が定める金利スワップ清算資格の取得手続を履行するものとする。

（清算参加者契約の締結）

第１１条　前条第１項又は第３項の取得申請者は、資格取得予定期日までに、当社との間で、当社が定める様式による清算参加者契約を締結しなければならない。

（金利スワップ清算資格取得の日）

第１２条　当社は、取得申請者が第１０条第１項又は第３項の規定による手続（同項の規定による手続にあっては、当社が資格取得予定期日までの日を履行の期日と定めたものに限る。）を履行し、前条の規定により当社との間で清算参加者契約を締結した場合には、資格取得予定期日に、当該取得申請者に金利スワップ清算資格を付与する。

２　当社は、前項の規定により取得申請者に金利スワップ清算資格を付与した場合には、速やかにその旨を他の清算参加者に通知し、かつ公表する。

第２節　クライアント・クリアリングの取扱いの承認

（クライアント・クリアリングの取扱いの承認）

第１２条の２　清算参加者（取得申請者を含む。以下本条において同じ。）は、クライアント・クリアリングの取扱いを行おうとする場合には、あらかじめ、当社が定めるところにより、当社にクライアント・クリアリングの取扱いに係る申請を行い、当社の承認を受けなければならない。

２　当社は、前項の申請を受けた場合において、前項の申請を行った清算参加者のクライアント・クリアリングに係る清算約定の決済、損失の危険の管理及び利益相反の防止について当社が通知又は公示により確認上の観点及び確認事項として定めるところにより確認を行い、適切な業務執行体制を備えていると認めるときは、クライアント・クリアリングの取扱いの承認を行う。

３　前項の規定にかかわらず、当社は、特定承継金融機関等である取得申請者から第１項の申請を受けた場合には、クライアント・クリアリングの取扱いの承認を行うことができる。

４　当社は、前２項の承認を行った場合には、速やかにその旨を他の清算参加者に通知し、かつ公表する。

第３節　清算参加者の義務

（清算参加者代表者）

第１３条　清算参加者は、その代表取締役又は代表執行役（清算参加者が外国法人である場合には、日本における代表者）のうちから、当該清算参加者を代表する者１人を、当社が定めるところにより、あらかじめ清算参加者代表者として当社に届け出なければならない。

２　清算参加者と当社との関係においては、清算参加者代表者のみが当該清算参加者を代表するものとする。ただし、日常業務に関しては、あらかじめその範囲を明確にして、当社に届け出た日常業務代行者をして行わせることができる。

（決済業務責任者）

第１４条　清算参加者は、清算約定の決済に係る業務の統括に当たらせるため、その役員又は従業員のうちから決済業務責任者１人を選任し、当社が定めるところにより、当社に届け出なければならない。

（役員又は他の者との共同関係若しくは支配関係）

第１５条　当社は、清算参加者の役員又は他の者との共同関係若しくは支配関係が当社の金利スワップ取引清算業務の運営に鑑みて適当でないと認めるときに限り、当該清算参加者を審問のうえ、理由を示して、その変更を請求することができる。ただし、当該清算参加者が陳述書を提出したときは、その提出をもって、審問に代えることができる。

２　前項に規定する審問の手続は、当社が定めるところによるものとする。

３　当社は、正当な理由がないにもかかわらず清算参加者が第１項の審問に応じない場合には、審問を行わずに同項の変更請求を行うことができる。

４　清算参加者は、第１項の変更請求が不当であると認めるときは、変更請求の通知を受けた日から１０日以内に、当社に対し書面をもって、理由を示して、異議の申立てを行うことができる。

５　当社は、前項の異議の申立てを受理したときは、遅滞なく、取締役会を開催する。

６　前項の取締役会において、第１項の変更請求を変更し、又は取り消すことが適当であると認められたときは、当社は、直ちに同項の変更請求を変更し、又は取り消すものとする。

（清算参加者による手数料の支払い）

第１６条　清算参加者は、当社が規則で定める手数料を、その定めるところにより、当社に支払わなければならない。

（金利スワップ清算基金の預託）

第１７条　清算参加者は、当該清算参加者の当社に対する金利スワップ取引清算業務に係る一切の債務（当社が他の清算参加者の破綻等を認定した場合において、当社に生じた損失を補填するために当該清算参加者が負担する債務及び第８４条の５第１項の規定により当社と清算参加者との間に成立した債権債務について生じる損失を含む。）を担保する目的で、当社が定めるところにより、金利スワップ清算基金を当社に預託しなければならない。

２　清算参加者は、当社に預託している金利スワップ清算基金の額（当社が他の清算参加者の破綻等を認定した場合において本業務方法書等の定めるところにより金利スワップ清算基金の全部又は一部が当社に生じた損失の補填を目的として取り崩された場合には、その取り崩された額を減じた額。以下同じ。）が当社が規則で定める金利スワップ清算基金所要額（以下「金利スワップ清算基金所要額」という。）に満たない場合は、その不足額以上の金利スワップ清算基金を、不足額が生じた日の翌当社営業日の午後２時までに当社に追加預託しなければならない。

３　前２項の規定により預託する通貨が日本円以外の場合には、当社が定める外国為替相場により

換算した当該通貨１単位当たりの円貨額に当社が定める率を乗じて評価する。

４　清算参加者は、当社に預託している金利スワップ清算基金の額が金利スワップ清算基金所要額を上回る場合には、その超過額を限度として、当社に対し、金利スワップ清算基金の返還を請求することができる。

５　当社は、本業務方法書等の定めるところにより、金利スワップ清算基金（金銭を異なる通貨へ両替した際に要した費用及び代用有価証券の換価処分に要した費用を控除した残額）を第１項に規定する債務の弁済に充当することができる。

６　金利スワップ清算基金の預託は、金利スワップ清算基金が金銭である場合には担保目的の消費寄託とし、金利スワップ清算基金が代用有価証券である場合には担保目的の無償の消費貸借とする。

７　清算参加者は、民法（明治２９年法律第８９号）及び商法（明治３２年法律第４８号）の規定にかかわらず、本業務方法書等で定める場合に限り、金利スワップ清算基金の返還その他の請求をすることができる。

（金利スワップ取引清算業務に関する免責）

第１８条　当社は、清算参加者又は清算委託者が、当社が行う金利スワップ取引清算業務に関し損害（清算約定に係る債務の不履行による損害その他当社が定める損害を除く。）を受けることがあっても、当社に故意又は重過失が認められる場合を除き、これを賠償する責めに任じない。

（届出事項）

第１９条　清算参加者は、次に掲げる行為をしようとする場合（当該清算参加者がその親会社等から親会社等保証を受けている場合には、当該清算参加者又は当該親会社等が次に掲げる行為をしようとする場合）には、当社が定めるところにより、あらかじめ（あらかじめ届け出ることが不可能又は法令遵守その他のやむを得ない事由により著しく困難である場合には、事後速やかに）その内容を当社に届け出なければならない。

（１）　業務（金融商品取引業者にあっては金融商品取引法第２８条第１項第２号に掲げる業務をいい、登録金融機関にあっては登録金融機関業務をいう。）の廃止

（２）　他の法人と合併して消滅することとなる場合における当該合併及び他の法人と合併して会社を設立する場合における当該合併

（３）　合併及び破産手続開始の決定以外の事由による解散

（４）　分割による事業（金利スワップ取引に関する事業に限る。以下本条、第２４条、第２７条の４、第２８条第７項、第４０条、第４０条の２、第４０条の３及び第４０条の４において同じ。）の全部又は一部の他の法人への承継

（５）　事業の全部又は一部の譲渡

（６）　他の法人と合併して合併後存続することとなる場合における当該合併（金利スワップ取引に関する事業に関係するものに限る。）

（７）　分割による事業の全部又は一部の他の法人からの承継

（８）　事業の全部又は一部の譲受け
（９）　商号又は名称の変更（英文の商号又は名称の変更を含む。）
（１０）　本店又は主たる事務所の変更

（報告事項）
第２０条　清算参加者は、当社が定める場合に該当することとなったときは、直ちにその内容を当社に報告しなければならない。

（清算参加者の調査）
第２１条　当社は、清算参加者に関する次の事項が当社の金利スワップ取引清算業務に及ぼし得る影響の程度その他の事情を勘案し、金利スワップ取引清算業務の適正かつ確実な遂行を確保する観点から必要があると認める場合には、その必要な限度において、当該清算参加者に対し、当該清算参加者（当該清算参加者がその親会社等から親会社等保証を受けている場合には、当該清算参加者又は当該親会社等。第２号及び第３号において同じ。）の業務又は財産に関して参考となるべき報告若しくは資料の提出を請求し、又は当社の職員をして当該清算参加者の業務若しくは財産の状況又は帳簿、書類その他の物件を検査させることができる。
（１）　清算参加者による本業務方法書等の遵守の状況
（２）　清算参加者の財務の状況
（３）　清算参加者の当社に対する債務の履行の確実性
２　前項の検査に関し必要な事項は、当社が規則で定める。

第４節　清算参加者の申請による金利スワップ清算資格の喪失

（金利スワップ清算資格の喪失申請）
第２２条　清算参加者が金利スワップ清算資格を喪失しようとするときは、当社が定めるところにより、金利スワップ清算資格の喪失の申請をしなければならない。
２　当社は、清算参加者から前項の規定による金利スワップ清算資格の喪失の申請があった場合には、その旨を他の清算参加者に速やかに通知し、かつ公表する。

（金利スワップ清算資格の喪失）
第２３条　清算参加者が前条第１項の規定により金利スワップ清算資格の喪失の申請をした場合、当該清算参加者は、その申請の日の翌日から起算して３０日目の日の当社が定める時点又は当該清算参加者を当事者とする清算約定で未決済のもののすべてが解消された時点のいずれか遅い時点（当該申請が破綻処理単位期間中に行われた場合又は当該申請の日から当該清算参加者について金利スワップ清算資格の喪失の効力が生じるまでの間に破綻処理単位期間が開始した場合には、破綻処理単位期間が終了する日の当社が定める時点又は当該清算参加者を当事者とする清算約定で未決済のもののすべてが解消された時点のいずれか遅い時点）において、金利スワップ

清算資格を喪失する。

２　当社は、清算参加者が前項の規定により金利スワップ清算資格を喪失した場合には、その旨を他の清算参加者に通知し、かつ公表する。

（金利スワップ清算資格の喪失申請者の合併等の場合の特例）

第２４条　金利スワップ清算資格の喪失申請者が金利スワップ清算資格の喪失と同時に、金利スワップ清算資格を取得する者又は金利スワップ清算資格を有する者に合併され、分割により事業を承継させ又は事業を譲渡する等の場合において、当該清算参加者の清算約定で未決済のもののすべてを解消させる必要がないと当社が認めるとき（受託清算参加者にあっては、当該受託清算参加者が締結している清算受託契約のすべてを解約させる必要がないと当社が認めるときを含む。）は、前条第１項の規定にかかわらず、当該喪失申請者は、当社がその都度定める時点において、金利スワップ清算資格を喪失する。

（金利スワップ清算資格の喪失の際の金利スワップ清算基金の返還）

第２５条　当社は、清算参加者が金利スワップ清算資格を喪失（取消しによる喪失を含む。以下本条から第２７条までにおいて同じ。）したときは、遅滞なく金利スワップ清算基金を返還するものとする。ただし、当社は、当社に対する金利スワップ取引清算業務に係る債務がある場合その他本業務方法書等の定めるところにより金利スワップ清算基金を利用する必要があると認める場合には、その必要な限度において、金利スワップ清算基金の返還をしないことができる。

（金利スワップ清算資格の喪失の際の債務弁済）

第２６条　金利スワップ清算資格を喪失した者は、当社の金利スワップ取引清算業務に関して当社に対して返還請求権を有する金銭又は有価証券をもって、当該者が清算参加者として当社に対して負担した一切の債務の弁済に充てなければならない。

２　前項の金銭又は有価証券が同項の債務の弁済に不足する場合には、同項の金利スワップ清算資格を喪失した者は、当社がその都度指定する日までにその不足する債務の一切を弁済しなければならない。

（金利スワップ清算資格の喪失の際の本業務方法書等の適用）

第２７条　清算参加者が金利スワップ清算資格を喪失した場合において、当該喪失前の原因に基づいて生じた権利義務があるときは、当該権利義務について、本業務方法書等の定めが適用されるものとする。

第５節　クライアント・クリアリングの取扱いの廃止

（クライアント・クリアリングの取扱いの承認の取消申請）

第２７条の２　清算参加者は、クライアント・クリアリングの取扱いを廃止しようとするときは、

当社が定めるところにより、クライアント・クリアリングの取扱いの承認の取消しの申請をしなければならない。

（クライアント・クリアリングの取扱いの承認の取消申請者の未決済約定の取扱い）

第２７条の３　清算参加者は、クライアント・クリアリングの取扱いの承認の取消しの申請を行う場合には、あらかじめ、第４章第４節の規定による清算約定（委託分）の承継その他の方法により清算約定（委託分）で未決済のものをすべて解消するとともに、清算受託契約をすべて解約しなければならない。

（クライアント・クリアリングの取扱いの承認の取消申請者の合併等の場合の特例）

第２７条の４　清算参加者は、前条の場合において、クライアント・クリアリングの取扱いの承認の取消しと同時に、クライアント・クリアリングの取扱いの承認を受ける者又はクライアント・クリアリングの取扱いの承認を受けている者に合併され、分割により事業を承継させ又は事業を譲渡する等の場合で、清算約定（委託分）で未決済のもののすべてを解消させ、又は当該清算参加者が締結している清算受託契約のすべてを解約させる必要がないと当社が認めるときは、同条の規定にかかわらず、当社が認める範囲において、当該清算約定で未決済のものを解消し、又は当該清算受託契約を解約しないことができる。

（クライアント・クリアリングの取扱いの承認の取消し）

第２７条の５　当社は、クライアント・クリアリングの取扱いの承認の取消しを承認した場合は、速やかにその旨を他の清算参加者に通知し、かつ公表する。

第５節の２　日本円建て以外の通貨の適格金利スワップ取引に関する届出

（日本円建て以外の通貨の適格金利スワップ取引に関する届出）

第２７条の６　清算参加者が、想定元本及び決済通貨が日本円建て以外である適格金利スワップ取引について初めて債務負担の申込みを行おうとする場合には、あらかじめ、当該債務負担の申込みを行おうとする適格金利スワップ取引の想定元本及び決済通貨に係る通貨の種類を当社に届け出なければならない。

第５節の３　損益差金等の授受に関する届出

（損益差金等の授受に関する届出）

第２７条の７　清算参加者が、本業務方法書等の定めるところにより、清算約定について初めて損益差金等の授受の申込みを行おうとする場合には、あらかじめ、当社が定めるところにより、その旨を当社に届け出なければならない。

第６節　清算参加者に対する措置等

（清算参加者に対する措置）

第２８条　当社は、清算参加者（当該清算参加者がその親会社等から親会社等保証を受けている場合には、当該清算参加者又は当該親会社等）が次に掲げるいずれかの事由に該当することとなった場合において、当該事由の原因、再発生の可能性、当社の金利スワップ取引清算業務に及ぼし得る影響の程度その他の事情を勘案し、金利スワップ取引清算業務の適正かつ確実な遂行のため必要と認めるときは、当該清算参加者を審問のうえ、理由を示して、その必要な限度において、改善指示（当社の金利スワップ取引清算業務の運営上必要かつ適当と認められる限度において、当該清算参加者に対して行う業務執行体制等の改善に係る指示をいう。以下同じ。）、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引について新たな債務負担の全部若しくは一部の停止、当該清算参加者によるクロスマージンの承諾の停止（以下「クロスマージンの停止」という。）、当該清算参加者の金利スワップ清算資格の取消し又はクライアント・クリアリングの取扱いの承認の取消しの措置を行うことができる。この場合において、金利スワップ清算資格の取消しの措置を行うときは、取締役会による決議を要するものとする。

（１）　第１９条の規定による届出若しくは第２０条の規定による報告をせず、又は虚偽の届出若しくは報告をしたとき。

（２）　第２１条の規定による検査を拒否し、妨げ若しくは忌避したとき又は同条の規定による報告若しくは資料を提出せず、若しくは虚偽の報告若しくは資料を提出したとき。

（３）　業務執行体制に不備があると認められるとき。

（４）　前３号に掲げるもののほか、清算参加者が本業務方法書等若しくはこれらに基づく当社の措置に違反したとき又は清算参加者が当社若しくは清算参加者の信用を失墜させた場合において当社の金利スワップ取引清算業務の運営に鑑みて必要であると認めるとき。

２　当社は、清算参加者が次に掲げるいずれかの事由に該当することとなった場合において、当該事由の原因、再発生の可能性、当社の金利スワップ取引清算業務に及ぼし得る影響の程度その他の事情を勘案して必要と認めるときは、当該清算参加者を審問のうえ、理由を示して、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引についての新たな債務負担の全部又は一部の停止その他当社が必要かつ適当と認める措置を行うことができる。

（１）　第１５条の規定による役員又は他の者との共同関係若しくは支配関係の変更請求に応じないとき。

（２）　総株主等の議決権（総株主、総社員、総会員、総組合員又は総出資者の議決権をいい、株式会社にあっては、株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第８７９条第３項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含む。）の過半数が当社の金利スワップ取引清算業務の運営に鑑みて適当でないと認められる者によって保有されるに至ったとき。

（３）　相談役、顧問その他いかなる名称を有する者であるかを問わず、清算参加者に対し取締役又は執行役と同等以上の支配力を有する者が、当社の金利スワップ取引清算業務の運営に鑑

みて適当でないと認められるとき。

3　当社は、次の各号に掲げる場合に応じて、清算参加者が当該各号のいずれかの事由に該当することとなったと認める場合には、当該清算参加者を審問のうえ、その事由が消滅するまで、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引について新たな債務負担の全部若しくは一部の停止又は当該清算参加者の金利スワップ清算資格の取消しの措置を行うことができる。この場合において、金利スワップ清算資格の取消しの措置を行うときは、取締役会による決議を要するものとする。

（1）　当該清算参加者が親会社等保証を受けていない場合

a　当該清算参加者が金融商品取引業者である場合にあっては、自己資本規制比率（特別金融商品取引業者である場合は自己資本規制比率及び連結自己資本規制比率）が２５０パーセントを下回り、かつ、その信用力が相当悪化するおそれがあると当社が認めるとき。

b　当該清算参加者が国際統一基準行等である場合にあっては、次の（ａ）から（ｃ）までのいずれかに該当し、かつ、その信用力が相当悪化するおそれがあると当社が認めるとき（外国銀行にあっては、これに準ずる場合に該当したとき）。

（ａ）　単体又は連結普通株式等Ｔｉｅｒ１比率が５．６２５パーセントを下回ったとき。

（ｂ）　単体又は連結Ｔｉｅｒ１比率が７．５パーセントを下回ったとき。

（ｃ）　単体又は連結総自己資本比率が１０パーセントを下回ったとき。

c　当該清算参加者が国内基準行等である場合にあっては、国内基準に係る単体又は連結自己資本比率が５パーセントを下回り、かつその信用力が相当悪化するおそれがあると当社が認めるとき。

d　当該清算参加者が保険会社である登録金融機関である場合にあっては、単体又は連結ソルベンシー・マージン比率が５００パーセントを下回り、かつその信用力が相当悪化するおそれがあると当社が認めるとき。

e　その信用力が相当悪化したと当社が認めるとき。

（2）　当該清算参加者がその親会社等から親会社等保証を受けている場合

a　当該清算参加者が金融商品取引業者である場合にあっては、その自己資本規制比率（特別金融商品取引業者である場合は自己資本規制比率及び連結自己資本規制比率）が２５０パーセントを下回るとともに、当該親会社等が信用悪化事由に該当し、かつ、当該親会社等の信用力が相当悪化するおそれがあると当社が認めるとき。

b　当該清算参加者が国際統一基準行等である場合にあっては、次の（ａ）から（ｃ）までのいずれかに該当するとともに、当該親会社等が信用悪化事由に該当し、かつ、当該親会社等の信用力が相当悪化するおそれがあると当社が認めるとき（外国銀行にあっては、これに準ずる場合に該当したとき）。

（ａ）　単体又は連結普通株式等Ｔｉｅｒ１比率が５．６２５パーセントを下回ったとき。

（ｂ）　単体又は連結Ｔｉｅｒ１比率が７．５パーセントを下回ったとき。

（ｃ）　単体又は連結総自己資本比率が１０パーセントを下回ったとき。

ｃ　当該清算参加者が国内基準行等である場合にあっては、国内基準に係る単体又は連結自己資本比率が５パーセントを下回るとともに、当該親会社等が信用悪化事由に該当し、かつ、当該親会社等の信用力が相当悪化するおそれがあると当社が認めるとき。

ｄ　当該清算参加者が保険会社である登録金融機関である場合にあっては、その単体又は連結ソルベンシー・マージン比率が５００パーセントを下回るとともに、当該親会社等が信用悪化事由に該当し、かつ、当該親会社等の信用力が相当悪化するおそれがあると当社が認めるとき。

ｅ　当該親会社等の信用力が相当悪化したと当社が認めるとき。

４　前項第２号の「信用悪化事由」とは、次の各号に掲げる清算参加者の親会社等の区分に従い、当該各号に定める事由をいう。

（１）　金融商品取引業者である場合

自己資本規制比率（特別金融商品取引業者である場合は自己資本規制比率及び連結自己資本規制比率）が２５０パーセントを下回ること。

（２）　国際統一基準行等である場合

次のａからｃまでのいずれかに該当すること（外国銀行にあっては、これに準ずる場合に該当すること）。

ａ　単体又は連結普通株式等Ｔｉｅｒ１比率が５．６２５パーセントを下回ること。

ｂ　単体又は連結Ｔｉｅｒ１比率が７．５パーセントを下回ること。

ｃ　単体又は連結総自己資本比率が１０パーセントを下回ること。

（３）　国内基準行等である場合

国内基準に係る単体又は連結自己資本比率が５パーセントを下回ること。

（４）　保険会社である登録金融機関である場合

単体又は連結ソルベンシー・マージン比率が５００パーセントを下回ること。

（５）　前各号のいずれにも該当しない場合

前各号に準じる場合に該当していること。

５　当社は、次の各号に掲げる場合に応じて、清算参加者が当該各号のいずれかの事由に該当することとなったと認める場合には、当該清算参加者を審問のうえ、その事由が消滅するまで、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引について新たな債務負担の全部又は一部の停止の措置を行うことができる。

（１）　当該清算参加者が親会社等保証を受けていない場合

ａ　自己資本額が５，０００万米ドル又は５０億円のいずれか低い額を下回り、速やかな回復が見込めないとき。

ｂ　当該清算参加者が金融商品取引業者である場合にあっては、自己資本規制比率が２００パーセントを下回り、速やかな回復を見込めないとき。

ｃ　当該清算参加者が特別金融商品取引業者である場合にあっては、連結自己資本規制比率が

２００パーセントを下回り、速やかな回復が見込めないとき。

ｄ　当該清算参加者が国際統一基準行等である場合にあっては、次の（ａ）から（ｃ）までのいずれかに該当したとき（外国銀行にあっては、これに準ずる場合に該当したとき）。

（ａ）　単体又は連結普通株式等Ｔｉｅｒ１比率が４．５パーセントを下回り、速やかな回復が見込めないとき。

（ｂ）　単体又は連結Ｔｉｅｒ１比率が６パーセントを下回り、速やかな回復が見込めないとき。

（ｃ）　単体又は連結総自己資本比率が８パーセントを下回り、速やかな回復が見込めないとき。

ｅ　当該清算参加者が国内基準行等である場合にあっては、国内基準に係る単体又は連結自己資本比率が４パーセントを下回り、速やかな回復を見込めないとき。

ｆ　当該清算参加者が保険会社である場合にあっては、単体又は連結ソルベンシー・マージン比率が４００パーセントを下回り、速やかな回復が見込めないとき。

（２）　当該清算参加者がその親会社等から親会社等保証を受けている場合

ａ　当該清算参加者の自己資本額が５，０００万米ドル又は５０億円のいずれか低い額を下回り、速やかな回復が見込めないとき。

ｂ　当該親会社等の自己資本額（当該親会社等が金融商品取引業者又は登録金融機関でない場合には、これに相当する額）が５，０００万米ドル又は５０億円のいずれか低い額（当該親会社等が複数の清算参加者のために親会社等保証を行う場合には、５，０００万米ドル又は５０億円のいずれか低い額に親会社等保証を受ける清算参加者の数（当該親会社等が清算参加者である場合には当該数に１を加えた数）を乗じた額）を下回り、速やかな回復が見込めないとき。

ｃ　当該清算参加者が金融商品取引業者である場合にあっては、当該清算参加者が前号ｂ又はｃの事由に該当するとともに、当該親会社等が信用悪化事由に該当し、かつ、速やかな回復が見込めないとき。

ｄ　当該清算参加者が登録金融機関である場合にあっては、当該清算参加者が前号ｄからｆまでのいずれかの事由に該当するとともに、当該親会社等が信用悪化事由に該当し、かつ、速やかな回復が見込めないとき。

６　前項第２号ｃ及びｄの「信用悪化事由」とは、次の各号に掲げる清算参加者の親会社等の区分に従い、当該各号に定める事由をいう。

（１）　金融商品取引業者である場合

自己資本規制比率（特別金融商品取引業者である場合は自己資本規制比率又は連結自己資本規制比率）が２００パーセントを下回ること。

（２）　国際統一基準行等である場合

次のａからｃまでのいずれかに該当すること（外国銀行にあっては、これに準ずる場

合に該当すること）。

ａ　単体又は連結普通株式等Ｔｉｅｒ１比率が４．５パーセントを下回ること。

ｂ　単体又は連結Ｔｉｅｒ１比率が６パーセントを下回ること。

ｃ　単体又は連結総自己資本比率が８パーセントを下回ること。

（３）　国内基準行等である場合

国内基準に係る単体又は連結自己資本比率が４パーセントを下回ること。

（４）　保険会社である登録金融機関である場合

単体又は連結ソルベンシー・マージン比率が４００パーセントを下回ること。

（５）　前各号のいずれにも該当しない場合

前各号に準じる場合に該当していること。

７　当社は、清算参加者が第１９条第１号に掲げる事項について当社へ届出を行った場合又は同条第２号から第５号までのいずれかに掲げる事項（同条第４号にあっては事業の全部の承継、第５号にあっては事業の全部の譲渡に限る。）に係る公告を行った場合において、金利スワップ清算資格の喪失申請を行わないときは、当該清算参加者を審問のうえ、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引について新たな債務負担の全部又は一部の停止の措置を行うことができる。

（リスク量が大きい場合における当初証拠金所要額の引上げ）

第２９条　清算参加者は、金利スワップ取引の状況、自己及び清算委託者の信用力その他の事情に照らして、当社又は他の清算参加者に損失を生じさせることとならないよう、自己を当事者とする清算約定に係るポジションを適正に維持するよう努めるものとする。

２　当社は、清算参加者の自己取引口座又は委託取引口座ごとのリスク量（当社が定めるリスク量をいう。）が、当社が定める水準を上回る場合には、当該清算参加者に対し、当社が定めるところにより当初証拠金所要額の引上げ措置を行うことができる。

（個別の取引口座に係るリスクの制限）

第２９条の２　当社は、清算参加者の自己取引口座又は委託取引口座ごとの当初証拠金所要額が、当該清算参加者の自己資本額（清算参加者が親会社等保証を受けている場合には、親会社等保証を行っている親会社等の自己資本額（当該親会社等が金融商品取引業者又は登録金融機関でない場合には、これに相当する額）。以下本条及び次条において同じ。）の５０パーセントを超えた場合には、当該清算参加者に対し、当社が定めるところにより当初証拠金所要額の引上げ措置を行うことができる。

２　当社は、清算参加者の自己取引口座又は委託取引口座ごとの当初証拠金所要額が、当該清算参加者の自己資本額の１００パーセントを超えた場合には、当該清算参加者を審問のうえ、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引のうち当該超過した口座に係るものについて新たな債務負担の全部又は一部の停止の措置を行うとともに、取締役会の決議による当該口座を対象としたポジション保有状況の改善指示の措置を行うことができる。

３　前項に規定するポジション保有状況の改善指示を受けた清算参加者は、当社がその都度指定す

る日までに、ポジション保有状況を改善することを目的として、資本充実その他具体的な措置（クロスマージン対象国債先物清算約定及びクロスマージン対象金利先物清算約定に係る措置及び清算委託者への必要な限度での措置の要請を含む。）を講じなければならない。

４　本業務方法書に定めるもののほか、ポジション保有状況の改善指示に関し必要な事項は、当社がその都度定める。

（自己資本額に応じたリスクとするための措置）

第２９条の３　当社は、次の各号に掲げる口座に係る当初証拠金所要額の合計額が、当該各号に定める基準を超えた場合には、当該清算参加者を審問のうえ、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引について新たな債務負担の全部又は一部の停止の措置を行うとともに、取締役会の決議によるポジション保有状況の改善指示の措置を行うことができる。

（１）　清算参加者の自己取引口座及び委託取引口座（当該清算参加者と同一の企業集団に含まれる清算委託者のために設定されたものに限る。）に係る当初証拠金所要額の合計額

当該清算参加者の自己資本額の２００パーセント

（２）　清算参加者の自己取引口座及びすべての委託取引口座に係る当初証拠金所要額の合計額

当該清算参加者の自己資本額の４００パーセント

２　前条第３項及び第４項の規定は、前項に規定するポジション保有状況の改善指示の措置を行った場合について準用する。

（ポジション保有状況の改善指示）

第３０条　当社は、清算参加者の当社に対する債務履行の確実性に係る危険を速やかに解消する必要があると認められる場合には、その必要な限度において、当該清算参加者を審問のうえ、当該清算参加者を当事者とする清算対象取引について新たな債務負担の全部若しくは一部の停止の措置又は取締役会の決議によるポジション保有状況の改善指示の措置を行うことができる。

２　前項に規定するポジション保有状況の改善指示を受けた清算参加者は、当社がその都度指定する日までに、当該指示を受けた事由を解消することを目的として、必要な措置（クロスマージン対象国債先物清算約定及びクロスマージン対象金利先物清算約定に係る措置を含む。）を講じなければならない。

３　本業務方法書に定めるもののほか、ポジション保有状況の改善指示に関し必要な事項は、当社がその都度定める。

（代用有価証券に係る措置）

第３１条　当社は、清算参加者の信用状況に鑑みて、当該清算参加者が当事者である清算約定又は清算委託取引に係る債務及び当社が当該清算参加者の破綻等を認定した場合に当該清算参加者に係るクロスマージン対象国債先物清算約定及びクロスマージン対象金利先物清算約定に関して発生する債務の履行確保の観点から当社が必要と認める場合には、その必要な限度において、代用有価証券の代用価格の計算における時価に乗ずべき率の引下げ措置を行うことができる。

（信用状況に応じた清算参加者に対する当初証拠金の割増措置）

第３２条　当社は、次の各号に掲げる場合に応じて、清算参加者が当該各号のいずれかの事由に該当することとなったと認める場合には、当該清算参加者に対し、当社の定めるところにより清算約定（自己分）に係る当初証拠金所要額の引上げの措置を行うことができる。

（１）　当該清算参加者が親会社等保証を受けていない場合

ａ　当該清算参加者が金融商品取引業者である場合にあっては、その自己資本規制比率（特別金融商品取引業者である場合については自己資本規制比率及び連結自己資本規制比率。以下本条において同じ。）及びその信用状況のいずれもが当社の定める水準を下回ったとき。

ｂ　当該清算参加者が保険会社以外の登録金融機関である場合にあっては、その単体又は連結自己資本比率及びその信用状況のいずれもが当社の定める水準を下回ったとき。

ｃ　当該清算参加者が保険会社である登録金融機関である場合にあっては、その単体又は連結ソルベンシー・マージン比率及びその信用状況のいずれもが当社の定める水準を下回ったとき。

ｄ　当該清算参加者のその信用力が十分でないと当社が通知又は公示により定める場合に該当するとき。

（２）　当該清算参加者がその親会社等から親会社等保証を受けている場合

ａ　当該清算参加者が金融商品取引業者である場合にあっては、その自己資本規制比率が当社の定める水準を下回るとともに、当該親会社等が当社の定める事由に該当し、かつ、当該親会社等の信用状況が当社の定める水準を下回ったとき。

ｂ　当該清算参加者が保険会社以外の登録金融機関である場合にあっては、その単体又は連結自己資本比率が当社の定める水準を下回るとともに、当該親会社等が当社の定める事由に該当し、かつ、当該親会社等の信用状況が当社の定める水準を下回ったとき。

ｃ　当該清算参加者が保険会社である登録金融機関である場合にあっては、その単体又は連結ソルベンシー・マージン比率が当社の定める水準を下回るとともに、当該親会社等が当社の定める事由に該当し、かつ、当該親会社等の信用状況が当社の定める水準を下回ったとき。

ｄ　当該親会社等の信用力が十分でないと当社が通知又は公示により定める場合に該当するとき。

２　前項の規定は清算約定（委託分）に係る当初証拠金所要額について準用する。この場合において、当初証拠金所要額の引上げの措置は、清算委託者がバックアップ受託者を指定しているとき（清算委託者がクロスマージン利用者である場合には、当該清算委託者がバックアップ受託者及び国債先物等バックアップ受託者を指定しているとき）には、当該清算委託者の清算約定（委託分）に係る当初証拠金について、対象としないこととする。ただし、当該バックアップ受託者（清算委託者が複数のバックアップ受託者を指定しているときには、当該バックアップ受託者のすべて）が前項の規定による当初証拠金所要額の引上げの措置を受けている場合は、この限りでない。

（清算参加者の破綻等を認定した場合の措置）

第３３条　当社は、清算参加者が次に掲げるいずれかの事由に該当することとなった場合には、当該清算参加者の金利スワップ清算資格の取消しの措置を行うことができる。

（１）　当社が破綻等を認定した場合

（２）　金融商品取引業者及び登録金融機関のいずれにも該当しないこととなった場合

（債務負担の停止等の措置の解除）

第３４条　当社が第２８条の規定により期間を定めないで新たな債務負担の停止措置又はクロスマージンの停止の措置を行った場合において、当該停止措置の原因となった事由が除去されたときは、当該停止措置を受けた清算参加者は、当社に対して、当社所定の説明のための書面を添付して当該停止措置の解除を申請することができる。

２　当社は、当社の金利スワップ取引清算業務の適切な遂行を確保する観点から前項の申請に基づく停止措置の解除が適当であると認めるときは、その申請を承認する。

３　第１項の清算参加者が、同項の債務負担の停止措置を受けた日から６か月以内に前項の承認を受けられない場合には、当社は、取締役会の決議により、当該清算参加者の金利スワップ清算資格を取り消すことができる。

４　第１項及び第２項の規定は、当社が第２９条から第３０条まで及び第３２条に規定する措置を行った場合について準用する。

（異議の申立て等）

第３５条　第１５条第１項ただし書、第２項及び第３項の規定は第２８条及び第２９条の２から第３０条までに規定する審問について、第１５条第４項から第６項までの規定は第２８条から第３２条までの措置について、それぞれ準用する。

（措置評価委員会）

第３６条　当社は、第２８条、第２９条の２第２項及び第２９条の３から第３１条までに規定する措置を清算参加者に対し行おうとするときは、あらかじめ、当該措置を行うことの適否につき、措置評価委員会に諮問し、その意見を尊重するものとする。

２　前項の規定にかかわらず、当社は、緊急の必要があるときは、措置評価委員会に諮問しないことができる。

３　前２項に定めるもののほか、措置評価委員会に関する事項は当社が規則で定める。

（措置の通知等）

第３７条　当社は、本業務方法書に基づき新たな債務負担の全部若しくは一部の停止を行おうとする場合、クロスマージンの停止を行おうとする場合、金利スワップ清算資格を取り消そうとする場合又はクライアント・クリアリングの取扱いの承認を取り消そうとする場合には、これらの措置を受ける清算参加者に対し、あらかじめその旨を通知する。

２　当社が受託清算参加者に対して新たな債務負担の全部若しくは一部の停止措置を行った場合、

クロスマージンの停止を行った場合、受託清算参加者の金利スワップ清算資格を取り消した場合又はクライアント・クリアリングの取扱いの承認を取り消した場合には、当該受託清算参加者は、清算受託契約を締結している清算委託者に対し、直ちにその旨を通知しなければならない。

３　清算参加者は、当社からクロスマージンの停止の措置を受けた場合には、当該清算参加者が第８４条の２の規定によりクロスマージン申請者として当社に届け出た国債先物等清算参加者に対し、直ちにその旨を通知しなければならない。

４　当社は、本業務方法書に基づき改善指示、新たな債務負担の全部若しくは一部の停止、クロスマージンの停止、金利スワップ清算資格の取消し、ポジション保有状況の改善指示の措置又はクライアント・クリアリングの取扱いの承認の取消しの措置を清算参加者に対して行った場合には、当該措置を行った日以後速やかに、他の清算参加者に対してその旨を通知し、かつ公表するものとする。ただし、当社は、当該通知及び公表を行った場合における市場への影響度その他の事由を勘案して必要かつ適当と認めるときは、当社が適当と認める日に通知及び公表を行うことができる。

５　当社は、前項に規定する通知及び公表を行う場合には、当該通知及び公表の対象となる措置の重要性又は当該通知及び公表を行った場合における市場への影響度その他の事由を勘案して、通知及び公表を行う範囲をその都度定めるものとする。

（金利スワップ清算資格を喪失した場合における清算約定の取扱い）

第３８条　清算参加者は、金利スワップ清算資格を取り消された場合（第３３条第１号に掲げる事由に該当し取り消された場合を除く。）には、当社がその都度定める期間内に、当該清算参加者の清算約定で未決済のもののすべてを解消しなければならない。

２　前項の場合において、同項の清算参加者が同項に規定する期間内に清算約定で未決済のもののすべてを解消することができないときは、当該清算約定は、第９章第２節の規定（第９６条から第９８条までの規定を除く。）に準じて処理されるものとする。この場合において、必要な事項は当社がその都度定める。

（清算参加者に対する勧告）

第３９条　当社は、清算参加者の業務又は財産の状況が、当社の金利スワップ取引清算業務に及ぼし得る影響の程度その他の事情を勘案し、金利スワップ取引清算業務の適正かつ確実な遂行の観点から適当でないと認める場合には、当該清算参加者に対し、適切な措置を講ずることを勧告することができる。

２　当社は、前項の勧告を行った場合には、当該清算参加者に対し、その対応について報告を求めることができる。

第７節　雑則

（会社分割又は事業譲渡による清算参加者から清算参加者に対する未決済約定の引継ぎ）

第４０条　他の清算参加者に分割により事業を承継させ、又は事業を譲渡する清算参加者（以下本条において「分割等参加者」という。）は、当該事業の承継又は譲渡と同時に金利スワップ清算資格を喪失しない場合は、当社の承認を受けて、当該他の清算参加者（以下本条において「承継等参加者」という。）に、当該事業の承継又は譲渡に係る未決済の清算約定（以下本条において「引継清算約定」という。）を引き継がせることができる。

２　前項の規定により事業を譲渡する場合において、引継清算約定が清算約定（委託分）であるときは、分割等参加者は、引継清算約定の引継ぎについて、引継清算約定に関し当該分割等参加者に有価証券等清算取次ぎの委託を行った清算委託者の同意を得るものとする。

３　本条に基づく引継清算約定の引継ぎに要する費用は、分割等参加者又は承継等参加者の負担とする。

（合併、会社分割又は事業譲渡による清算参加者から清算委託者に対する未決済約定の引継ぎ）

第４０条の２　清算委託者に合併され、分割により事業を承継させ、又は事業を譲渡する清算参加者（以下本条において「合併等参加者」という。）は、当社の承認を受けて、当該清算委託者（以下本条において「承継等委託者」という。）に、当該合併、事業の承継又は譲渡に係る未決済の清算約定（清算約定（自己分）に限る。以下本条において「引継清算約定」という。）を引き継がせることができる。この場合において、引継清算約定は、承継等委託者及び承継等委託者の受託清算参加者の間の清算委託取引、並びに当該受託清算参加者及び当社の間の清算委託取引に係る清算約定（委託分）とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。

２　前項の場合において、承継等委託者は、引継清算約定の引継ぎについて、あらかじめ同項の受託清算参加者の同意を得るものとする。

３　当社は、承継等委託者が前項に規定する同意を得られる見込みがないと判断した場合には、第１項の規定にかかわらず、引継清算約定の解消その他の必要と認める整理を、合併等参加者及び承継等委託者をして行わせることができる。

４　本条に基づく引継清算約定の引継ぎに要する費用は、合併等参加者又は承継等委託者の負担とする。

（合併、会社分割又は事業譲渡による清算委託者から清算参加者に対する清算委託取引の引継ぎ）

第４０条の３　清算参加者に合併され、分割により事業を承継させ、又は事業を譲渡する清算委託者（以下本条において「合併等委託者」という。）は、当社の承認を受けて、当該清算参加者（以下本条において「承継等参加者」という。）に、当該合併、事業の承継又は譲渡に係る未決済の清算委託取引（以下本条において「引継清算委託取引」という。）を引き継がせることができる。この場合において、引継清算委託取引は、承継等参加者と当社の間の清算約定（自己分）とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。

２　前項の規定により引継清算委託取引の引継ぎが行われた場合には、合併等委託者の受託清算参加者及び当社の間の引継清算委託取引に係る清算約定（委託分）は当然に終了するものとする。

３　第１項の場合において、合併等委託者は、引継清算委託取引の引継ぎについて、あらかじめ前

項の受託清算参加者の同意を得るものとする。

４　当社は、合併等委託者が前項に規定する同意を得られる見込みがないと判断した場合には、第１項及び第２項の規定にかかわらず、引継清算委託取引の解消その他の必要と認める整理を、合併等委託者及び承継等参加者をして行わせることができる。

５　本条に基づく引継清算委託取引の引継ぎに要する費用は、合併等委託者又は承継等参加者の負担とする。

（合併、会社分割又は事業譲渡による清算委託者から清算委託者に対する清算委託取引の引継ぎ）

第４０条の４　他の清算委託者に合併され、分割により事業を承継させ、又は事業を譲渡する清算委託者（以下本条において「合併等委託者」という。）は、当社の承認を受けて、当該他の清算委託者（以下本条において「承継等委託者」という。）に、当該合併、事業の承継又は譲渡に係る未決済の清算委託取引（以下本条において「引継清算委託取引」という。）を引き継がせることができる。この場合において、引継清算委託取引は、承継等委託者及び当該承継等委託者の受託清算参加者の間の清算委託取引、並びに当該受託清算参加者及び当社の間の当該清算委託取引に係る清算約定（委託分）とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。

２　前項の規定により引継清算委託取引の引継ぎが行われた場合には、合併等委託者の受託清算参加者及び当社の間の引継清算委託取引に係る清算約定（委託分）は当然に終了するものとする。

３　第１項の場合において、合併等委託者及び承継等委託者は、引継清算委託取引の引継ぎについて、あらかじめそれぞれの受託清算参加者の同意を得るものとする。

４　当社は、合併等委託者又は承継等委託者が前項に規定する同意を得られる見込みがないと判断した場合には、第１項及び第２項の規定にかかわらず、引継清算委託取引の解消その他の必要と認める整理を、合併等委託者及び承継等委託者をして行わせることができる。

５　本条に基づく引継清算委託取引の引継ぎに要する費用は、合併等委託者又は承継等委託者の負担とする。

（登録金融機関の登録を受けた支店を有する外国法人の取扱い）

第４１条　金融商品取引法第３３条の２の登録を受けた支店を有する外国法人は、これを登録金融機関とみなして本章の規定を適用する。

第３章　有価証券等清算取次ぎ

（有価証券等清算取次ぎの対象取引）

第４２条　清算参加者が行うことができる有価証券等清算取次ぎの対象取引は、適格金利スワップ取引とする。

（清算受託契約の締結）

第４３条　清算参加者は、有価証券等清算取次ぎをする場合、あらかじめ、清算委託者との間で清

算受託契約を締結しなければならない。

２　清算委託者は、清算参加者に対して有価証券等清算取次ぎの委託をする場合、あらかじめ、当該清算参加者との間で清算受託契約を締結し、かつ、当該清算受託契約及び本業務方法書等に従う旨の当社が定める様式による誓約書を、清算参加者を経由して当社に提出しなければならない。

３　前項の場合において、清算委託者から誓約書の交付を受けた受託清算参加者は、直ちに、当該誓約書を当社に差し入れるものとする。

（清算受託契約の締結の届出）

第４４条　清算参加者は、清算受託契約を締結しようとする場合には、あらかじめ、当社が定めるところにより、その内容を当社に届け出なければならない。

２　当社は、清算参加者から前項の規定による届出を受けた場合（当該届出に係る清算受託契約の締結に係る清算委託者について、他の清算参加者から既に同項の規定による届出を受けている場合を除く。）には、当該届出に基づき、他の清算参加者に当該清算委託者の商号その他の事項を通知し、かつ公表する。

（清算受託契約の解約の届出）

第４５条　受託清算参加者は、清算受託契約が解約される場合には、次の各号に掲げる解約の区分に従い、当該各号に定めるところ及び当社の定めるところにより、その内容を当社に届け出なければならない。

（１）　合意による解約

受託清算参加者は、当該解約を行おうとする日の３当社営業日前の日までに届出を行う。

（２）　受託清算参加者が事前に清算委託者に対し書面により契約の解約の意思を申し出ることによる解約（第４号に掲げる解約を除く。）

受託清算参加者は、当該解約の意思を申し出た後遅滞なく届出を行う。

（３）　受託清算参加者が事前に清算委託者から書面により契約の解約の意思の申し出を受けたことによる解約

受託清算参加者は、当該解約の意思の申し出を受けた後遅滞なく届出を行う。

（４）　その他清算受託契約の規定による解約

受託清算参加者は、あらかじめ、又は清算受託契約の終了後遅滞なく届出を行う。

２　前項の規定による清算受託契約の解約までに成立した清算委託取引に関しては、引き続き清算受託契約を適用する。

３　第１項の規定による届出が当社に到達するまでの間は、清算受託契約の解約は、その効力を生じないものとする。

４　当社は、清算参加者から第１項の規定による届出を受けた場合（当該届出に係る清算受託契約の解約により、当該解約に係る清算委託者がいずれの清算参加者との間でも清算受託契約を締結していない状況になる場合に限る。）その他当社が適当と認めるときは、速やかに他の清算参加者に当該清算委託者の商号その他の事項を通知し、かつ公表する。

（バックアップ受託者の指定等）

第４５条の２　清算委託者は、当該清算委託者に対し現に有価証券等清算取次ぎを行っている受託清算参加者について破綻等が認定された場合において、当該清算委託者の計算により成立している清算約定（委託分）及び清算委託取引に係る権利義務を円滑に他の一又は二以上の受託清算参加者へ承継させる目的で、あらかじめ他の受託清算参加者（当該清算委託者に対し現に有価証券等清算取次ぎを行っている受託清算参加者（破綻等が認定された受託清算参加者を除く。）を含む。）をバックアップ受託者として指定することができる。

２　前項の指定（以下「バックアップ受託者の指定」という。）を行おうとする清算委託者及び当該バックアップ受託者の指定を受けようとする受託清算参加者は、当該清算委託者に対し現に有価証券等清算取次ぎを行っている受託清算参加者について破綻等が認定された場合に、第９４条又は第９４条の２の規定に基づき当該清算委託者の計算により成立している清算約定（委託分）及び清算委託取引の全部又は一部に対応する権利義務を一括して当該他の受託清算参加者に承継させることについて、あらかじめ合意するものとする。

３　第１項に規定するバックアップ受託者の指定に係る届出は、当該指定を行おうとする清算委託者が当該指定を受ける受託清算参加者を通じて、当社が定めるところにより当社所定の届出書に当社が必要と認める書類を添付して、当社に対して提出することで行うものとする。

４　バックアップ受託者は、清算委託者との承継に係る合意に関し、当社の定めるところにより当社に対して報告するものとする。

５　第１項の規定により指定を行った清算委託者及びバックアップ受託者は、清算委託者が現に有価証券等清算取次ぎの委託を行っている受託清算参加者について破綻等の認定が行われた場合に、清算委託者とバックアップ受託者が合意するところに従い、円滑に清算約定（委託分）及び清算委託取引を承継させることが可能となるよう、当社の定めるところにより事前の体制整備に努めるものとする。

６　バックアップ受託者の指定を取り消そうとするバックアップ受託者は、当該指定の取消しについて当該指定を行った清算委託者と合意のうえ、当社所定の申請書を当社に対して届け出るものとする。

（国債先物等バックアップ受託者の指定等）

第４５条の３　クロスマージン利用者のうち第２条第１項第１３号の９ｂからｄまでに掲げる者は、第８４条の５第１項の規定により債権債務が成立した場合において、国債先物清算約定等に係る権利義務及び金利先物清算約定等に係る権利義務につき円滑に他の一又は二以上の国債先物等清算参加者に国債先物等承継を行う目的で、あらかじめ他の国債先物等清算参加者を国債先物等バックアップ受託者として指定することができる。

２　前項の指定（以下「国債先物等バックアップ受託者の指定」という。）を行おうとする場合には、クロスマージン利用者（当該クロスマージン利用者が国債証券先物取引又は金利先物取引を国債先物等非清算参加者に委託している場合には、当該国債先物等非清算参加者を含む。以下第

４項から第６項までにおいて同じ。）及び当該国債先物等バックアップ受託者の指定を受けようとする国債先物等清算参加者は、第８４条の５第１項の規定により債権債務が成立した場合に、第９４条の３の規定に基づき当該国債先物清算約定等に係る権利義務及び金利先物清算約定等に係る権利義務の全部又は一部につき一括して当該他の国債先物等清算参加者に国債先物等承継を行うことについて、あらかじめ合意するものとする。

３　第１項に規定する国債先物等バックアップ受託者の指定に係る届出は、当該指定を行おうとするクロスマージン利用者がクロスマージン承諾者を通じて、当社所定の届出書に当社が必要と認める書類を添付して、当社に対して提出することで行うものとする。

４　国債先物等バックアップ受託者は、クロスマージン利用者との国債先物等承継に係る合意に関し、クロスマージン承諾者を通じて、当社の定めるところにより当社に対して報告するものとする。

５　第１項の規定により指定を行った場合には、クロスマージン利用者及び国債先物等バックアップ受託者は、第８４条の５第１項の規定により債権債務が成立した場合に、クロスマージン利用者と国債先物等バックアップ受託者が合意するところに従い、円滑に国債先物清算約定等に係る権利義務及び金利先物清算約定等に係る権利義務につき国債先物等承継を行うことが可能となるよう、当社の定めるところにより事前の体制整備に努めるものとする。

６　国債先物等バックアップ受託者の指定を取り消そうとする国債先物等バックアップ受託者は、当該指定の取消しについて当該指定を行ったクロスマージン利用者と合意のうえ、クロスマージン承諾者を通じて、当社所定の申請書を当社に対して届け出るものとする。

（誓約書の効力）

第４６条　清算委託者により当社に提出された誓約書は、清算委託者と受託清算参加者との間の清算受託契約が解約された時点でその効力を失う。

２　前項の規定による誓約書の失効までに成立した清算約定（委託分）及び清算委託取引並びに当初証拠金に関して、当社と清算委託者又は受託清算参加者との間に権利義務が残存している場合には、当該権利義務に関する限度で、なお引き続き誓約書の効力が存続するものとする。

（清算約定の区分管理）

第４７条　受託清算参加者は、自己を当事者とする清算約定を、清算約定（自己分）及び清算約定（委託分）に区分して管理しなければならない。

２　受託清算参加者は、清算約定（委託分）を、清算取次口座ごとに区分して管理しなければならない。

第４章　債務負担及び清算約定

第１節　債務負担

（債務負担等の申込み）

第４８条　清算参加者は、当社に対して、当社が定める方法で通知することにより、債務負担の申込みをすることができる。当社は、当該通知を、当社が定めるところにより受領する。

２　前項の規定による債務負担の申込みは、債務負担の対象となる適格金利スワップ取引の当事者双方がしなければならない。

３　第１項の債務負担の申込みに係る通知は、次条第１項の規定により当該申込みに係る適格金利スワップ取引について清算約定が成立することを停止条件として、第５０条の規定に従って当該適格金利スワップ取引を合意解約する旨の当該適格金利スワップ取引の相手方当事者である清算参加者に対する意思表示とみなす。

４　清算参加者が清算取次原取引の相手方である場合において行う第１項の債務負担の申込みに係る通知は、第５４条第４項各号（第５４条の２第１項において準用する場合を含む。）に掲げる条件を満たすことを停止条件として、当該清算取次原取引を合意解約する旨の当該清算取次原取引の当事者である清算委託者に対する意思表示とみなす。

５　清算参加者は、第１項の債務負担の申込みの意思表示及び前２項の合意解約の意思表示について、そのすべての意思表示について行う場合にのみ、撤回することができる。

（債務負担による清算約定の成立）

第４９条　当社は、適格金利スワップ取引の両当事者である清算参加者から前条第１項の申込みに係る通知を受領した場合には、その内容及び当該適格金利スワップ取引が当社の定める条件を満たすこと並びに当該清算参加者が当社の定める方法により算出する証拠金（以下「債務負担時所要証拠金」という。）を当社に預託又は交付していること（以下これらの事項を「債務負担要件」という。）を当社が定めるところにより確認し、当社が債務負担要件の充足を確認することができた場合には、当社が定める時点をもって、債務負担の対象となった適格金利スワップ取引の一方の当事者であった清算参加者（以下本条において「清算参加者Ｘ」という。）と当社の間に、当社の取引ポジションを当該適格金利スワップ取引において清算参加者Ｘの相手方当事者であった清算参加者（以下本条において「清算参加者Ｙ」という。）と同一とする金利スワップ取引が成立し、清算参加者Ｙと当社の間に、当社の取引ポジションを清算参加者Ｘと同一とする金利スワップ取引が成立するものとする。ただし、債務負担要件のうち、債務負担時所要証拠金に足りる額が当社に預託又は交付されていない場合であっても、前条第１項の債務負担の申込みに係る通知を当社が受領した時点で、次の各号に掲げる基準を満たすときには、本項が規定する金利スワップ取引が成立するものとする。

（１）　当該申込みに係る適格金利スワップ取引の想定元本が、当社が定める金額未満であること。

（２）　次のａ又はｂに掲げる区分に応じて、当該ａ又はｂに定める基準を満たすこと。

ａ　当該申込みに係る自己取引口座

当該申込みをした清算参加者の自己取引口座に係る債務負担時所要証拠金不足額が、当社が定める上限額（次のｂに定める配賦がなされた場合には、配賦に伴う減少後の額。以下「債

務負担時所要証拠金不足許容上限額」という。）以下であること。

ｂ　当該申込みに係る委託取引口座

受託清算参加者が自己取引口座に係る債務負担時所要証拠金不足許容上限額から当該申込みに係る委託取引口座に配賦（受託清算参加者が当社が定める方法で申告することにより、当該受託清算参加者の自己取引口座に係る債務負担時所要証拠金不足許容上限額を、当該委託取引口座に配賦することをいう。）を行った場合であって、当該委託取引口座に係る債務負担時所要証拠金不足額（第８４条の７第１項の規定により、当該委託取引口座にカスタマーバッファーを充当可能な場合は、当該充当後の債務負担時所要証拠金不足額）が当該配賦を受けた上限額以下であること。

（３）　清算参加者又は清算委託者の当初証拠金預託額が、当該清算参加者の自己取引口座又は当該清算委託者の委託取引口座に係る当該申込みが行われた日の前当社営業日の当初証拠金所要額又は当該申込みが行われた日の日中証拠金所要額以上であること。

（４）　当該申込みをした清算参加者が第３２条第１項の規定による信用状況に応じた当初証拠金の割増措置の適用を受けていないこと。

２　当社は、前項の規定により清算約定が成立した場合には、当該清算約定の相手方となる清算参加者にその旨を、当社の定めるところにより速やかに通知するものとする。

３　第１項の場合において、当社が債務負担の申込みに係る通知を受領した時点で債務負担の申込みを行っている両当事者の清算参加者から債務負担時所要証拠金の預託又は交付を受けていることを確認することができない場合には、当社は、当該申込みについて、債務負担を行わないものとし、その旨を当該清算参加者に対して当社の定めるところにより速やかに通知するものとする。ただし、同項ただし書に規定する基準を満たす場合は、この限りではない。

４　当社は、清算参加者の破綻等を認定した場合等において、金利スワップ取引清算業務の円滑な遂行のため特に必要があると認めるときは、前条第１項の規定にかかわらず、債務負担の申込みに係る通知を受領する時間を臨時に変更することができる。この場合において、当社は、次に掲げる事項をあらかじめ清算参加者に通知するものとする。

（１）　本項の規定により債務負担の申込みに係る通知を受領する時間を臨時に変更する旨

（２）　変更後の当社が債務負担の申込みに係る通知を受領する時間

５　清算参加者は、第１項の規定により清算約定が成立した場合には、同項の適格金利スワップ取引若しくは清算取次原取引又はそれらの債権債務について相手方当事者である清算参加者又は清算委託者に対抗することができた事由（当該適格金利スワップ取引の存否、意思表示の瑕疵又は欠缺その他一切の事由を含む。）があったとしても、これをもって当社に対して一切対抗することができない。

６　第１項の規定により成立する清算約定は、清算約定（担保型）として成立するものとする。

（適格金利スワップ取引の合意解約）

第５０条　債務負担の対象取引である適格金利スワップ取引及び当該適格金利スワップ取引に基づく債権債務（次に掲げるものを除く。）は、第４８条第３項の規定その他本業務方法書の定め

るところにより当該適格金利スワップ取引の当事者である清算参加者間で合意解約が成立したことによって、清算約定の成立と同時に将来に向かって消滅する。

（１）　当該清算約定の成立時に弁済期が到来している固定金額及び変動金額の支払債務

（２）　前号に掲げるもののほか、当該清算約定の成立時に既に発生している債務であって、当社が定めるもの

２　清算参加者は、前項各号に掲げるものを除き、同項の合意解約について、手数料、損害賠償金その他の金員を支払う義務を負わない。

３　第１項の適格金利スワップ取引の当事者である清算参加者間の合意が同項の規定に矛盾し、又は抵触する場合には、同項の規定が優先する。

第２節　清算約定

（清算約定の内容）

第５１条　清算約定は、本業務方法書等、ＩＳＤＡ基本契約及びＩＳＤＡ定義集の適用を受けるものとし、清算参加者間で締結された２００２　ＩＳＤＡ　Ｍａｓｔｅｒ　Ａｇｒｅｅｍｅｎｔ（Ｓｃｈｅｄｕｌｅを含む。）その他の店頭デリバティブ取引に関する基本的事項を定めた基本契約（当社が定めるものに限る。）その他本業務方法書等に定めのない清算参加者間の合意（適格金利スワップ取引の当事者であった清算参加者間で締結されたコンファメーションを含むが、これに限られない。）は、清算約定には一切適用されないものとする。

２　清算約定の内容については、第４９条第１項及び前項に規定するほか、当社が定めるところによる。

３　第１項の規定により清算約定に対してＩＳＤＡ基本契約及びＩＳＤＡ定義集を適用するにあたり必要な読替えその他の事項は、当社が定める。

４　ＩＳＤＡ基本契約又はＩＳＤＡ定義集の規定が本業務方法書等の規定に矛盾し、又は抵触する場合には、本業務方法書等の規定が優先する。

（損益差金等の授受の申込み）

第５１条の２　清算参加者は、清算約定（担保型）について、損益差金等の授受を行おうとする場合には、当社に対し、当社が定める方法によりその旨の申込み（以下「損益差金等の授受の申込み」という。）をするものとする。

２　当社は、前項の規定により清算参加者から自己取引口座又は同一の委託取引口座に記録されている複数の清算約定（担保型）について損益差金等の授受の申込みを受けた場合において、当該清算約定（担保型）が当社の定める条件（以下「資金決済化要件」という。）を満たすことを当社が定めるところにより確認するものとし、当該清算約定（担保型）が資金決済化要件を満たしているときは、当社が当該確認を行った時点をもって、当該清算約定（担保型）は清算約定（決済型）として取り扱われ、以後、変動証拠金の授受が行われないものとする。

３　前項の規定により資金決済化要件を満たすことが確認された場合には、当社及び清算参加者か

ら別段の意思表示を要することなく、当然に、当社が定めるところにより、当該清算約定（担保型）に係る変動証拠金、変動証拠金の返還債務及び損益差金の支払債務について差引計算を行うものとする。

４　清算参加者は、第１項の規定による損益差金等の授受の申込みについて、第２項の規定による当社の確認を行うまでの間において、当社が定める方法により、損益差金等の授受の申込みを撤回することができる。

５　前各項に規定するほか、損益差金等の授受にあたり必要な事項は、当社が定める。

（期限前終了手数料）

第５２条　当社又は清算参加者は、清算約定が期限前終了した場合には、本業務方法書等の定めるところにより期限前終了手数料を支払う義務を負うものとする。

（清算約定の取引毎コンプレッション）

第５３条　清算参加者は、清算約定について取引毎コンプレッションを行おうとする場合には、当社に対し、当社が定める方法によりその旨の申込みをするものとする。

２　当社は、前項の規定により清算参加者から自己取引口座又は同一の委託取引口座に記録されている複数の清算約定について取引毎コンプレッションの申込みを受けた場合において、当該清算約定及び取引毎コンプレッションにより新たに成立する清算約定が当社の定める条件（以下「取引毎コンプレッション要件」という。）を満たすことを当社が定めるところにより確認するものとし、当該清算約定及び取引毎コンプレッションにより新たに成立する清算約定が取引毎コンプレッション要件を満たしているときは、当社が当該確認を行った時点をもって、当社及び当該清算参加者は、当該清算約定を終了させ、当該取引毎コンプレッションの申込みの内容に従い、当社が定めるところにより当該清算約定と当社が定める経済条件を同一とする新たな清算約定を、清算約定（担保型）として成立させる。

３　前項の規定により終了した清算約定に基づく債権債務（当社が定めるものを除く。）は、将来に向かって消滅する。

４　当社は、第２項に規定する取引毎コンプレッション要件の確認を行った時点で、取引毎コンプレッション要件を満たしていない取引毎コンプレッションの申込みについては、取引毎コンプレッションを行わないものとする。

５　清算参加者は、第１項の規定による取引毎コンプレッションの申込みについて、当社が定める方法により、取引毎コンプレッションの申込みを撤回することができる。

６　当社は、清算参加者から第１項の規定による取引毎コンプレッションの申込みを受けた清算約定について、第５３条の２第１項の規定によりクーポン・ブレンディングの申込みを受けた場合には、当該清算約定が記録されている自己取引口座又は同一の委託取引口座に記録されているすべての清算約定に係る取引毎コンプレッションの申込みはすべて撤回されたものとみなす。

７　前各項に規定するほか、清算約定の取引毎コンプレッションに必要な事項は、当社が定める。

（清算約定のクーポン・ブレンディング）

第５３条の２　清算参加者は、清算約定についてクーポン・ブレンディングを行おうとする場合には、当社に対し、当社が定める方法によりその旨の申込みをするものとする。

２　当社は、前項の規定により清算参加者から自己取引口座又は同一の委託取引口座に記録されている複数の清算約定についてクーポン・ブレンディングの申込みを受けた場合において、当該清算約定及びクーポン・ブレンディングにより新たに成立する清算約定が当社の定める条件（以下「クーポン・ブレンディング要件」という。）を満たすことを当社が定めるところにより確認するものとし、当該清算約定及びクーポン・ブレンディングにより新たに成立する清算約定がクーポン・ブレンディング要件を満たしているときは、当社が当該確認を行った時点をもって、当社及び当該清算参加者は、当該清算約定を終了させ、当該クーポン・ブレンディングの申込みの内容に従い、当社が定めるところにより当該清算約定と当社が定める経済条件を同一とする新たな清算約定を、清算約定（担保型）として成立させる。

３　前項の規定により終了した清算約定に基づく債権債務（当社が定めるものを除く。）は、将来に向かって消滅する。

４　当社は、第２項に規定するクーポン・ブレンディング要件の確認を行った時点で、クーポン・ブレンディング要件を満たしていないクーポン・ブレンディングの申込みについては、クーポン・ブレンディングを行わないものとする。

５　清算参加者は、第１項の規定によるクーポン・ブレンディングの申込みについて、当社が定める方法により、クーポン・ブレンディングの申込みを撤回することができる。

６　当社は、清算参加者から第１項の規定によるクーポン・ブレンディングの申込みを受けた清算約定について、第５３条第１項の規定により取引毎コンプレッションの申込みを受けた場合には、当該清算約定が記録されている自己取引口座又は同一の委託取引口座に記録されているすべての清算約定に係るクーポン・ブレンディングの申込みはすべて撤回されたものとみなす。

７　前各項に規定するほか、清算約定のクーポン・ブレンディングに必要な事項は、当社が定める。

（清算約定の一括コンプレッション）

第５３条の２の２　清算参加者は、清算約定について一括コンプレッションを行おうとする場合には、当社に対し、当社が定める方法によりその旨の申込みをするものとする。

２　当社は、前項の規定により清算参加者から清算約定の一括コンプレッションの申込みを受けた場合において、当該清算約定及び一括コンプレッションにより新たに成立する清算約定が当社の定める条件を満たすこと並びにすべての清算参加者が一括コンプレッションが成立したと仮定して算出する日中証拠金所要額について当社に預託又は交付していること（以下これらの事項を「一括コンプレッション成立要件」という。）を当社が定めるところにより確認するものとし、一括コンプレッション成立要件を満たしているときは、当社が当該確認を行った時点をもって、当社及び当該清算参加者は、当該清算約定を終了させ、当該一括コンプレッションの申込みの内容に従い新たな清算約定を、清算約定（担保型）として成立させる。

３　前項の規定により終了した清算約定に基づく債権債務（当社が定めるものを除く。）は、 将来

に向かって消滅する。

４　当社が、当社が定める時点で第２項に規定する一括コンプレッション成立要件の充足を確認することができない場合には、その時点におけるすべての一括コンプレッションの申込みについて、一括コンプレッションを行わないものとする。

５　第４８条第１項の規定にかかわらず、当社は、一括コンプレッションの申込みが行われる日の当社が定める時間において、債務負担の申込みに係る通知を受領しない。

６　第２項の規定により終了した清算約定に係る当事者は、当社が定めるところにより当社との間で解約手数料として金銭を授受するものとする。

７　前各項に規定するほか、清算約定の一括コンプレッションに必要な事項は、当社が定める。

（清算約定の参加者提案型コンプレッション）

第５３条の２の３　清算参加者は、清算約定について参加者提案型コンプレッションを行おうとする場合には、当社に対し、当社が定める方法によりその旨の申込みをするものとする。この場合において、複数の清算参加者が共同して参加者提案型コンプレッションの申込みを行おうとするときは、うち一の清算参加者を代表者として指定するものとし、当該一の清算参加者が、当社に対し、他の清算参加者（以下「共同清算参加者」という。）を代理して、参加者提案型コンプレッションの申込みをするものとする。

２　当社は、前項の規定により参加者提案型コンプレッションの申込みを受けた場合において、当該申込みに係る清算約定及び当該参加者提案型コンプレッションにより新たに成立する清算約定が当社の定める条件を満たすこと並びに当該清算参加者（共同清算参加者を含む。以下本項において同じ。）が参加者提案型コンプレッションが成立したと仮定して算出する債務負担時所要証拠金の額について当社に預託又は交付していること（以下これらの事項を「参加者提案型コンプレッション成立要件」という。）を当社が定めるところにより確認するものとし、参加者提案型コンプレッション成立要件を満たしているときは、当社及び当該清算参加者は、当該清算約定を終了させ、当該参加者提案型コンプレッションの申込みの内容に従い新たな清算約定を、清算約定（担保型）として成立させる。

３　前項の規定により終了した清算約定に基づく債権債務（当社が定めるものを除く。）は、将来に向かって消滅する。

４　当社は、第２項に規定する参加者提案型コンプレッション成立要件の充足の確認を行った時点で、参加者提案型コンプレッション成立要件を満たしていない参加者提案型コンプレッションの申込みについては、参加者提案型コンプレッションを行わないものとする。

５　第２項の規定により終了した清算約定に係る当事者は、当社が定めるところにより当社との間で解約手数料として金銭を授受するものとする。

６　前各項に規定するほか、清算約定の参加者提案型コンプレッションに必要な事項は、当社が定める。

（清算約定のＪＳＣＣ提案型コンプレッション）

第５３条の２の４　清算参加者は、清算約定についてＪＳＣＣ提案型コンプレッションを行おうとする場合には、当社が定めるところにより、あらかじめ当社にその旨の意思表示をするものとする。

２　前項に規定する意思表示を行った清算参加者は、ＪＳＣＣ提案型コンプレッションを行おうとする清算約定について、当社が定める方法により申込みを行う。

３　当社は、前項の規定によりＪＳＣＣ提案型コンプレッションの申込みを受けた場合、当該申込み内容に基づき当社が提案するコンプレッションにより終了する清算約定及び新たに成立する清算約定の内容を、当該清算約定の当事者である清算参加者に対して通知する。

４　当社は、前項に規定する提案内容について、第２項に規定するＪＳＣＣ提案型コンプレッションの申込みを行ったすべての清算参加者から当社に対して、当社の定める方法による承諾がなされた場合において、当該申込みに係る清算約定及びＪＳＣＣ提案型コンプレッションにより新たに成立する清算約定が当社の定める条件を満たすこと並びに当該清算参加者がＪＳＣＣ提案型コンプレッションが成立したと仮定して算出する債務負担時所要証拠金の額について当社に預託又は交付していること（以下これらの事項を「ＪＳＣＣ提案型コンプレッション成立要件」という。）を当社が定めるところにより確認するものとし、ＪＳＣＣ提案型コンプレッション成立要件を満たしているときは、当社が当該確認を行った時点をもって、当社及び当該清算参加者は、ＪＳＣＣ提案型コンプレッションの提案内容に従い清算約定を終了させ、新たな清算約定を、清算約定（担保型）として成立させる。

５　前項の規定により終了した清算約定に基づく債権債務（当社が定めるものを除く。）は、将来に向かって消滅する。

６　当社は、第４項に規定するＪＳＣＣ提案型コンプレッション成立要件の充足の確認を行った時点で、ＪＳＣＣ提案型コンプレッション成立要件を満たしていない場合、ＪＳＣＣ提案型コンプレッションを行わないものとする。

７　清算参加者は、第２項の規定によるＪＳＣＣ提案型コンプレッションの申込みについて、当社が定める方法により、ＪＳＣＣ提案型コンプレッションの申込みを撤回することができる。

８　第４項の規定により終了した清算約定に係る当事者は、当社が定めるところにより当社との間で解約手数料として金銭を授受するものとする。

９　前各項に規定するほか、清算約定のＪＳＣＣ提案型コンプレッションに必要な事項は、当社が定める。

（清算参加者の清算約定（自己分）の承継の申込み）

第５３条の３　清算参加者は、当該清算参加者と当社の間で成立している清算約定（自己分）の全部又は一部について、本条及び次条に規定するところにより、承継清算参加者に承継させることができる。

２　清算参加者は、前項の規定により当社に対して清算約定（自己分）の承継の申込みをする場合には、あらかじめ、承継清算参加者に対して当該承継の申込みをし、当該承継清算参加者の承諾

を得るものとする。

３　承継清算参加者は、前項に規定する清算約定（自己分）の承継の承諾をし、かつ当該清算約定（自己分）の当事者である清算参加者（以下本条及び次条において「申込清算参加者」という。）から当該承継に係る申込書の交付を受けた場合には、承継を希望する日の午後１時までに、当社に対して、当該承継申込書（申込清算参加者及び承継清算参加者が承継に合意することが記載されていることを要する。）を提出しなければならない。

（清算約定（自己分）の承継の成立）

第５３条の４　当社は、前条の規定により行われた承継の申込みを受領した場合には、承継日（第４項第１号に規定する承継日をいう。以下同じ。）の午後４時において、申込清算参加者が承継清算参加者への承継を希望する清算約定（自己分）（以下「承継申込清算約定」という。）の承継が行われたと仮定して債務負担時所要証拠金を算出するとともに、当社の定めるところにより期限前終了手数料及び承継時支払金額を算出することとし、当該時点までに、申込清算参加者及び承継清算参加者が当社に対して当該債務負担時所要証拠金の額を預託していることを確認し、承継後の当該申込清算参加者及び当該承継清算参加者のポジション保有状況に問題がないと認められるときは、当社は当該承継の申込みを承諾することとする。

２　前条第１項に規定する承継申込清算約定の承継は、前項に規定する当社が承諾を行った時点において、申込清算参加者及び当社の間の承継申込清算約定に係る権利義務（次項の規定により当該清算約定（自己分）が終了する直前のもの）と当社が定める条件が同一となる権利義務を一括して承継清算参加者に承継させることとする。

３　前２項の規定により承継申込清算約定の承継が行われた場合には、承継申込清算約定は前項に規定する権利義務の成立と同時に当然に終了するとともに、承継申込清算約定に係る債権債務は、当社が定めるものを除き、将来に向かって消滅する。

４　当社が前条の規定による承継の申込みを第１項の規定に基づき承諾した場合、次に定めるところにより前項の規定により終了した承継申込清算約定の決済及び承継が行われるものとする。

（１）　当該承諾の日（以下当社が承継の申込みを承諾する日を「承継日」という。）に、当社及び承継清算参加者の間において、第２項に定める権利義務が発生する。

（２）　前号の規定により発生する権利義務は、承継清算参加者の債務負担の申込みにより成立した承継清算参加者と当社の間の清算約定（担保型）の清算約定（自己分）に係る権利義務とみなす。

（３）　当社、承継清算参加者及び申込清算参加者は、前項の承継申込清算約定の終了及び第１号の規定による権利義務の発生に伴い、当社が定めるところにより、承継時支払金額、期限前終了手数料及び変動証拠金の授受を行う。

５　前項の規定により成立した承継清算参加者及び当社の間の権利義務については、これを承継清算参加者と当社の間の清算約定（担保型）の清算約定（自己分）とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。

第３節　有価証券等清算取次ぎに関する特則

（受託清算参加者と同一の企業集団に含まれる清算委託者が行う有価証券等清算取次ぎの委託）

第５４条　清算委託者（受託清算参加者と同一の企業集団に含まれる者に限る。以下本条において同じ。）は、受託清算参加者に対して有価証券等清算取次ぎの委託をしようとする場合には、当社が定めるところにより、有価証券等清算取次ぎの委託によって受託清算参加者を一方の当事者として成立することとなる金利スワップ取引における相手方の清算参加者（以下「指定相手方」という。）その他当社が定める事項を当社に通知するものとする。

２　受託清算参加者及び清算委託者は、前項の通知が当社に到達した場合には、その時点で、清算委託者が受託清算参加者に対し同項の金利スワップ取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託を申込み、受託清算参加者がこれを承諾したものとみなされることについてあらかじめ同意する。

３　前項の規定は、次のいずれかに該当する場合には、適用しない。

（１）　第１項の通知が次のいずれかの条件を満たさない場合

ａ　当社が、当該通知に係る清算委託者から第４３条第２項の誓約書の提出を受けており、その効力が維持されていること。

ｂ　当該通知に係る受託清算参加者が、新たな債務負担の全部又は一部の停止措置（当該通知に係る清算委託者の委託に基づき、当該清算委託者の計算で行う清算約定（委託分）をその停止の対象に含むものに限る。）を受けていないこと。

ｃ　当該通知の対象となる清算取次原取引が当社の定める要件を満たすこと。

ｄ　上記ａからｃまでに掲げるもののほか、当社が定める条件に合致すること。

（２）　有価証券等清算取次ぎの委託の制限（当社が定める制限に限る。）について受託清算参加者及び清算委託者の間に別段の合意がある場合（当該合意の内容が当社所定の方法により当社に届け出られている場合に限る。）において、第１項の通知の内容が当該合意に反するとき

４　第１項の通知は、次に掲げる条件を満たすことを停止条件として、当該通知により成立したものとみなされる有価証券等清算取次ぎの委託に係る清算取次原取引を合意解約する旨の当該清算取次原取引の相手方である清算参加者又は他の清算委託者（以下本項及び第５８条において「清算取次原取引相手方」という。）に対する意思表示とみなす。

（１）　第２項の規定により成立したものとみなされる清算委託者の受託清算参加者に対する有価証券等清算取次ぎの委託に基づき、当該受託清算参加者と清算取次原取引相手方又は清算取次原取引相手方が指定する他の清算参加者との間で、清算取次原取引と当社が定める条件を同一とする適格金利スワップ取引が成立したこと。

（２）　受託清算参加者と清算取次原取引相手方又は清算取次原取引相手方の指定する他の清算参加者が、第４８条の規定に基づき、当社に対して、前号の適格金利スワップ取引に係る債務負担の申込みを行ったこと。

（３）　前号の債務負担が効力を生じ、清算約定が成立したこと。

５　清算委託者は、第１項の有価証券等清算取次ぎの委託の意思表示及び前項の合意解約の意思表示について、その双方の意思表示について行う場合にのみ、撤回することができる。

（受託清算参加者と同一の企業集団に含まれない清算委託者が行う有価証券等清算取次ぎの委託）

第５４条の２　前条各項の規定は、受託清算参加者と同一の企業集団に含まれない清算委託者が、受託清算参加者に有価証券等清算取次ぎの委託をしようとする場合に準用する。この場合において、前条第２項中「清算委託者が受託清算参加者に対し同項の金利スワップ取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託を申込み、受託清算参加者がこれを承諾したものとみなされること」とあるのは「清算委託者が受託清算参加者に対し同項の金利スワップ取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託の申込みを行ったものとみなされること」と、前条第４項柱書中「当該通知により成立したものとみなされる有価証券等清算取次ぎの委託」とあるのは「当該通知により申込みを行ったものとみなされる有価証券等清算取次ぎの委託」と、前条第４項第１号中「第２項の規定により成立したものとみなされる清算委託者の受託清算参加者に対する有価証券等清算取次ぎの委託」とあるのは「第２項の規定により申込みを行ったものとみなされる清算委託者の受託清算参加者に対する有価証券等清算取次ぎの委託」と読み替えるものとする。

２　当社は、前項の規定により準用する前条第１項に規定する通知を受領した場合は、当該通知のうち当社が定める内容について受託清算参加者に通知する。

３　前項に規定する通知を受領した受託清算参加者は、当該通知に係る金利スワップ取引の有価証券等清算取次ぎの委託の申込みに対する諾否について、当社に対して通知することとする。

４　前２項の規定にかかわらず、受託清算参加者から当社に対して、当社が定めるところにより前２項に規定する通知の省略を希望する申告があった場合には、受託清算参加者及び清算委託者は、第１項の規定により準用する前条第１項に規定する通知を当社が受領したことをもって、第２項に規定する当社から受託清算参加者に対する通知及び第３項の規定による受託清算参加者から当社に対する承諾の通知が行われたものとみなされることについて、あらかじめ同意する。

（受託清算参加者と同一の企業集団に含まれる清算委託者が行う有価証券等清算取次ぎの委託に基づく清算約定の成立）

第５５条　第５４条第１項の通知が当社に到達した場合において、同条第２項の規定により有価証券等清算取次ぎの申込み及び承諾があったものとみなされるときは、当社が定めるところにより、当該清算委託者の計算において、当該委託を受けた受託清算参加者と指定相手方との間で清算取次原取引と当社が定める条件を同一とする金利スワップ取引が成立する。

２　前項の金利スワップ取引の両当事者となる清算参加者は、同項の規定により当該金利スワップ取引が成立した場合には、その時点で、それぞれ、第４８条の規定に従って当社に対して当該金利スワップ取引に係る債務負担の申込みに係る通知をしたものとみなされることについてあらかじめ同意する。

３　受託清算参加者は、清算約定（委託分）が成立した場合には、遅滞なく、その旨及びその内容を当該清算約定（委託分）に係る有価証券等清算取次ぎの委託をした清算委託者に通知しなければならない。

４　清算約定（委託分）は、清算委託取引の終了その他の当社が定める場合には、当社が定める時

点以降、当該清算約定（委託分）の当事者である清算参加者の自己の計算による清算約定（担保型）として取り扱われるものとする。

５　前２条の規定による清算委託者の委託を受けた受託清算参加者と指定相手方が同一法人である場合には、指定相手方としての受託清算参加者を他の清算参加者とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。

６　清算委託者及び受託清算参加者は、当該清算委託者の当該受託清算参加者に対する有価証券等清算取次ぎの委託に基づいて清算約定（委託分）が成立した場合には、清算取次原取引若しくは第１項の規定により受託清算参加者及び指定相手方の間で成立する金利スワップ取引又はこれらに係る債権債務について相手方当事者である清算参加者又は清算委託者に対抗することができた事由（金利スワップ取引の存否、意思表示の瑕疵又は欠缺その他一切の事由を含む。）があったとしても、これをもって清算委託取引の相手方である当該受託清算参加者又は当該清算委託者に対して一切対抗することができない。

（受託清算参加者と同一の企業集団に含まれない清算委託者が行う有価証券等清算取次ぎの委託に基づく清算約定の成立）

第５５条の２　前条各項の規定は、第５４条の２の規定において準用する第５４条第１項に規定する通知が当社に到達した場合に準用する。この場合において、前条第１項中「第５４条第１項の通知が当社に到達した場合において、同条第２項の規定により有価証券等清算取次ぎの申込み及び承諾があったものとみなされるとき」とあるのは「第５４条の２第３項の規定により有価証券等清算取次ぎの委託の申込みに対して承諾する旨を、当社に対して通知したとき、又は第５４条の２第４項の規定により有価証券等清算取次ぎの委託の申込みに対して承諾する旨を、当社に対して通知したものとみなされるとき」と読み替えるものとする。

（清算委託者が行う清算約定（委託分）に関する損益差金等の申込み等）

第５５条の３　清算委託者は、清算約定（担保型）の清算約定（委託分）について損益差金等の授受の申込みの指図又は損益差金等の授受の申込みの撤回の指図を行おうとする場合には、当該清算委託者とその受託清算参加者との間で定めるところにより、その旨を受託清算参加者に通知するものとする。

２　受託清算参加者は、前項に規定する通知を受領した場合には、第５１条の２第１項又は第４項の規定に従い、当該通知に係る清算約定（担保型）の清算約定（委託分）について当社に対して損益差金等の授受の申込み又は損益差金等の授受の申込みの撤回を行うものとする。

（清算約定（委託分）に係る損益の帰属等）

第５６条　清算約定（委託分）に係る損益は、すべて清算委託者に帰属する。

２　受託清算参加者は、清算約定（委託分）に関し、当社から固定金額、変動金額その他の金銭等（証拠金を除く。）を受領した場合には、当該金銭等を清算委託者に引き渡すものとする。

３　清算委託者は、清算約定（委託分）に関し、受託清算参加者が当社に対して金銭等（証拠金、

特別清算料担保金、清算手数料及び特別清算料を除く。）の支払義務を負担する場合には、当該金銭等を受託清算参加者に支払うものとする。

（清算委託者が行う清算約定（委託分）に関する取引毎コンプレッションの申込み等）

第５６条の２　清算委託者は、清算約定（委託分）について取引毎コンプレッションの申込みの指図又は取引毎コンプレッションの申込みの撤回の指図を行おうとする場合には、当該清算委託者とその受託清算参加者との間で定めるところにより、その旨を受託清算参加者に通知するものとする。

２　受託清算参加者は、前項に規定する通知を受領した場合には、第５３条第１項又は第５項の規定に従い、当該通知に係る清算約定（委託分）について当社に対して取引毎コンプレッションの申込み又は取引毎コンプレッションの申込みの撤回を行うものとする。

（清算委託者が行う清算約定（委託分）に関するクーポン・ブレンディングの申込み等）

第５６条の３　清算委託者は、清算約定（委託分）についてクーポン・ブレンディングの申込みの指図又はクーポン・ブレンディングの申込みの撤回の指図を行おうとする場合には、当該清算委託者とその受託清算参加者との間で定めるところにより、その旨を受託清算参加者に通知するものとする。

２　受託清算参加者は、前項に規定する通知を受領した場合には、第５３条の２第１項又は第５項の規定に従い、当該通知に係る清算約定（委託分）について当社に対してクーポン・ブレンディングの申込み又はクーポン・ブレンディングの申込みの撤回を行うものとする。

（受託清算参加者と同一の企業集団に含まれる清算委託者が行う清算約定（委託分）に関する一括コンプレッションの申込み）

第５７条　清算委託者（受託清算参加者と同一の企業集団に含まれる者に限る。以下、本条において同じ。）は、受託清算参加者に対して一括コンプレッションの申込みの指図をしようとする場合には、当社が定める方法により、その旨を当社に通知するものとする。

２　受託清算参加者及び清算委託者は、前項の通知が当社に到達した場合には、その時点で、清算委託者が受託清算参加者に対し一括コンプレッションの申込みの指図を行い、受託清算参加者がこれを承諾し申込みを行ったものとみなされることについてあらかじめ同意する。

（受託清算参加者と同一の企業集団に含まれない清算委託者が行う清算約定（委託分）に関する一括コンプレッションの申込み）

第５７条の２　前条各項の規定は、受託清算参加者と同一の企業集団に含まれない清算委託者が、受託清算参加者に対して、一括コンプレッションの申込みの指図を行おうとする場合に準用する。この場合において、前条第２項中「清算委託者が受託清算参加者に対し一括コンプレッションの申込みの指図を行い、受託清算参加者がこれを承諾し申込みを行ったものとみなされること」とあるのは「清算委託者が受託清算参加者に対し一括コンプレッションの申込みの指図を行ったも

のとみなされること」と読み替えるものとする。

２　当社は、前項の規定により準用する前条第１項に規定する通知を受領した場合は、当該通知のうち当社が定める内容について受託清算参加者に通知する。

３　前項に規定する通知を受領した受託清算参加者は、当該通知に係る一括コンプレッションの申込みの指図に対する諾否について、当社に対して通知することとする。

（受託清算参加者と同一の企業集団に含まれる清算委託者が行う清算約定（委託分）に関する参加者提案型コンプレッションの申込み）

第５７条の３　清算委託者（受託清算参加者と同一の企業集団に含まれる者に限る。以下、本条において同じ。）は、受託清算参加者に対して参加者提案型コンプレッションの申込みの指図をしようとする場合には、当社が定める方法により、その旨を当社に通知するものとする。

２　受託清算参加者及び清算委託者は、前項の通知が当社に到達した場合には、その時点で、清算委託者が受託清算参加者に対し参加者提案型コンプレッションの申込みの指図を行い、受託清算参加者がこれを承諾し申込みを行ったものとみなされることについてあらかじめ同意する。

（受託清算参加者と同一の企業集団に含まれない清算委託者が行う清算約定（委託分）に関する参加者提案型コンプレッションの申込み）

第５７条の４　前条各項の規定は、受託清算参加者と同一の企業集団に含まれない清算委託者が、受託清算参加者に対して、参加者提案型コンプレッションの申込みの指図を行おうとする場合に準用する。この場合において、同条第２項中「清算委託者が受託清算参加者に対し参加者提案型コンプレッションの申込みの指図を行い、受託清算参加者がこれを承諾し申込みを行ったものとみなされること」とあるのは「清算委託者が受託清算参加者に対し参加者提案型コンプレッションの申込みの指図を行ったものとみなされること」と読み替えるものとする。

２　当社は、前項の規定により準用する前条第１項に規定する通知を受領した場合は、当該通知のうち当社が定める内容について受託清算参加者に通知する。

３　前項に規定する通知を受領した受託清算参加者は、当該通知に係る参加者提案型コンプレッションの申込みの指図に対する諾否について、当社に対して通知することとする。

（清算委託者が行う清算約定（委託分）に関するＪＳＣＣ提案型コンプレッションの申込み等）

第５７条の５　清算委託者は、清算約定（委託分）について、ＪＳＣＣ提案型コンプレッションの利用に係る意思表示の指図、ＪＳＣＣ提案型コンプレッションを行う清算約定（委託分）の申込みの指図、当該申込みの撤回の指図又はＪＳＣＣ提案型コンプレッションに係る承諾の指図を行おうとする場合には、当該清算委託者とその受託清算参加者との間で定めるところにより、その旨を受託清算参加者に通知するものとする。

２　受託清算参加者は、前項に規定する通知を受領した場合には、第５３条の２の４第１項、第２項、第４項又は第７項の規定に従い、当該通知に係る清算約定（委託分）について当社に対してＪＳＣＣ提案型コンプレッションの利用に係る意思表示、ＪＳＣＣ提案型コンプレ

ッションを行う清算約定（委託分）　の申込み、当該申込みの撤回又はＪＳＣＣ提案型コンプレッションに係る承諾を行うものとする。

（清算取次原取引の合意解約）

第５８条　第５４条第４項（第５４条の２第１項において準用する場合を含む。以下同じ。）の清算取次原取引及び当該清算取次原取引に基づく債権債務（次に掲げるものを除く。）は、第５４条第４項の規定その他本業務方法書の定めるところにより当該清算取次原取引の当事者である清算委託者及び清算取次原取引相手方の間で合意解約が成立したことによって、同項第３号の清算約定の成立と同時に将来に向かって消滅する。

（１）　当該清算約定の成立時に弁済期が到来している固定金額及び変動金額の支払債務

（２）　前号に掲げるもののほか、当該清算約定の成立時に既に発生している債務であって、当社が定めるもの

２　清算委託者及び清算取次原取引相手方は、前項各号に掲げるものを除き、同項の合意解約について、手数料、損害賠償金その他の金員を支払う義務を負わない。

３　清算委託者及び清算取次原取引相手方の間の合意が本条の規定に矛盾し、又は抵触する場合には、本条の規定が優先する。

第４節　清算約定（委託分）の承継等

（清算約定（委託分）の承継の申込み）

第５８条の２　清算委託者（清算受託契約に規定する期限の利益喪失事由が発生していない者であって、受託清算参加者に対して当該清算委託者のために設定された委託取引口座に記録されている外貨建清算約定に係る変動証拠金等の預託又は支払いが完了している者に限る。以下本条において同じ。）は、自らの計算により成立している清算約定（委託分）の全部又は一部について、本条及び次条に規定するところにより、当該清算約定（委託分）及び清算委託取引の当事者となっている受託清算参加者から承継清算参加者へ承継させることができる。

２　承継清算参加者は、承継の当事者となる清算委託者と清算受託契約を締結していることを要する。

３　清算委託者は、第１項の規定により当社に対して承継の申込みをする場合には、あらかじめ、承継清算参加者に対して当該承継の申込みをし、当該承継清算参加者の承諾を得るとともに、当該清算委託者が承継清算参加者への承継を希望する清算約定（委託分）（以下本節において「対象清算約定」という。）の当事者となっている受託清算参加者（以下「承継元清算参加者」という。）に対して当該承継の申込みを行う旨を通知するものとする。

４　承継清算参加者は、前項に規定する承継の承諾をし、かつ当該承継に係る清算委託者から承継申込書の交付を受けた場合には、承継を希望する日の午後１時までに、当社に対して、当該承継申込書（承継清算参加者が当該承継の申込みを受けた旨及び当該承諾をした旨、当該清算委託者が承継元清算参加者に対して当該承継の申込みを行う旨を通知した旨及び当社に当該承継の申込みをする旨並びに承継清算参加者が当社に当該承継の申込みをする旨が記載されていること

を要する。）を提出しなければならない。

（清算約定（委託分）の承継の成立）

第５８条の３　当社は、前条の規定により行われた承継の申込みを受領した場合には、承継日の午後４時において、対象清算約定の承継が行われたと仮定して債務負担時所要証拠金を算出するとともに、当社の定めるところにより期限前終了手数料及び承継時支払金額を算出することとし、当該時点までに、当該承継清算参加者及び承継元清算参加者が当社に対して当該債務負担時所要証拠金の額（第４項第４号の規定により承継清算参加者を代理人として当社に預託されたものとみなされる当初証拠金を控除した額とする。）を預託又は交付していることを確認し、承継後の当該承継元清算参加者及び当該承継清算参加者のポジション保有状況に問題がないと認められるときは、当社は当該承継の申込みを承諾することとする。

２　前条第１項に規定する承継は、前項に規定する当社が承諾を行った時点において、対象清算約定に対応する次に掲げる権利義務を一括して承継清算参加者に承継させることとする。

（１）　承継元清算参加者及び当社の間の対象清算約定に係る権利義務（次項の規定により対象清算約定が終了する直前のもの）と当社が定める条件が同一となる権利義務

（２）　承継元清算参加者及び当該清算委託者の間の清算委託取引に係る権利義務（次項の規定により対象清算約定に係る清算委託取引が終了する直前のもの）と当社が定める条件が同一となる権利義務

３　前２項の規定により対象清算約定の承継が行われた場合には、当該対象清算約定及び当該対象清算約定に係る清算委託取引は、前項に規定する権利義務の成立と同時に当然に終了するとともに、当該対象清算約定及び当該対象清算約定に係る清算委託取引に基づく債権債務は、当社が定めるものを除き、将来に向かって消滅する。

４　当社が前条の規定による承継の申込みを第１項の規定に基づき承諾した場合、次に定めるところにより前項の規定により終了した対象清算約定の決済及び承継が行われるものとする。

（１）　承継日に、当社、承継清算参加者及び当該承諾に係る清算委託者の間において、第２項各号の権利義務が発生する。

（２）　前号の規定により発生する権利義務は、当該承諾に係る清算委託者の承継清算参加者に対する有価証券等清算取次ぎの委託に基づき、承継清算参加者が当該清算委託者の計算により対象清算約定の終了時に成立させた清算約定（担保型）の清算約定（委託分）及びその清算委託取引に係る権利義務とみなす。

（３）　当社、承継清算参加者、承継元清算参加者及び当該承諾に係る清算委託者は、第３項の対象清算約定及び当該対象清算約定に係る清算委託取引の終了並びに第１号の規定による権利義務の発生に伴い、当社が定めるところにより、承継時支払金額、期限前終了手数料及び変動証拠金の授受を行う。

（４）　第７６条の規定により当該承諾に係る清算委託者が返還請求権を有する当初証拠金（第２項各号に掲げる権利義務の全部について承継された場合で、第７２条の規定により預託されたもの（承継元清算参加者を代理人として当社に預託されている当初証拠金として取り扱う旨

の申請が行われたものを除く。）に限る。）は、承継清算参加者を代理人として当社に預託された当初証拠金とみなす。

５　前項の規定により成立した当社及び承継清算参加者間の権利義務については、これを清算約定（担保型）の清算約定（委託分）とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。

（清算委託者の清算委託取引の移管の申込み）

第５８条の４　清算委託者（清算受託契約に規定する期限の利益喪失事由が発生していない者であって、受託清算参加者に対して当該清算委託者のために設定された委託取引口座に記録されている外貨建清算約定に係る変動証拠金等の預託又は支払いが完了している者に限る。以下本条及び次条において「移管元清算委託者」という。）は、受託清算参加者との間で成立している清算委託取引の全部又は一部について、本条及び次条に規定するところにより、清算参加者（以下「移管先清算参加者」という。）又は他の清算委託者（以下本条及び次条において「移管先清算委託者」という。）に移管することができる。

２　移管元清算委託者は、前項の規定により清算委託取引を移管する場合には、あらかじめ、当該移管元清算委託者の受託清算参加者（当該受託清算参加者以外の移管先清算参加者に対して移管する場合（以下「受託外参加者承継の場合」という。）には当該移管先清算参加者を、移管先清算委託者に対して移管する場合には当該移管先清算委託者及びその受託清算参加者を含む。以下本条において同じ。）に対して当該移管の申込みをし、当該移管元清算委託者の受託清算参加者の承諾を得るものとする。

３　移管元清算委託者の受託清算参加者は、前項に規定する清算委託取引の移管の承諾をし、かつ移管元清算委託者から当該移管に係る申込書の交付を受けた場合には、移管を希望する日の午後１時までに、当社に対して、当該申込書（移管元清算委託者及び当該移管元清算委託者の受託清算参加者が移管に合意することが記載されていることを要する。）を提出しなければならない。

（清算委託者の清算委託取引の移管の成立）

第５８条の５　当社は、前条第３項の規定により行われた移管の申込みを受領した場合には、当該移管を希望する日の午後４時において、清算委託取引の移管が行われたと仮定して債務負担時所要証拠金を算出することとし、当該時点までに、移管元清算委託者の受託清算参加者（受託外参加者承継の場合には移管先清算参加者を、移管先清算委託者に対して移管する場合には当該移管先清算委託者の受託清算参加者を含む。以下本項において同じ。）が当社に対して当該債務負担時所要証拠金の額（第３項の規定により移管先清算委託者が当該移管先清算委託者の受託清算参加者を代理人として当社に預託されたものとみなされる当初証拠金又は移管先清算参加者が当社に預託したものとみなされる当初証拠金を控除した額とする。）を預託又は交付していることを確認し、移管後の当該移管元清算委託者の受託清算参加者のポジション保有状況に問題がないと認められるときは、当社は当該移管の申込みを承諾することとする。

２　清算委託取引の移管は、前項の規定により移管の申込みを当社が承諾した時点で成立するものとする。

3　前項の規定により清算委託取引の移管が成立した場合には、第７６条の規定により移管元清算委託者が返還請求権を有する当初証拠金（清算委託取引の全部について移管された場合で、第７２条の規定により預託されたもの（移管元清算委託者が当該移管元清算委託者の受託清算参加者を代理人として当社に預託している当初証拠金として取り扱う旨の申請が行われたものを除く。）に限る。）は、移管先清算委託者が当該移管先清算委託者の受託清算参加者を代理人として当社に預託した当初証拠金（清算委託取引を移管先清算参加者に移管した場合には、当該移管先清算参加者が当社に預託した当初証拠金）とみなす。

4　移管先清算参加者に対し清算委託取引を移管する場合において、第２項の規定により移管が成立したときは、移管の対象となった移管元清算委託者及び当該移管元清算委託者の受託清算参加者の間の清算委託取引（受託外参加者承継の場合には当該清算委託取引に係る清算約定（委託分）を含む。以下本項において同じ。）は当然に終了するとともに、当該清算委託取引に基づく債権債務は、当社が定めるものを除き、将来に向かって消滅するものとする。受託外参加者承継の場合には、これと同時に、当該移管先清算参加者及び当社の間において本項の規定により終了する清算約定（委託分）に係る権利義務と当社が定める条件が同一となる権利義務が新たに発生するものとする。

5　受託外参加者承継の場合には、当社は、当社が定めるところにより、承継時支払金額及び期限前終了手数料を算出することとし、前項の規定による清算約定（委託分）の終了及び権利義務の発生に伴い、当社、移管元清算委託者の受託清算参加者及び移管先清算参加者は、当社が定めるところにより、承継時支払金額、期限前終了手数料及び変動証拠金の授受を行う。

6　移管先清算委託者に対して清算委託取引を移管する場合において、第２項の規定により移管が成立したときは、移管の対象となった移管元清算委託者及び当該移管元清算委託者の受託清算参加者の間の清算委託取引（当該受託清算参加者以外の清算参加者を受託清算参加者とする移管先清算委託者に対し移管する場合（以下「受託外委託者承継（委託分）の場合」という。）には、当該清算委託取引に係る清算約定（委託分）を含む。以下本項において同じ。）は当然に終了するとともに、当該清算委託取引に基づく債権債務は、当社が定めるものを除き、将来に向かって消滅するものとする。これと同時に、移管先清算委託者及び当該移管先清算委託者の受託清算参加者の間において当該清算委託取引と同一内容の法律関係（受託外委託者承継（委託分）の場合には、当該移管先清算委託者の受託清算参加者及び当社の間において本項の規定により終了する清算約定（委託分）に係る権利義務と当社が定める条件が同一となる権利義務を含む。）が新たに成立するものとする。

7　受託外委託者承継（委託分）の場合には、当社は、当社が定めるところにより、承継時支払金額及び期限前終了手数料を算出することとし、前項の規定による清算約定（委託分）の終了及び法律関係の成立に伴い、当社、移管元清算委託者の受託清算参加者及び移管先清算委託者の受託清算参加者は、当社が定めるところにより、承継時支払金額、期限前終了手数料及び変動証拠金の授受を行う。

8　清算委託取引の移管に伴う移管元清算委託者及び当該移管元清算委託者の受託清算参加者（受託外参加者承継の場合には移管先清算参加者を、移管先清算委託者に対して移管する場合には当

該移管先清算委託者及びその受託清算参加者を含む。）の間の債権債務の清算は、これらの者の間において、その合意に従って行う。

９　移管先清算参加者に対して清算委託取引を移管する場合において、第４項前段の規定により終了する清算委託取引に係る清算約定（委託分）（受託外参加者承継の場合には、第４項後段の規定により発生する権利義務）は、当該移管先清算参加者の清算約定（担保型）の清算約定（自己分）とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。

１０　移管先清算委託者に対して清算委託取引を移管する場合において、第６項後段の規定により移管先清算委託者及び当該移管先清算委託者の受託清算参加者の間において成立する法律関係は、当該移管先清算委託者の受託清算参加者に対する有価証券等清算取次ぎの委託により成立した清算委託取引（担保型）とみなし、同項前段の規定により終了する清算委託取引に係る清算約定（委託分）（受託外委託者承継（委託分）の場合には、同項後段の規定により移管先清算委託者の受託清算参加者及び当社の間において発生する権利義務）は、移管先清算委託者の計算により成立する清算約定（担保型）の清算約定（委託分）とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。

（清算参加者の清算約定（自己分）の移管の申込み）

第５８条の６　清算参加者（以下本条及び次条において「移管元清算参加者」という。）は、当社との間で成立している清算約定（自己分）の全部又は一部について、本条及び次条に規定するところにより、清算委託者（以下本条及び次条において「移管先清算委託者」という。）に移管することができる。

２　移管元清算参加者は、前項の規定により清算約定（自己分）を移管する場合には、あらかじめ、移管先清算委託者（当該移管元清算参加者以外の清算参加者を受託清算参加者とする移管先清算委託者に移管する場合（以下「受託外委託者承継（自己分）の場合」という。）には当該清算参加者を含む。以下本条において同じ。）に対して当該移管の申込みをし、当該移管先清算委託者の承諾を得るものとする。

３　移管元清算参加者は、前項に規定する清算約定（自己分）の移管について移管先清算委託者の承諾を得た場合には、移管を希望する日の午後１時までに、当社に対して、当該申込書（移管元清算参加者及び移管先清算委託者が移管に合意することが記載されていることを要する。）を提出しなければならない。

（清算参加者の清算約定（自己分）の移管の成立）

第５８条の７　当社は、前条第３項の規定により行われた移管の申込みを受領した場合には、当該移管を希望する日の午後４時において、移管元清算参加者が移管先清算委託者への移管を希望する清算約定（自己分）の移管が行われたと仮定して債務負担時所要証拠金を算出することとし、当該時点までに、移管元清算参加者（受託外委託者承継（自己分）の場合には移管先清算委託者の受託清算参加者を含む。以下本項において同じ。）が当社に対して当該債務負担時所要証拠金の額（第３項の規定により移管先清算委託者が当該移管先清算委託者の受託清算参加者を代理人

として当社に預託されたものとみなされる当初証拠金を控除した額とする。）を預託又は交付していることを確認し、移管後の当該移管元清算参加者のポジション保有状況に問題がないと認められるときは、当社は当該移管の申込みを承諾することとする。

２　清算約定（自己分）の移管は、前項の規定により移管の申込みを当社が承諾した時点で成立するものとする。

３　前項の規定により清算約定（自己分）の移管が成立した場合には、第７６条の規定により移管元清算参加者が返還請求権を有する清算約定（自己分）に係る当初証拠金（清算約定（自己分）の全部について移管された場合であって、移管元清算参加者が当社に預託している当初証拠金として取り扱う旨の申請が行われたものを除く。）は、移管先清算委託者が当該移管先清算委託者の受託清算参加者を代理人として当社に預託した当初証拠金とみなす。

４　第２項の規定により清算約定（自己分）の移管が成立した場合には、移管先清算委託者及び当該移管先清算委託者の受託清算参加者の間において当該清算約定（自己分）（当社が定める債権債務を除く。）と同一の経済的効果を有する法律関係が新たに成立するものとする。この場合において、受託外委託者承継（自己分）の場合には、当該清算約定（自己分）は当然に終了するとともに、当該清算約定（自己分）に基づく債権債務は、当社が定めるものを除き、将来に向かって消滅するものとし、これと同時に、当該移管先清算委託者の受託清算参加者及び当社の間において当該清算約定（自己分）に係る権利義務と当社が定める条件が同一となる権利義務が新たに発生するものとする。

５　清算約定（自己分）の移管に伴う移管元清算参加者及び移管先清算委託者（受託外委託者承継（自己分）の場合には当該移管先清算委託者の受託清算参加者を含む。）の間の債権債務の清算は、これらの者の間において、その合意に従って行う。

６　受託外委託者承継（自己分）の場合には、当社は、当社が定めるところにより、承継時支払金額及び期限前終了手数料を算出することとし、第４項の規定による清算約定（自己分）の終了及び権利義務の発生に伴い、当社、移管元清算参加者及び移管先清算委託者の受託清算参加者は、当社が定めるところにより、承継時支払金額、期限前終了手数料及び変動証拠金の授受を行う。

７　第４項前段の規定により成立する法律関係は、当該移管先清算委託者の受託清算参加者に対する有価証券等清算取次ぎの委託により成立した清算委託取引（担保型）とみなし、第１項の移管の申込みに係る清算約定（自己分）（受託外委託者承継（自己分）の場合には、第４項後段の規定により発生する権利義務）は、当該清算委託取引に係る清算約定（担保型）の清算約定（委託分）とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。

第５章　清算参加者口座等

（清算参加者口座）

第５９条　当社は、清算参加者ごとに、各清算参加者を当事者とする各清算約定に係る当初証拠金、変動証拠金、損益差金その他本業務方法書等に基づき、当該各清算約定について各清算参加者との間で授受される金銭等を管理するため、当該各清算約定及びクロスマージン制度の対象となっ

た国債証券先物取引及び金利先物取引の建玉を記録する口座（以下「清算参加者口座」という。）を開設する。

２　清算参加者口座は、清算参加者の自己の計算による清算約定並びに当該清算参加者の計算によるクロスマージン制度の対象となった国債証券先物取引及び金利先物取引の建玉を記録する口座（以下「自己取引口座」という。）と清算委託者の計算による清算約定並びに当該清算委託者の計算によるクロスマージン制度の対象となった国債証券先物取引及び金利先物取引の建玉を清算受託契約ごとに記録する口座（以下「委託取引口座」という。）に区分する。この場合、複数の清算委託者又は同一の清算委託者を当事者とする複数の清算受託契約について同一の委託取引口座を設定することはできない。

３　当社は、清算参加者の請求があった場合には、当該清算参加者のために開設した自己取引口座を複数に区分する口座を設定することができる。

４　清算参加者は、次条第２項の規定により複数に区分する清算取次口座を開設した場合には、当社に対し、当該区分に応じて委託取引口座を区分するよう請求するものとし、当社は当該請求に基づき委託取引口座を複数に区分する口座を設定する。

５　前２項の規定により複数に区分する口座（以下「区分口座」という。）が設定された自己取引口座又は委託取引口座について、当社は、清算参加者の指定に従い、各区分口座に清算約定及びクロスマージン制度の対象となった国債証券先物取引及び金利先物取引の建玉を記録する。

６　各清算約定、クロスマージン制度の対象となった国債証券先物取引及び金利先物取引の建玉、当初証拠金、変動証拠金及び損益差金に係る当社と清算参加者の間の債権債務及び当社と清算委託者の間の債権債務は、自己取引口座及び各委託取引口座ごとに生じるものとする。

７　清算参加者は、当社の定めるところにより、清算委託者から委託取引口座に係るヘッジ口座又はノンヘッジ口座の種別について申告を受け、当該申告の内容を当社に届け出るものとする。委託取引口座の種別を変更する場合も同様とする。

（清算取次口座）

第６０条　受託清算参加者は、清算委託者との間で締結された清算受託契約ごとに、各清算受託契約に基づく清算委託取引の内容、当該清算委託者の計算によるクロスマージン制度の対象となった国債証券先物取引及び金利先物取引の建玉、当該清算委託取引に係る当初証拠金、委託当初証拠金、変動証拠金並びに損益差金その他当該各清算受託契約及び本業務方法書等に基づいて清算委託者との間で授受される金銭等を管理するための口座（以下「清算取次口座」という。）を開設する。

２　受託清算参加者は、清算委託者の請求があった場合には、当該清算委託者のために開設した清算取次口座を複数に区分する口座を開設することができる。

３　各清算委託取引、清算委託者の計算によるクロスマージン制度の対象となった国債証券先物取引及び金利先物取引の建玉、当初証拠金、変動証拠金並びに損益差金に係る受託清算参加者と清算委託者の間の債権債務は、清算取次口座ごとに生じるものとする。

第６章　証拠金等

第１節　通則

（証拠金の目的）

第６１条　証拠金は、次の各号に掲げる証拠金の区分に応じて、当該各号に掲げる債務（次項において「被担保債務」という。）を担保する目的で、本業務方法書等並びに清算受託契約の定めるところにより、当社、清算参加者及び清算委託者の間で授受されるものとする。

（１）　当初証拠金

清算参加者が清算約定に関して当社に対して負担する債務（当該清算約定の終了に伴って生じる債務を含む。）及び清算参加者口座に記録されたクロスマージン対象国債先物清算約定及びクロスマージン対象金利先物清算約定に関して当社に対して負担する債務並びに清算委託者が清算委託取引に関して受託清算参加者に対して負担する債務（当該清算委託取引の終了に伴って生じる債務を含む。）及び当該清算委託者のために設定された委託取引口座に記録されたクロスマージン対象国債先物清算約定及びクロスマージン対象金利先物清算約定に関して受託清算参加者に対して負担する債務

（２）　委託当初証拠金

清算委託者が清算委託取引に関して受託清算参加者に対して負担する債務（当該清算委託取引の終了に伴って生じる債務を含む。）並びに当該清算委託者のために設定された委託取引口座に記録されたクロスマージン対象国債先物清算約定及びクロスマージン対象金利先物清算約定に関して受託清算参加者に対して負担する債務

（３）　清算約定（自己分）に関して当社及び清算参加者の間で授受される変動証拠金

清算参加者が清算約定（担保型）の清算約定（自己分）に関して当社に対して負担する債務又は当社が清算約定（担保型）の清算約定（自己分）に関して清算参加者に対して負担する債務

（４）　清算約定（委託分）に関して当社及び受託清算参加者の間で授受される変動証拠金

受託清算参加者が清算約定（担保型）の清算約定（委託分）に関して当社に対して負担する債務又は当社が清算約定（担保型）の清算約定（委託分）に関して受託清算参加者に対して負担する債務

（５）　清算委託取引に関して受託清算参加者及び清算委託者の間で授受される変動証拠金

清算委託者が清算委託取引（担保型）に関して受託清算参加者に対して負担する債務又は受託清算参加者が清算委託取引（担保型）に関して清算委託者に対して負担する債務

２　証拠金の預託を受けた当社、清算参加者及び清算委託者は、本業務方法書等及び清算受託契約の定めるところにより、証拠金（金銭を異なる通貨へ両替した際に要した費用及び代用有価証券の換価処分に要した費用を控除した残額。以下本項において同じ。）を被担保債務の弁済に充当し、又は証拠金の返還請求権と被担保債務に係る債権とを対当額で相殺することができる。

３　証拠金の預託は、本業務方法書等に別段の定めがある場合を除き、証拠金が金銭である場合に

は担保目的の消費寄託とし、証拠金が代用有価証券である場合には担保目的の無償の消費貸借とする。

（損益差金の目的）

第６１条の２　損益差金は、次の各号に掲げる損益差金の区分に応じて、当該各号に掲げる清算約定（決済型）又は清算委託取引（決済型）の現在価値の変動に係るエクスポージャーを決済する目的で、本業務方法書等並びに清算受託契約の定めるところにより、当社、清算参加者及び清算委託者の間で授受されるものとする。

（１）　清算約定（自己分）に関して当社及び清算参加者の間で授受される損益差金
清算約定（決済型）の清算約定（自己分）の現在価値の変動に係るエクスポージャー

（２）　清算約定（委託分）に関して当社及び受託清算参加者の間で授受される損益差金
清算約定（決済型）の清算約定（委託分）の現在価値の変動に係るエクスポージャー

（３）　清算委託取引に関して受託清算参加者及び清算委託者の間で授受される損益差金
清算委託取引（決済型）の清算委託取引の現在価値の変動に係るエクスポージャー

２　第７８条の２第２項に定める時点をもって、当該時点における前項各号に掲げる清算約定（決済型）及び清算委託取引（決済型）の正味現在価値はゼロとして算出されたものとする。ただし、当社が定める場合については、第５１条の２第１項の規定による損益差金等の授受の申込みが行われた清算約定（決済型）及び清算委託取引（決済型）の当該申込みが行われた日の当社が定める時点をもって、正味現在価値はゼロとして算出されたものする。

（民法及び商法との優先関係）

第６２条　当社、清算参加者及び清算委託者は、民法及び商法の規定にかかわらず、本業務方法書等及び清算受託契約で定める場合に限り、証拠金の返還その他の請求をすることができる。

第２節　当初証拠金及び日中証拠金

（当初証拠金の預託義務）

第６３条　清算参加者及び清算委託者は、次の各号に掲げる清算約定の区分に応じて、当該各号に定めるところにより、当社に対して当初証拠金（日中証拠金を除く。以下本条から第６６条までにおいて同じ。）を預託する義務を負う。

（１）　清算約定（自己分）
清算参加者は、当初証拠金として、清算約定（自己分）に係る当初証拠金所要額以上の額の金銭又は代用有価証券を当社に預託しなければならない。

（２）　清算約定（委託分）

ａ　清算委託者は、当初証拠金として、当該清算委託者の清算約定（委託分）に係る当初証拠金所要額（受託清算参加者及び清算委託者の間に別段の合意がある場合には、当該合意により算出される額と当初証拠金所要額のいずれか大きい額。以下同じ。）以上の額の金銭又は

代用有価証券を当社に預託しなければならない。

ｂ　上記ａの規定による清算委託者の当社に対する当初証拠金の預託は、第７２条の規定に従い、上記ａの受託清算参加者を代理人とする方法により行うものとする。

ｃ　清算委託者が第７３条の規定により委託当初証拠金を受託清算参加者に預託した場合には、当該委託当初証拠金の額を、当該清算委託者が当社に預託すべき当初証拠金所要額から控除する。この場合において、当該受託清算参加者は、差換当初証拠金として、清算委託者から預託を受けた委託当初証拠金の額以上の金銭又は代用有価証券を当社に預託しなければならない。

ｄ　第８４条の７第１項及び第２項の規定により委託取引口座にカスタマーバッファーが充当されている場合には、当該充当額を、当該清算委託者が当社に預託すべき当初証拠金所要額から控除する。

２　第１７条第３項の規定は、当初証拠金について準用する。

（清算参加者の当初証拠金所要額）

第６４条　清算参加者の当初証拠金所要額は、当社営業日ごとに、清算約定（自己分）と清算約定（委託分）についてそれぞれ、当社が定める方法により当社が算出する。

２　清算約定（自己分）に係る当初証拠金所要額は、自己取引口座について算出した額とする。

３　清算約定（委託分）に係る各委託取引口座の当初証拠金所要額は、当該各委託取引口座について算出した額とする。

４　当社は、算出した当初証拠金所要額を、当社が定めるところにより清算参加者に通知する。

（清算委託者の当初証拠金所要額）

第６５条　清算委託者の当初証拠金所要額は、委託取引口座について当社が定める方法により当社が算出した額とする。

２　受託清算参加者は、前項の規定により当社が算出した清算委託者の当初証拠金所要額を、速やかに当該清算委託者に通知する。

（受託清算参加者と清算委託者の合意に基づく清算委託者に対する当初証拠金所要額の割増し）

第６５条の２　当社は、受託清算参加者から、当該受託清算参加者及び清算委託者（当該受託清算参加者と同一の企業集団に含まれない者に限る。）の間の合意に基づき、当社の定めるところにより当該清算委託者の当初証拠金所要額の引上げの申告があった場合には、当社の定めるところにより、当該清算委託者の清算約定（委託分）に係る当初証拠金所要額を引き上げる。

（当初証拠金の預託時限）

第６６条　清算参加者及び清算委託者は、当初証拠金として当社に預託した金銭及び代用有価証券の代用価格の合計額（以下「当初証拠金預託額」という。）が、当社に預託すべき自己取引口座又は委託取引口座ごとの当初証拠金所要額に不足する場合には、その不足が生じた日の翌当社営

業日午前１１時までに、その不足額を当社に預託しなければならない。

２　前項に規定する時限までに清算委託者が不足額を預託するための業務執行手順を構築することが実務上困難であると清算参加者と清算委託者との間であらかじめ合意した場合には、当該清算委託者は、不足が生じた日の翌々当社営業日の午前１１時までに当該不足額を当社に預託するものとする。

３　前２項の規定にかかわらず、当初証拠金預託額が、債務負担の申込みを受領することに伴い当社が算出した債務負担時所要証拠金の額以上となった場合には、債務負担時所要証拠金の額を当初証拠金所要額とみなす。

（日中証拠金の預託義務）

第６７条　清算参加者及び清算委託者は、次の各号に掲げる清算約定の区分に応じて、当該各号に定めるところにより、当社に対して日中証拠金を預託する義務を負う。

（１）　清算約定（自己分）

清算参加者は、清算約定（自己分）に係る日中証拠金所要額以上の額の金銭又は代用有価証券を、当初証拠金として、当社に預託しなければならない。

（２）　清算約定（委託分）

ａ　清算委託者は、当該清算委託者の清算約定（委託分）に係る日中証拠金所要額（受託清算参加者及び清算委託者の間に別段の合意がある場合には、当該合意により算出される額と日中証拠金所要額のいずれか大きい額。以下同じ。）以上の額の金銭又は代用有価証券を、当初証拠金として、当社に預託しなければならない。

ｂ　上記ａの規定による清算委託者の当社に対する日中証拠金の預託は、第７２条の規定に従い、上記ａの受託清算参加者を代理人とする方法により行うものとする。

ｃ　清算委託者が第７３条の規定により委託当初証拠金を受託清算参加者に預託した場合には、当該委託当初証拠金の額を、当該清算委託者が当社に預託すべき日中証拠金所要額から控除する。この場合において、当該受託清算参加者は、差換当初証拠金として、清算委託者から預託を受けた委託当初証拠金の額以上の金銭又は代用有価証券を当社に預託しなければならない。

ｄ　第８４条の７第１項及び第２項の規定により委託取引口座にカスタマーバッファーが充当されている場合には、当該充当額を、当該清算委託者が当社に預託すべき日中証拠金所要額から控除する。

２　第１７条第３項の規定は、日中証拠金について準用する。

（清算参加者の日中証拠金所要額）

第６８条　清算参加者の日中証拠金所要額は、当社営業日ごとに、清算約定（自己分）と清算約定（委託分）についてそれぞれ、当社が定める方法により当社が算出する。

２　清算約定（自己分）に係る日中証拠金所要額は、自己取引口座について算出した額とする。

３　清算約定（委託分）に係る各委託取引口座の日中証拠金所要額は、当該各委託取引口座につい

て算出した額とする。

４　当社は、算出した日中証拠金所要額を、当社が定めるところにより清算参加者に通知する。

（清算委託者の日中証拠金所要額）

第６９条　清算委託者の日中証拠金所要額は、委託取引口座について当社が定める方法により当社が算出した額とする。

２　受託清算参加者は、前項の規定により当社が算出した清算委託者の日中証拠金所要額を、速やかに当該清算委託者に通知する。

（日中証拠金の預託時限）

第７０条　清算参加者及び清算委託者は、当初証拠金預託額が、当社に預託すべき日中証拠金所要額に不足する場合には、その不足が生じた日の午後３時３０分までに、その不足額を当社に預託しなければならない。

２　前項に規定する時限までに清算委託者が不足額を預託するための業務執行手順を構築することが実務上困難であると清算参加者と清算委託者との間であらかじめ合意した場合には、当該清算委託者は、不足が生じた日の翌々当社営業日の午後３時３０分までに当該不足額を当社に預託するものとする。

３　当初証拠金預託額が、債務負担の申込みを受領することに伴い当社が算出した債務負担時所要証拠金の額以上となった場合には、債務負担時所要証拠金の額を日中証拠金所要額とみなす。

（当初証拠金の預託方法）

第７１条　当社に対する当初証拠金の預託は、当社が定める方法により行う。

（清算委託者による当初証拠金の預託）

第７２条　清算委託者は、当社に預託すべき当初証拠金所要額及び日中証拠金所要額以上の金銭又は代用有価証券を、清算受託契約の定めるところにより、当初証拠金として受託清算参加者に交付しなければならない。

２　受託清算参加者は、前項の規定により清算委託者から当初証拠金として交付を受けた金銭又は代用有価証券の全部を、当該清算委託者の代理人として、当社に預託しなければならない。

３　受託清算参加者は、清算委託者から当初証拠金として交付を受けた金銭及び代用有価証券について、清算取次口座ごとに帳簿を作成及び記帳するなどの区分管理を行わなければならない。

４　清算委託者が受託清算参加者に対し当初証拠金として交付した金銭及び代用有価証券の代用価格の合計額が、当該清算委託者が当社に預託すべき当初証拠金所要額及び日中証拠金所要額を下回っている場合、当該受託清算参加者は、その不足額以上の金銭又は代用有価証券を、第６６条第１項又は第７０条第１項に規定する日時までに、自己の負担で当社に預託しなければならない。

５　前項の受託清算参加者が自己の負担で当社に預託した金銭又は代用有価証券は差換当初証拠

金とみなす。

（差換預託）

第７３条　受託清算参加者は、清算委託者の同意を得た場合には、清算約定（委託分）について、当該清算委託者から委託当初証拠金として金銭又は代用有価証券の預託を受けることができる。

２　受託清算参加者は、清算委託者から委託当初証拠金として金銭又は代用有価証券の預託を受けた場合には、差換当初証拠金として、当該金銭及び代用有価証券の代用価格の合計額以上の金銭又は代用有価証券を、自己の負担で当社に預託しなければならない。

３　前項の場合において、受託清算参加者は、清算委託者から委託当初証拠金として預託を受けた金銭及び代用有価証券について、清算取次口座ごとに帳簿を作成及び記帳するなどの区分管理しなければならない。

（当初証拠金の臨時預託）

第７４条　第６４条から第６６条まで及び第６８条から第７０条までの規定にかかわらず、当社は、市場環境の急激な変化が生じた場合その他当社の金利スワップ取引清算業務の適切な遂行を確保する観点から必要と認める場合には、清算参加者に対し、当社がその都度定める額及び方法等により当初証拠金の臨時預託を請求することができる。

（当初証拠金の区分及び管理方法）

第７５条　清算参加者は、当社に対して当初証拠金として金銭又は代用有価証券を交付する場合には、当該金銭又は代用有価証券を、次に掲げる当初証拠金に区分して預託するものとする。

（１）　清算約定（自己分）に係る当初証拠金

（２）　各清算委託者の清算約定（委託分）に係る当初証拠金のうち清算委託者の代理人として預託するもの

（３）　各清算委託者の清算約定（委託分）に係る当初証拠金のうち差換当初証拠金として預託するもの

（４）　カスタマーバッファーとして預託するもの

２　当社は、清算参加者から当初証拠金として預託を受けた金銭又は代用有価証券を、前項各号に掲げる区分により管理する。

３　第１項第３号に掲げる差換当初証拠金については、清算参加者は、委託当初証拠金の額（代用有価証券の場合にはその代用価格の合計額）を、毎当社営業日、当社に報告を行うものとし、当社は当該額と差換当初証拠金の差額を区分して管理するものとする。

（当初証拠金の返還請求権）

第７６条　清算参加者及び清算委託者は、次の各号に掲げる当初証拠金の区分に応じ、当該各号に定めるところにより当社に対する当初証拠金の返還請求権を有する。

（１）　清算約定（委託分）に係る当初証拠金

ａ　清算委託者は、当該清算委託者が当社に預託した清算約定（委託分）（当該清算委託者が受託清算参加者との間で締結した清算受託契約に基づく有価証券等清算取次ぎの委託により成立するものに限る。以下本号において同じ。）に係る当初証拠金の額及び当該受託清算参加者が当該清算約定（委託分）に関して当社に預託した差換当初証拠金の額の合計額から当該清算参加者が当該清算約定（委託分）に関して当社に対して負担する未履行債務（当該清算参加者の破綻等その他の事由による当該清算約定（委託分）の処理に伴って生じる債務のうち未履行であるものを含む。以下本号において同じ。）の額（第９９条の２第２項の規定により負担する債務の額を除く。）並びに当該清算参加者が当該清算委託者のために設定された委託取引口座に記録されたクロスマージン対象国債先物清算約定及びクロスマージン対象金利先物清算約定に関して当社に対して負担する未履行債務の額を控除した額の範囲内で、当該清算委託者が当社に預託した当該清算約定（委託分）に係る当初証拠金の額及び当該受託清算参加者が当該清算約定（委託分）に関して当社に預託した差換当初証拠金の額のうち当該清算委託者が当該受託清算参加者に預託した清算委託取引（当該清算受託契約に基づく有価証券等清算取次ぎの委託により成立するものに限る。）に係る委託当初証拠金の額の合計額から、当該清算委託者が当該清算委託取引に関して当該受託清算参加者に対して負担する未履行債務（当該清算委託取引の終了に伴って生じる債務のうち未履行であるものを含む。）の額並びに当該清算委託者が当該清算委託者のために設定された委託取引口座に記録されたクロスマージン対象国債先物清算約定及びクロスマージン対象金利先物清算約定に関して当該受託清算参加者に対して負担する未履行債務の額を控除した額に相当する部分について、当初証拠金の返還請求権を有する。

ｂ　清算参加者は、当該清算参加者と清算受託契約を締結している前ａに規定する清算委託者が当社に預託した清算約定（委託分）に係る当初証拠金及び当該清算参加者が当該清算約定（委託分）に関して当社に預託した差換当初証拠金の合計額から、当該清算参加者が当該清算約定（委託分）に関して当社に対して負担する未履行債務の額、当該清算参加者が当該清算委託者のために設定された委託取引口座に記録されたクロスマージン対象国債先物清算約定及びクロスマージン対象金利先物清算約定に関して当社に対して負担する未履行債務の額並びに当該清算委託者が当初証拠金の返還請求権を有する額の合計額を控除した額に相当する部分について、当初証拠金の返還請求権を有する。

（２）　清算約定（自己分）に係る当初証拠金

清算参加者は、当該清算参加者が当社に預託した当初証拠金の額から当該清算参加者が清算約定（自己分）に関して当社に対して負担する未履行債務（当該清算参加者の破綻等その他の事由による清算約定（自己分）の処理に伴って当社に対して負担する債務のうち未履行であるものを含む。）の額並びに当該清算参加者が自己取引口座に記録されたクロスマージン対象国債先物清算約定及びクロスマージン対象金利先物清算約定に関して当社に対して負担する未履行債務の額を控除した額に相当する部分について、当初証拠金の返還請求権を有する。

（３）　カスタマーバッファー

清算参加者は、カスタマーバッファー未充当残高について、当初証拠金の返還請求権を有す

る。ただし、第８４条の７第４項の定めるところにより、委託取引口座へのカスタマーバッファーの充当状態が解消された場合において、当該清算委託者が当初証拠金所要額の不足額を預託又は交付するまでの間は、清算参加者は、充当されていたカスタマーバッファーの額について、返還請求権を有しない。

２　清算参加者及び清算委託者は、前項の規定による当初証拠金の返還請求権の額が当社に預託すべき当初証拠金所要額又は日中証拠金所要額を上回る場合には、その超過額を限度として、当社に対し、当初証拠金の返還を請求することができる。

３　清算委託者は、前項に規定するほか、当社が定める場合には、当社が定めるところにより当初証拠金の返還を請求することができる。

４　清算委託者による当初証拠金の返還請求権の行使は、受託清算参加者を代理人とする方法により行う。ただし、当社が受託清算参加者の破綻等を認定した場合には、清算委託者による当初証拠金の返還請求権の行使は、当社に対し直接行うものとする。

５　第２項及び第３項の規定にかかわらず、清算委託者は、受託清算参加者に対して委託当初証拠金の返還請求権を行使することができる場合には、当社に対して、当該委託当初証拠金に対応する当初証拠金の返還請求権を行使することができない。ただし、当社が受託清算参加者の破綻等を認定した場合は、この限りでない。

第３節　変動証拠金等

（変動証拠金等の授受）

第７７条　当社及び清算参加者は、次の各号に掲げる通貨の清算約定（担保型）に応じて、当該各号に掲げる日ごとに変動証拠金を当該清算約定（担保型）の通貨の金銭により授受する。

（１）　円貨建清算約定　当社営業日

（２）　外貨建清算約定　当社営業日かつ外貨本国営業日である日

２　前項の規定は、当社及び清算参加者が損益差金の授受を行う場合について準用する。この場合において、前項中「変動証拠金」とあるのは「損益差金」と、「清算約定（担保型）」とあるのは「清算約定（決済型）」と読み替えるものとする。

（クロスマージン更新差金）

第７７条の２　当社及び清算参加者は、第８４条の５第１項の規定により債権債務が成立した場合には、クロスマージン対象国債先物清算約定及びクロスマージン対象金利先物清算約定に係る証券取引等業務方法書第７３条の９及び証券取引等業務方法書第７３条の９の２に規定する差額に相当する金銭（以下「クロスマージン更新差金」という。）を当該差額が生じた日の翌当社営業日に授受する。

２　清算参加者は、クロスマージン更新差金の授受において支払方となる場合には、当該クロスマージン更新差金が生じた日の翌当社営業日の午前１１時までに、クロスマージン更新差金を当社に支払わなければならない。

３　当社は、クロスマージン更新差金の授受において受領方となる清算参加者に対し、当該クロスマージン更新差金が生じた日の翌当社営業日の午後１時３０分以降遅滞なく、クロスマージン更新差金を当該清算参加者に支払う。

（変動証拠金所要額）

第７８条　変動証拠金所要額は、各清算参加者について、自己取引口座及び委託取引口座ごとに、前当社営業日から当社営業日までの清算約定（担保型）の正味現在価値の変動に応じて、当社が定める方法により当社が算出する。

２　当社は、清算約定（担保型）の清算約定（委託分）の変動証拠金所要額を、当社が定める方法により委託取引口座ごとに算出し、その金額を当該清算委託者と清算受託契約を締結している受託清算参加者に通知する。

（損益差金所要額）

第７８条の２　前条の規定は、損益差金所要額について準用する。この場合において、同条第１項及び第２項中「変動証拠金所要額」とあるのは「損益差金所要額」と、「清算約定（担保型）」とあるのは「清算約定（決済型）」と、前条第１項中「正味現在価値の変動に応じて」とあるのは「正味現在価値に応じて」と読み替えるものとする。

２　前項の規定により算出した損益差金所要額について当社が清算参加者に通知を行った時点をもって、当該損益差金の支払いに係る債権債務が新たに成立するものとする。

（清算イールド・カーブの決定）

第７９条　当社は、当社が定める数値を基準として、当社の定めるところにより、正味現在価値を算出するためのフォワード・カーブ及びディスカウント・カーブ（以下これらを総称して「清算イールド・カーブ」という。）を定める。

第８０条　削除

（変動証拠金の預託時限）

第８１条　清算参加者は、変動証拠金の授受において支払方となる場合には、当該変動証拠金の算出日の翌当社営業日の午前１１時（外貨建清算約定に係る変動証拠金にあっては、当該変動証拠金の算出日の後最初に到来する当社営業日かつ外貨本国営業日である日の午前１１時）までに、変動証拠金所要額に相当する金銭を当社に預託しなければならない。

２　当社は、変動証拠金の授受において受領方となる清算参加者に対し、当該変動証拠金の算出日の翌当社営業日の午後１時３０分（外貨建清算約定に係る変動証拠金にあっては、当該変動証拠金の算出日の後最初に到来する当社営業日かつ外貨本国営業日である日の午後１時）以降遅滞なく、変動証拠金所要額に相当する金銭を当該清算参加者に預託する。

（損益差金の支払時限）

第８１条の２　前条の規定は、損益差金の授受について準用する。この場合において、前条第１項及び第２項中「変動証拠金」とあるのは「損益差金」と、前条第１項中「変動証拠金所要額に相当する金銭を当社に預託し」とあるのは「損益差金所要額に相当する金銭を当社に支払わ」と、前条第２項中「変動証拠金所要額に相当する金銭を当該清算参加者に預託する」とあるのは「損益差金所要額に相当する金銭を当該清算参加者に支払う」と読み替えるものとする。

（変動証拠金の臨時預託）

第８２条　第７８条及び第８１条の規定にかかわらず、当社は、市場環境の急激な変化が生じた場合その他当社の金利スワップ取引清算業務の適切な遂行を確保する観点から必要と認める場合には、清算参加者に対し、当社がその都度定める額及び方法等により変動証拠金の臨時預託を請求することができる。

（損益差金の臨時支払）

第８２条の２　前条の規定は、損益差金の臨時支払について準用する。この場合において、同条中「第７８条及び第８１条」とあるのは「第７８条の２及び第８１条の２」と、「変動証拠金の臨時預託」とあるのは「損益差金の臨時支払」と読み替えるものとする。

（変動証拠金に係る利息の取扱い）

第８３条　当社及び清算参加者は、当社が定める基準金利を利率として、当社が定めるところにより、次の各号に掲げる通貨の清算約定（担保型）に応じて、当該各号に定める日ごとに変動証拠金に係る利息を当該清算約定（担保型）の通貨の金銭により授受するものとする。

（１）　円貨建清算約定　当社営業日

（２）　外貨建清算約定　当社営業日かつ外貨本国営業日である日

２　清算参加者は、変動証拠金の利息の授受において支払方となる場合には、当該変動証拠金に係る利息の算出日の翌当社営業日の午前１１時（外貨建清算約定に係る変動証拠金の利息にあっては、当該変動証拠金の利息の算出日の後最初に到来する当社営業日かつ外貨本国営業日である日の午前１１時）までに、当社に支払わなければならない。

３　当社は、変動証拠金の利息の授受において受領方となる清算参加者に対し、当該変動証拠金に係る利息の算出日の翌当社営業日の午後１時３０分（外貨建清算約定に係る変動証拠金の利息にあっては、当該変動証拠金の利息の算出日の後最初に到来する当社営業日かつ外貨本国営業日である日の午後１時）以降遅滞なく、変動証拠金に係る利息を清算参加者に支払う。

（損益差金に係る調整金の取扱い）

第８３条の２　当社及び清算参加者は、当社が定めるところにより、次の各号に掲げる通貨の清算約定（決済型）に応じて、当該各号に定める日ごとに損益差金に係る調整金を当該清算約定（決済型）の通貨の金銭により授受するものとする。

（１）　円貨建清算約定　当社営業日
（２）　外貨建清算約定　当社営業日かつ外貨本国営業日である日

２　前条第２項及び第３項の規定は、損益差金に係る調整金の授受について準用する。この場合において、同条第２項及び第３項中「変動証拠金の利息」及び「変動証拠金に係る利息」とあるのは、「損益差金に係る調整金」と読み替えるものとする。

（変動証拠金の返還請求権）

第８４条　当社及び清算参加者は、本業務方法書等の定めるところにより授受を行う場合及び清算約定の期限前終了に伴い返還する場合を除くほか、相手方に対し、変動証拠金の返還を請求することができない。

第４節　クロスマージン制度

（クロスマージン制度利用の届出）

第８４条の２　清算参加者は、当該清算参加者又は清算委託者がクロスマージン制度を利用しようとする場合には、あらかじめ当社が定めるところにより、当社に届け出なければならない。

２　清算参加者は、前項の規定により当社に届け出た内容を変更しようとする場合には、あらかじめ当社が定めるところにより、当社に届け出なければならない。

（クロスマージン制度利用の取りやめ）

第８４条の３　清算参加者は、当該清算参加者又は清算委託者がクロスマージン制度の利用を取りやめようとするときは、あらかじめ当社が定めるところにより、当社に届け出なければならない。

（クロスマージンの承諾）

第８４条の４　当社は、クロスマージンの申請を受領した場合、当該申請が当社の定める要件を満たすときに、当該申請に係るクロスマージン利用者である清算参加者又はクロスマージン利用者である清算委託者の受託清算参加者に対して、当社の定めるところにより、当該申請の内容を直ちに通知するものとする。

２　前項に規定する清算参加者は、前項の通知を受領した場合には、当該通知を受領した当社営業日の午後６時３０分までに、当社の定めるところにより、当該申請に対する承諾又は拒否の通知を当社に対して行うものとする。

３　当社は、前項の規定により承諾の通知が当社に到達した場合、当社が定める要件を満たすときに、当該承諾の通知の対象である国債証券先物取引及び金利先物取引の建玉を、当該申請に係るクロスマージン利用者が清算参加者である場合にはその自己取引口座に、清算委託者である場合には、当該清算委託者のために設定された委託取引口座にそれぞれ記録する。

４　当社は、前項の規定により記録された建玉を当社が定めるときに、自己取引口座又は委託取引口座から抹消するものとする。

（クロスマージン対象国債先物清算約定及びクロスマージン対象金利先物清算約定に係る債権債務と同一内容の債権債務の発生）

第８４条の５　証券取引等業務方法書第７３条の１５の４第１項の規定により、クロスマージン申請者と当社との間のクロスマージン対象国債先物清算約定及びクロスマージン対象金利先物清算約定に係る債権債務が消滅する場合には、当該クロスマージン対象国債先物清算約定及びクロスマージン対象金利先物清算約定の建玉が記録されている清算参加者口座に係る清算参加者と当社との間で、当社の定めるところにより、当該債権債務と同一内容の債権債務が成立する。

２　前項のクロスマージン対象国債先物清算約定及びクロスマージン対象金利先物清算約定がその建玉が委託取引口座に記録されているものである場合には、前項の規定による債権債務の成立と同時に、当該委託取引口座に係る清算委託者とその受託清算参加者との間で、前項の規定により成立した債権債務が当該清算委託者及びその受託清算参加者間の清算受託契約に基づく個別の有価証券等清算取次ぎの委託により成立したものと仮定したときに当該委託により成立することとなる清算委託取引と同一の経済的効果を有する法律関係が成立する。

３　当社が第９３条の２第１項に規定する転売又は買戻しを行った場合は、第１項の規定により成立した債権債務及び前項の規定により成立した法律関係は、当該転売又は買戻しが実施された時点において将来に向かって消滅する。

第５節　カスタマーバッファー制度

（カスタマーバッファーの利用の申告）

第８４条の６　受託清算参加者は、清算委託者にカスタマーバッファーの利用を認める場合には、利用を認める委託取引口座ごとに、当社が定める方法により、あらかじめ当社にカスタマーバッファー利用上限額を申告するものとする。

２　受託清算参加者は、カスタマーバッファーの利用を認める清算委託者について、カスタマーバッファー利用上限額を変更する場合には、当社が定める方法により、あらかじめ当社にカスタマーバッファー利用上限額の変更を申告するものとする。

３　受託清算参加者は、カスタマーバッファーの利用を認める清算委託者について、日中証拠金の不足をカスタマーバッファー利用の対象に含める場合には、当社が定める方法により、あらかじめ当社にその旨を申告するものとする。

４　受託清算参加者は、当社が定める方法により、前項の申告を取り下げることができる。

（カスタマーバッファーの利用）

第８４条の７　清算委託者が、第５４条又は第５４条の２に規定するところにより有価証券等清算取次ぎの委託を行った場合において、債務負担時所要証拠金に足りる額が当社に預託又は交付されていないときであって、債務負担時所要証拠金不足額から新規債務負担時カスタマーバッファー利用可能額に当たる額を控除した額が、第４９条第１項第２号ｂに規定する上限額以下である

ときには、当社の定めるところにより、債務負担時所要証拠金不足額に当たる額（新規債務負担時カスタマーバッファー利用可能額が債務負担時所要証拠金不足額を下回る場合にあっては新規債務負担時カスタマーバッファー利用可能額に当たる額）のカスタマーバッファーが当該清算委託者に係る委託取引口座に自動的に充当され、当社は、当該充当されたカスタマーバッファーの額を預託額に含めて債務負担要件の充足を確認するものとする。

２　清算委託者の日中証拠金所要額に足りる額が当社に預託又は交付されていないときであって、当該不足額（以下本条において「日中証拠金不足額」という。）が日中証拠金算出時カスタマーバッファー利用可能額以下であるときには、当社の定めるところにより、日中証拠金不足額に当たる額のカスタマーバッファーが当該清算委託者に係る委託取引口座に自動的に充当され、日中証拠金の不足が解消するものとする。

３　前２項に規定するところにより委託取引口座に充当されたカスタマーバッファーについて、当社が定める時点の清算委託者の当初証拠金預託額と当該委託取引口座に充当されたカスタマーバッファーの合計額が、当該清算委託者の、充当されたカスタマーバッファーを考慮しない日中証拠金所要額又は債務負担時所要証拠金に相当する額として当社が定める額を上回る場合には、充当されたカスタマーバッファーのうち、当該超過額に当たる額（当該清算委託者の日中証拠金所要額又は債務負担時所要証拠金に相当する額として当社が定める額が、当該清算委託者の当初証拠金預託額を下回る場合には、当該委託取引口座に充当されたカスタマーバッファーの額）について、当該委託取引口座への充当を解消するものとする。

４　第１項及び第２項に定めるところにより委託取引口座に充当されたカスタマーバッファーは、当社営業日ごとに、当社が定める時点で、委託取引口座への充当を解消するものとする。

５　清算委託者は、前項の規定により委託取引口座へのカスタマーバッファーの充当が解消された場合、当初証拠金所要額の不足額を預託又は交付するまでの間は、第１項の規定にかかわらず、当該委託取引口座へのカスタマーバッファーの充当を受けることはできない。

第７章　資金決済等

（日本円による資金決済の方法）

第８５条　当社及び清算参加者の間の金銭（日本円に限る。以下本条から第８５条の３までにおいて同じ。）の授受のうち当社が定めるものについては、当社が定める方法により行う。

２　当社は、清算参加者との間で授受する金銭を、当社が定めるところにより、自己取引口座（当該清算参加者がカスタマーバッファーを預託している場合には、カスタマーバッファーを含む。）及び委託取引口座ごとに差引計算したうえで授受することができる。

（当初証拠金及び決済金額の差引計算）

第８５条の２　前条第２項の規定により差引計算した結果、清算参加者が当社に対して決済金額等（円貨建清算約定に係る決済金額、変動証拠金及び変動証拠金に係る利息を差引計算した後の額をいう。以下本条及び次条において同じ。）を支払うこととなる場合には、当該決済金額等の支

払い及び第６６条に規定する当初証拠金の預託については、自己取引口座及び委託取引口座ごとに、次に掲げる計算式の順序に従って差引計算するものとし、それぞれ算出された額が負の数になる場合には、清算参加者は当社に対し当該額を預託するものとする。ただし、第１号に係る預託については、金銭により預託しなければならない。

（１）　（当初証拠金預託額のうち金銭による預託額）－（清算参加者が支払うこととなる決済金額等）

（２）　（当初証拠金預託額－充当現金預託額（前号による差引計算の結果、清算参加者が支払うこととなる決済金額等に充当された当初証拠金預託額のうち金銭による預託額をいう。））－（当初証拠金所要額）

２　前条第２項の規定により差引計算した結果、清算参加者が当社から決済金額等を受領することとなる場合には、当該決済金額等の支払い及び第６６条に規定する当初証拠金の預託については、自己取引口座及び委託取引口座ごとに、次に掲げる計算式に従って差引計算するものとし、算出された額が負の数になる場合には、清算参加者は当社に対し当該額を預託するものとする。

（当初証拠金預託額＋清算参加者が受領することとなる決済金額等）－（当初証拠金所要額）

（返戻の申請及び当初証拠金のみなし預託）

第８５条の３　第８５条第２項の差引計算の結果、決済金額等を受領することとなる清算参加者は、当社に対し、自己取引口座及び委託取引口座ごとに受領する金銭の額を明らかにしたうえで申請を行うことにより、当該金銭を受領するものとする。

２　前項の申請がなされていない場合、自己取引口座又は委託取引口座ごとに算出された決済金額等は、当該口座に係る当初証拠金として預託されたものとみなす。

（外貨による資金決済の方法）

第８５条の４　第８５条の規定にかかわらず、当社及び清算参加者の間の金銭（日本円以外の金銭に限る。以下本条において同じ。）の授受のうち当社が定めるものについては、当社が定める方法により行う。

２　当社は、前項に規定する清算参加者との間の金銭の授受にあたって、外貨建清算約定の通貨ごとに、当社が定めるところにより、自己取引口座及び委託取引口座ごとに差引計算を行う。当社は、これにより算出した額を差引計算した額に相当する金銭を授受することができる。

３　当社と清算参加者の間の外貨建清算約定に係る決済金額（損益差金等を除く。）の授受に係る支払日時は、次の各号に掲げる外貨建清算約定ごとに、当該各号に定める時間とする。

（１）　豪ドル建清算約定　金利支払日のシドニーにおける午後６時

（２）　米ドル建清算約定　金利支払日のニューヨークにおける午後５時

（３）　ユーロ建清算約定　金利支払日のロンドンにおける午後４時４５分

４　清算参加者が、日本円以外の一の通貨に係る資金決済の単位として指定する自己取引口座又は委託取引口座（以下本項及び次項において「指定口座」という。）を当社所定の様式により当社に対してあらかじめ届け出た場合には、第２項後段の規定にかかわらず、当社は、外貨建清算約

定の通貨ごとに、各指定口座について第２項前段の規定により算出した額並びに指定口座でない自己取引口座及び各委託取引口座に係る第２項前段の規定により算出した額を差引計算した額に相当する金銭をそれぞれ授受することができる。

５　清算参加者は、前項に規定する届出について、複数の自己取引口座又は委託取引口座を一の指定口座として届け出ることができる。この場合において、当該届出が行われた複数の自己取引口座又は委託取引口座を一の指定口座とみなして、前項の規定を適用する。

６　清算参加者は、前２項に規定する届出の内容を変更しようとする場合には、その変更後の内容を、あらかじめ当社に対して届け出るものとする。

（外貨建清算約定に係る資金決済等未了の場合の取扱い）

第８５条の５　当社は、外貨建清算約定に係る変動証拠金及び変動証拠金の利息又は決済金額の預託又は支払いについて、清算参加者がその預託時限又は支払時限までに当社に対して預託又は支払いを完了していない場合において、当該清算参加者の信用状況及び当該預託又は支払いを完了していない事由の原因その他の事情を勘案して当社が適当と認めるときは、当該預託又は支払いの金額（以下「決済未了金額」という。）の預託時限又は支払時限を、当該預託又は支払いを完了しなかった日の後最初に到来する当社営業日かつ当該外貨建清算約定に係る外貨本国営業日である日（支払時限にあっては、当該預託又は支払いを完了しなかった日の後最初の当該外貨建清算約定に係る外貨本国営業日）における同一の時間に繰り延べる。

２　前項の場合において、当社は、当該預託又は支払いを行っていない清算参加者（以下「決済未了清算参加者」という。）に対し、当社の定めるところにより当初証拠金所要額を加算する。

３　清算参加者は、決済未了金額の預託時限又は支払時限の繰り延べを、みだりに発生させないよう最大限その防止に努めるものとする。

４　前各項のほか、第１項の規定により決済未了金額の預託時限又は支払時限の繰り延べを行った場合の取扱いに関し必要な事項は、当社が定める。

第８章　清算預託金

（清算預託金）

第８６条　当社が、清算参加者の当社に対する債務等を担保する目的で清算参加者から預託を受ける金利スワップ清算基金、当初証拠金、第三階層特別清算料担保金及び破綻時証拠金は、金融商品取引法第１５６条の１１に規定する清算預託金とする。

（清算預託金の管理及び運用）

第８７条　当社は、前条の清算預託金の全額を、清算預託金を預託した清算参加者又は清算委託者のために、当社が定める方法により分別して管理するものとする。

２　当社は、清算預託金を預託した清算参加者のために、当社の定めるところにより清算預託金を運用することができる。

３　前項の運用により生じた収益又は損失（運用に必要な費用及び手数料を含む。）については、当社に帰属するものとする。

４　当社は、第２項の運用により収益が生じた場合には、当社が定めるところにより、清算預託金について利息を付すことができる。

５　金銭により当社に金利スワップ清算基金、当初証拠金又は破綻時証拠金を預託している清算参加者及び清算委託者は、第２項の運用により生じた損失について、当社が定めるところにより按分した額を当社に支払うものとする。

６　前項に規定する清算参加者及び清算委託者が当社に支払うべき額は、当該清算参加者及び清算委託者が金銭により当社に預託している金利スワップ清算基金、当初証拠金及び破綻時証拠金から当社の定める方法に従って充当されるものとする。

（清算預託金等の目的外利用の禁止）

第８８条　当社は、本業務方法書等の定めるところにより清算預託金を管理又は運用（清算参加者に前条第４項の利息を支払うことを含む。）する場合及び本業務方法書等の定めるところにより清算預託金を清算参加者又は清算委託者に返還する場合を除き、清算預託金の利用、振替、振込み若しくは払出しを行い、又は清算預託金を第三者に譲渡し、若しくは第三者のために質権その他の担保権を設定するなどの処分行為をしてはならない。

第９章　清算参加者の決済不履行時の措置

第１節　決済不履行及び破綻等の認定

（決済不履行及び破綻等の場合における措置）

第８９条　当社は、清算参加者の決済不履行を認定した場合には、当社が必要と認める範囲において当社が必要と認める期間、当該清算参加者（以下「不履行清算参加者」という。）を当事者とする清算対象取引に基づく新たな債務負担の停止及び不履行清算参加者に対する金銭等の全部又は一部の引渡しの停止の措置を行う。

２　当社は、清算参加者の破綻等を認定した場合には、前項の規定にかかわらず、破綻清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づくすべての新たな債務負担の停止及び破綻清算参加者に対する金銭等の全部又は一部の引渡しの停止の措置を行うことができる。

３　当社は、前２項の規定により引渡しを停止した金銭等については、不履行清算参加者又は破綻清算参加者の当社に対する債務の弁済に充当することができる。

４　前項の規定により充当する金銭等が有価証券である場合は、当社が相当と認める方法、時期、価格等により換価処分したうえで換価処分に要した費用を控除した残額を充当することができる。

５　第３項の規定により充当する金銭等が日本円以外の通貨の金銭である場合は、日本円に換算したうえで、両替した際に要した費用を控除した残額を充当することができる。

（債務負担の停止の措置の通知）

第９０条　当社は、前条第１項又は第２項の規定に基づき、清算参加者を当事者とする清算対象取引に基づく新たな債務負担の停止の措置を行った場合は、直ちにその旨（当社が同条第２項の規定により清算参加者の破綻等を認定した場合には、その旨及びその破綻認定日）をすべての清算参加者に通知し、かつ公表する。

第２節　破綻清算参加者の清算約定の強制解約等

（清算約定の強制解約）

第９１条　破綻清算参加者を当事者とする清算約定（以下「破綻処理清算約定」という。）は、当社又は破綻清算参加者から別段の意思表示を要することなく、破綻認定日において当然に終了する。

２　前項の規定による破綻処理清算約定の終了に伴う期限前終了手数料の額は、当該破綻処理清算約定の終了に伴う当社のポジションの再構築のために生じ得る費用及び損失に相当する額として当社が規則で定めるところにより破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに算出する額とする。

３　当社は、破綻清算参加者に対し、前項の規定により算出された期限前終了手数料の額を通知する。

４　破綻清算参加者は、前項の規定により当社に支払うべき期限前終了手数料の額の通知を受けた場合には、当社に対して、直ちに当該期限前終了手数料を支払うものとする。

５　第１項の規定にかかわらず、破綻清算参加者の清算参加者口座にクロスマージン対象国債先物清算約定又はクロスマージン対象金利先物清算約定が記録されている場合には、破綻処理清算約定は、当社又は破綻清算参加者から別段の意思表示を要することなく、第８４条の５第１項の規定により当該破綻清算参加者と当社との間に債権債務が成立することをもって、これと同時に当然に終了する。

（金利スワップ破綻管理委員会）

第９２条　当社は、清算参加者の破綻等を認定した場合又は第８４条の５第１項の規定により債権債務が成立した場合における損失回避のための措置及び破綻処理入札の実施その他の当社が規則で定める事項（次項において「諮問事項」という。）に関し助言を受けることを目的として、金利スワップ破綻管理委員会を設置する。

２　当社は、諮問事項について金利スワップ破綻管理委員会に諮問し、その助言を尊重するものとする。

３　当社は、当社が規則で定めるところにより指定した清算参加者を、金利スワップ破綻管理委員会の委員に任命するものとする。この場合において、当社は、金利スワップ破綻管理委員会の委員に対し、守秘義務を負わせるものとする。

４　前各項に規定するほか、金利スワップ破綻管理委員会の権限、組織、委員の任期、運営方法その他の必要な事項は、当社が規則で定める。

（損失回避のための措置）

第９３条　当社は、破綻処理清算約定及び次条に定めるクロスマージン処分取引の構成、規模、金利スワップ取引の相場の状況その他の事由を勘案して必要と認める場合には、破綻処理清算約定の終了又はクロスマージン処分取引により、当社のポジションを再構築するまでに当社に生じ得る損失（業務方法書第８４条の５第１項の規定により債権債務が成立している場合は、当該債権債務から当社に生じ得る損失を含む。）の全部又は一部を回避するため、金利スワップ破綻管理委員会の助言に基づき、当社が規則で定めるところにより金利スワップ取引（以下「損失回避取引」という。）を行うことができる。

２　損失回避取引については、これを清算約定（担保型）とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。この場合において、損失回避取引について必要な事項は当社がその都度定める。

（クロスマージン処分取引の実施）

第９３条の２　当社は、第８４条の５第１項の規定により債権債務が成立した場合には、金利スワップ破綻管理委員会の助言に基づき、同条に規定するクロスマージン対象国債先物清算約定又はクロスマージン対象金利先物清算約定について、証券取引等業務方法書第７３条の１５の４第２項に規定する転売又は買戻しその他必要と認める整理を任意の国債先物等清算参加者をして行わせることができる。

２　当社は、前項のクロスマージン対象国債先物清算約定又はクロスマージン対象金利先物清算約定の規模や相場の状況その他の事由を勘案して、当該クロスマージン対象国債先物清算約定又はクロスマージン対象金利先物清算約定の決済により当社に生じ得る損失の全部又は一部を回避するため、金利スワップ破綻管理委員会の助言に基づき、前項の規定によるクロスマージン対象国債先物清算約定又はクロスマージン対象金利先物清算約定の決済に合わせて当社が規則で定めるところにより、金利スワップ取引（以下「クロスマージン処分取引」という。）を行うことができる。

３　クロスマージン処分取引については、これを清算約定（担保型）とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。この場合において、必要な事項は当社がその都度定める。

４　清算参加者について破綻等が認定された場合以外の事由により第８４条の５第１項の規定により債権債務が成立した場合において、当社がクロスマージン処分取引を行ったときには、当社は、クロスマージン処分取引の成立と同時に、同項に規定する清算参加者との間で、当該クロスマージン処分取引と同一内容であり当社の取引ポジションが反対である金利スワップ取引を成立させる。

５　第３項の規定は、前項の金利スワップ取引について準用する。

６　第４項のクロスマージン処分取引が、清算参加者の委託取引口座に記録されているクロスマージン対象国債先物清算約定又はクロスマージン対象金利先物清算約定を対象として行われた場

合であって、当該委託取引口座に係る清算委託者の清算委託取引が終了していないときには、第４項の金利スワップ取引は、当該清算委託者の当該清算参加者に対する有価証券等清算取次ぎの委託により成立した清算約定（委託分）と、当該金利スワップ取引に係る清算参加者と清算委託者との間の法律関係は、当該清算約定（委託分）に係る清算委託取引と、それぞれみなす。

７　第４項の規定により成立する金利スワップ取引に関して必要な事項は、当社が規則で定める。

（受託清算参加者破綻時における清算約定（委託分）等の承継）

第９４条　清算委託者（当社が規則で定める清算委託者のうち、清算受託契約に規定する期限の利益喪失事由が発生していない者に限る。以下本条、次条及び第９９条の２において同じ。）は、第９１条の規定により当該清算委託者の計算により成立した清算約定（委託分）が終了した場合には、当社が規則で定める期間内に限り、承継清算参加者を経由して当社に当社所定の承継申込書を交付することにより、当該清算約定（委託分）に対応する次に掲げる権利義務を一括して一又は二以上の承継清算参加者に承継させることができる。

（１）　破綻清算参加者及び当社の間の当該清算約定（委託分）に係る権利義務（第９１条の規定により清算約定（委託分）が終了する直前のもの）と当社が規則で定める条件が同一となる権利義務

（２）　破綻清算参加者及び当該清算委託者の間の清算委託取引に係る権利義務（第９１条の規定により清算約定（委託分）が終了する直前のもの）と当社が規則で定める条件が同一となる権利義務

２　承継清算参加者は、承継の当事者となる清算委託者と清算受託契約を締結していることを要する。

３　清算委託者は、第１項の規定により当社に対して同項の権利義務の承継の申込みをする場合には、あらかじめ、承継清算参加者に対して当該承継の申込みをし、その承諾を得なければならない。

４　承継清算参加者は、前項の承継の承諾をし、かつ当該承継に係る清算委託者から承継申込書の交付を受けた場合には、第１項の期間内に、当社に対して、当該承継申込書（承継清算参加者が当該承継の申込みを受けた旨及び当該承諾をした旨、当該清算委託者が当社に承継の申込みをする旨並びに承継清算参加者が当社に承継の申込みをする旨が記載されていることを要する。）を提出しなければならない。

５　当社は、前項の規定により行われた承継の申込みを受領した場合には、当該承継の申込みが行われた日において、第９１条の規定により終了した清算約定（委託分）のうち、清算委託者が承継を希望するもの（以下本条において「対象清算約定」という。）の承継が行われたと仮定して第６４条及び第６５条の規定に基づき当初証拠金を算出するとともに、当社が規則で定めるところにより承継時支払金額、未払債務（破綻清算参加者の破綻等が認定された時点で当社及び破綻清算参加者の間の弁済期が到来している債務並びに承継日に授受すべき日本円以外の通貨を想定元本及び決済通貨とする対象清算約定に係る固定金額、変動金額及びアップフロントフィーに関する債務を除く。以下本条において同じ。）、変動証拠金及び損益差金を算出することとし、当

該日の翌当社営業日の午前１１時までに当該承継清算参加者が当社に対して当該当初証拠金、承継時支払金額、未払債務、変動証拠金及び損益差金を預託又は交付したことを確認したときは、当社は当該承継の申込みを承諾することとする。

６　当社が前項の規定による承諾を行った場合、次に定めるところにより対象清算約定の決済及び承継が行われるものとする。

（１）　承継日に、当社、承継清算参加者及び当該承諾に係る清算委託者の間において、第１項各号の権利義務が発生する。

（２）　前号の規定により発生する権利義務は、当該承諾に係る清算委託者の承継清算参加者に対する有価証券等清算取次ぎの委託に基づき、承継清算参加者が当該清算委託者の計算により対象清算約定の終了時に遡及して成立させた清算約定（担保型）の清算約定（委託分）及びその清算委託取引に係る権利義務とみなす。

（３）　当社、承継清算参加者及び当該承諾に係る清算委託者は、第１号の規定による権利義務の発生に伴い、当社が規則で定めるところにより、承継時支払金額、未払債務、変動証拠金及び損益差金の授受を行う。

（４）　第７６条の規定により当該承諾に係る清算委託者が返還請求権を有する当初証拠金は、承継清算参加者を代理人として当社に預託された当初証拠金とみなす。

（５）　破綻清算参加者及び当該承諾に係る清算委託者の間の清算委託取引及び当該清算委託取引について授受された変動証拠金に係る権利義務（破綻清算参加者の破綻等が認定された時点で弁済期が到来している清算約定に係る破綻清算参加者の債務及び第８５条の５第１項に規定する決済未了金額に係る破綻清算参加者の債務を除く。）及び委託当初証拠金に係る権利義務（前号の規定により承継清算参加者を代理人として当社に預託されたものとみなされる部分に限る。）は、将来に向かって消滅する。

（６）　第９１条第２項の規定にかかわらず、当該対象清算約定の期限前終了手数料は、その終了の日における当該各清算約定の正味現在価値を基準として当社が規則で定めるところにより算出する。

７　前項の規定により成立した当社及び承継清算参加者間の権利義務については、これを清算約定（担保型）の清算約定（委託分）とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。

８　前各項に規定するほか、承継に関し必要な事項は、当社が規則で定める。

（クロスマージン承諾者破綻時における清算約定（委託分）等の承継）

第９４条の２　前条の規定にかかわらず、清算委託者は、クロスマージン承諾者の破綻等により第８４条の５第１項に規定する債権債務が成立した場合には、当社が規則で定める期間内に限り、承継清算参加者を経由して当社に当社所定の承継申込書を交付することにより、清算約定（委託分）に対応する次に掲げる権利義務を一括して一又は二以上の承継清算参加者に承継させることができる。

（１）　クロスマージン承諾者及び当社の間の当該清算約定（委託分）に係る権利義務（第８４条の５第１項の規定により債権債務が成立する直前のもの）と当社が規則で定める条件が同一

となる権利義務

（２）　クロスマージン承諾者及び当該清算委託者の間の清算委託取引に係る権利義務（第８４条の５第１項の規定により債権債務が成立する直前のもの）と当社が規則で定める条件が同一となる権利義務

２　前条第２項から第８項までの規定は、前項に規定する清算約定（委託分）及び清算委託取引に係る権利義務（「清算約定（委託分）等」という。以下本条及び次条において同じ。）の承継について準用する。この場合において、同条第５項中「当該承継の申込みが行われた日において」とあるのは「当該承継の申込みが行われた日の午後４時において」と、「当該日の翌当社営業日の午前１１時までに」とあるのは「当該日の午後４時までに」と読み替えるものとする。

３　前２項に規定するクロスマージン利用者による清算約定（委託分）等の承継は、クロスマージン利用者が国債先物等承継清算参加者（当該クロスマージン利用者が国債証券先物取引又は金利先物取引を国債先物等非清算参加者に委託している場合には、当該国債先物等非清算参加者を含む。）との間で国債先物等承継を行うことについて合意し、国債先物等承継清算参加者を経由して当社所定の国債先物等承継申込書を当社に届け出ていることを条件に行うことができる。

（クロスマージン承諾者破綻時等における国債先物清算約定等に係る権利義務及び金利先物等清算約定等に係る権利義務の国債先物等承継 ）

第９４条の３　クロスマージン利用者のうち第２条第１項第１３号の９ｂからｄまでに掲げる者は、第８４条の５第１項の規定により債権債務が成立した場合（当該クロスマージン利用者が、指定市場開設者が定める先物・オプション取引口座設定約諾書若しくはクロスマージン申請者との間で締結した国債先物等清算受託契約書の定めるところにより、当然に期限の利益を喪失したとき又は指定市場開設者から支払不能若しくは支払不能となるおそれがあると認められたことにより市場デリバティブ取引の有価証券等清算取次ぎの委託の停止の処置を受けたときを除く。）には、当社が規則で定める期間内に限り、国債先物等承継清算参加者を経由して当社に当社所定の国債先物等承継申込書を交付することにより、当該債権債務及び同条第２項に規定する法律関係に対応する次に掲げる権利義務につき一括して国債先物等承継清算参加者に国債先物等承継を行うことができる。

（１）　クロスマージン承諾者及び当社の間の第８４条の５第１項に規定する債権債務（同項の規定により当該債権債務が成立した時点のもの）と当社が規則で定める条件が同一となる権利義務

（２）　クロスマージン承諾者及び清算委託者の間の第８４条の５第２項に規定する法律関係（同条第１項の規定により債権債務が成立した時点のもの）と当社が規則で定める条件が同一となる権利義務

２　クロスマージン利用者は、前項の規定により当社に対して同項の権利義務につき国債先物等承継の申込みをする場合には、あらかじめ、国債先物等承継清算参加者に対して当該国債先物等承継の申込みをし、その承諾（当該クロスマージン利用者が国債証券先物取引又は金利先物取引を国債先物等非清算参加者に委託している場合には、当該国債先物等非清算参加者の合意を含む。）

を得なければならない。

3　国債先物等承継清算参加者は、前項の国債先物等承継の承諾をし、かつ当該国債先物等承継に係るクロスマージン利用者から国債先物等承継申込書の交付を受けた場合には、第１項の期間内に、当社に対して、当該国債先物等承継申込書（国債先物等承継清算参加者が当該国債先物等承継の申込みを受けた旨及び当該承諾をした旨（当該クロスマージン利用者が国債証券先物取引又は金利先物取引を国債先物等非清算参加者に委託している場合には、当該国債先物等非清算参加者が合意した旨を含む。）、当該クロスマージン利用者が当社に国債先物等承継の申込みをする旨並びに国債先物等承継清算参加者が当社に国債先物等承継の申込みをする旨が記載されていることを要する。）を提出しなければならない。

4　当社は、前項の規定により国債先物等承継の申込みを受領した場合であって、次の各号に掲げるときは、当該各号に定める内容を条件として、当該国債先物等承継の申込みを承諾することとする。

（１）　クロスマージン承諾者の破綻等により第８４条の５第１項に規定する債権債務が成立したとき

前条に規定する清算約定（委託分）等の承継が可能であること

（２）　クロスマージン承諾者の破綻等以外の理由により第８４条の５第１項に規定する債権債務が成立したとき

当社が当該国債先物等承継の申込みの行われた日の午後４時において当該国債先物等承継が行われたと仮定して第６４条及び第６５条の規定に基づき算出した当初証拠金の額を、当該日の午後４時までに当該クロスマージン承諾者が当社に対して預託したこと

5　当社が前項の規定による承諾を行った場合、次に定めるところによりクロスマージン対象国債先物清算約定及びクロスマージン対象金利先物清算約定の決済及び国債先物等承継が行われるものとする。

（１）　国債先物等承継日に、次のａからｃまでに掲げる場合には、当該ａからｃまでに定める者の間において第１項各号の権利義務が発生する。

ａ　クロスマージン利用者が第２条第１項第１３号の９ｂに掲げる者である場合

当社、国債先物等承継清算参加者及び当該国債先物等承継清算参加者に国債証券先物取引又は金利先物取引を委託する当該承諾に係る顧客

ｂ　クロスマージン利用者が第２条第１項第１３号の９ｃに掲げる者である場合

当社、国債先物等承継清算参加者及び当該国債先物等承継清算参加者に国債証券先物取引又は金利先物取引に係る有価証券等清算取次ぎを委託する当該承諾に係る国債先物等非清算参加者

ｃ　クロスマージン利用者が第２条第１項第１３号の９ｄに掲げる者である場合

当社、国債先物等承継清算参加者、当該国債先物等承継清算参加者に国債証券先物取引又は金利先物取引に係る有価証券等清算取次ぎを委託する国債先物等非清算参加者及び当該国債先物等非清算参加者に国債証券先物取引又は金利先物取引を委託する当該承諾に係る顧客

（２）　前号の規定により発生する権利義務は、次のａからｃまでに掲げるものとみなす。

ａ　前号ａに定める者の間においては、当該承諾に係る顧客の国債先物等承継清算参加者に対する国債証券先物取引又は金利先物取引の委託に基づき、当該国債先物等承継清算参加者が国債先物等承継の時点で成立させた国債先物清算約定及びその国債証券先物取引の委託に係る権利義務又は金利先物清算約定及びその金利先物取引の委託に係る権利義務

ｂ　前号ｂに定める者の間においては、当該承諾に係る国債先物等非清算参加者の国債先物等承継清算参加者に対する国債証券先物取引又は金利先物取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づき、当該国債先物等承継清算参加者が国債先物等承継の時点で成立させた国債先物清算約定及びその国債証券先物取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に係る権利義務又は金利先物清算約定及びその金利先物取引の委託に係る権利義務

ｃ　前号ｃに定める者の間においては、当該承諾に係る顧客の国債先物等非清算参加者に対する国債証券先物取引又は金利先物取引の委託及び当該国債先物等非清算参加者の国債先物等承継清算参加者に対する国債証券先物取引又は金利先物取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に基づき、当該国債先物等承継清算参加者が国債先物等承継の時点で成立させた国債先物清算約定、その国債証券先物取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に係る権利義務及び当該承諾に係る顧客の当該国債先物等非清算参加者に対する国債証券先物取引の委託に係る権利義務又は金利先物清算約定、その金利先物取引に係る有価証券等清算取次ぎの委託に係る権利義務及び当該承諾に係る顧客の当該国債先物等非清算参加者に対する金利先物取引の委託に係る権利義務

（３）　当該国債先物等承継は、第８４条の５第１項の規定により債権債務が成立した日の前営業日における清算値段又は清算数値（証券取引等業務方法書に定める清算値段又は清算数値をいう。）を約定値段として行われるものとする。

（４）　当社及びクロスマージン承諾者は、第１号の規定による権利義務の発生に伴い、当社が規則で定めるところにより、クロスマージン更新差金相当額（クロスマージン更新差金に相当する額をいう。以下同じ。）の授受を行う。

（５）　当社及びクロスマージン承諾者の間の第８４条の５第１項に規定する債権債務並びにクロスマージン承諾者及び清算委託者の間の同条第２項に規定する法律関係は、将来に向かって消滅する。

６　前項の規定により成立した当社及び国債先物等承継清算参加者の間の権利義務については、これを国債先物清算約定又は金利先物清算約定とみなして、証券取引等業務方法書等（証券取引等業務方法書及び証券取引等業務方法書に基づき定める規則をいう。）の規定を適用する。

７　前各項に規定するほか、国債先物等承継に関し必要な事項は、当社が規則で定める。

（破綻処理入札の実施）

第９５条　当社は、清算参加者の破綻等を認定した場合には、破綻処理清算約定の終了に伴う当社のポジションを再構築するため、破綻処理清算約定（第９４条及び第９４条の２の規定により承継清算参加者に承継された清算約定（委託分）を除く。）の終了、損失回避取引及びクロスマー

ジン処分取引により当社に生じ得る損失（業務方法書第８４条の５第１項の規定により債権債務が成立している場合は、当該債権債務から当社に生じ得る損失を含む。）の解消を目的とする金利スワップ取引を行うための入札（以下「破綻処理入札」という。）を実施することができる。

２　当社は、前項の破綻処理入札を、破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに行うものとする。

３　当社は、破綻処理入札の実施に先立ち、当社が規則で定めるところにより破綻処理入札の対象となる金利スワップ取引（以下「入札対象取引」という。）の内容その他の破綻処理入札の実施条件を定め、清算参加者に通知する。

４　清算参加者は、当社が規則で定めるところにより、破綻処理入札に参加する義務を負う。

５　前各項に規定するほか、破綻処理入札の手順、運営方法その他必要な事項は当社が規則で定める。

（破綻処理入札において損失を補填することができないおそれがある場合の対応）

第９５条の２　破綻処理入札が実施された場合において、当該破綻処理入札に係る入札対象取引を成立させたときに破綻清算参加者の破綻等により生じる損失（第１０２条第１項の規定により破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに算出される当社に生じ得る損失をいう。以下本条及び次条において同じ。）を、第１０３条から第１０６条までの規定に定めるところにより補填することができないおそれがあるときは、当社は、金利スワップ破綻管理委員会の助言に基づき、当該損失を補填することができないおそれがある通貨の種類の破綻処理清算約定について、破綻処理入札の再実施又は第９６条の規定に従った協議のいずれかを行うものとする。

２　前項の規定にかかわらず、破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに行われる破綻処理入札が同一の時間帯に実施された場合又は実施された破綻処理入札が破綻処理清算約定の終了に伴い実施される破綻処理入札のうち最後に行われたものであった場合において、当該破綻処理入札に係る入札対象取引を成立させたときに破綻清算参加者の破綻等により生じる損失を、第１０３条から第１０６条までの規定に定めるところにより補填することができないおそれがあるときには、当社及び清算参加者は、第９６条の規定に従い協議を行うものとする。

３　前条の規定は、第１項の規定により破綻処理入札の再実施を行う場合に準用する。

（損失を補填することができないおそれがある場合の協議）

第９６条　前条第１項及び第２項の規定に従い行われる協議は、当社及び破綻処理入札に参加する義務を負うすべての清算参加者が、入札対象取引を成立させた場合に破綻清算参加者の破綻等により生じる損失の処理に関し、規則で定めるところにより行うものとする。

２　前項の規定による協議の結果、同項の損失の処理について当社と当該破綻処理入札に参加する義務を負うすべての清算参加者の間において規則で定めるところにより合意が成立した場合には、当社は、当該合意の定めるところにより当該損失の処理を行う。この場合において、当該処理の内容は、当該損失の全部が補填され、かつ、当社による金利スワップ取引清算業務の継続が可能なものであることを要する。

（協議が不調となった場合における清算約定の強制終了）

第９７条　前条第１項の規定により協議が行われた場合において、当社が規則で定める期間内に同条第２項の合意が成立しないときは、当該期間が経過する日において存在する当該合意が成立しなかった破綻処理清算約定と同一の種類の通貨を想定元本及び決済通貨とするすべての清算約定は、当社又は清算参加者から別段の意思表示を要することなく、その経過時点において当然に終了する。

２　前項の規定による清算約定の終了に係る期限前終了手数料の額その他の必要な事項は、当社が規則で定める。

（協議に関する通知等）

第９８条　当社は、第９６条第２項の合意が成立し、又は前条第１項の規定により同項に規定する清算約定が終了した場合には、直ちにその旨をすべての清算参加者に通知し、かつ公表する。

（入札対象取引の成立等）

第９９条　清算参加者が破綻処理入札において入札対象取引を落札した場合には、当社が規則で定めるところにより、当社及び当該清算参加者の間において、当該落札に係る入札対象取引が成立するものとする。

２　当社及び前項の清算参加者は、同項の規定による入札対象取引の成立に伴い、当社が規則で定めるところにより、当社が規則で定める金銭、変動証拠金及び損益差金の授受を行う。

３　第１項の規定により成立した入札対象取引については、これを清算約定（担保型）とみなして、本業務方法書等の規定を適用する。

４　前２項に規定するほか、入札対象取引が成立した場合の手続については、当社が規則で定める。

（破綻時の委託分利益の受取り）

第９９条の２　清算委託者は、第９１条の規定により当該清算委託者の計算により成立した清算約定（委託分）が終了した場合において、第９４条から第９４条の３までの規定による承継が行われなかったときは、清算約定（委託分）に関し破綻認定日以降に当該清算委託者が受領すべき利益相当額として当社が規則で定める額の金銭について、当社に対する支払請求権を有するものとし、当社が規則で定めるところにより、当該支払請求権を行使することができるものとする。

２　前項に規定する額の金銭については、当社によるその支払いの前後にかかわらず、破綻清算参加者は、当社に対し、これを補償する義務を負うものとする。

第３節　破綻清算参加者の債務に係る差引計算及び担保の充当等

（破綻処理に関する負担）

第１００条　破綻清算参加者は、破綻処理清算約定の終了に伴う期限前終了手数料の支払義務を負

うほか、第９５条及び第９９条の規定による破綻処理入札及び入札対象取引の成立その他破綻処理清算約定及び第８４条の５第１項の規定により成立した債権債務に係る処理に関し、当社が損失を被り、又は費用若しくは債務を負担した場合には、当該損失又は費用若しくは債務に相当する金銭を補償する義務を負うものとする。

（破綻処理清算約定等の決済の方法）

第１０１条　本業務方法書の他の規定にかかわらず、破綻処理清算約定の終了に伴って破綻清算参加者が当社に対して負担する第１号の債務（以下「未決済債務」という。）については、未決済債務並びに未決済債務と差引計算すべき当社の債務及び未決済債務に充当すべき担保の額がいずれも確定した日において、第２号に定めるところにより、破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに差引計算及び担保の充当を行う。

（１）　未決済債務

ａ　破綻処理清算約定の終了に伴い、当該破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに破綻清算参加者が当社に支払うべき期限前終了手数料の支払債務

ｂ　当社が破綻処理清算約定に関し破綻清算参加者に預託済みの変動証拠金の返還債務及び当該変動証拠金に係る利息の支払債務（日本円以外の通貨を想定元本及び決済通貨とする破綻処理清算約定に係る変動証拠金及びその利息にあっては、当社が規則で定めるところにより日本円に換算する。次号において同じ。）

ｃ　破綻清算参加者の破綻等が認定された時点で弁済期が到来している清算約定に係る破綻清算参加者の当該清算約定に係る通貨の種類ごとの未履行債務（日本円以外の通貨を想定元本及び決済通貨とする破綻処理清算約定に係る未履行債務にあっては、当社が規則で定めるところにより日本円に換算する。次号において同じ。）

ｄ　第９９条の２第２項の規定により破綻清算参加者が負担する破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとの支払債務（日本円以外の通貨を想定元本及び決済通貨とする破綻処理清算約定に係る支払債務にあっては、当社が規則で定めるところにより日本円に換算する。）

ｅ　前条の規定により破綻清算参加者が負担する破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとの支払債務（日本円を想定元本及び決済通貨とする破綻処理清算約定に係る支払債務にあっては、第８４条の５第１項の規定により成立した債権債務に係る支払債務を含む。）（日本円以外の通貨を想定元本及び決済通貨とする破綻処理清算約定に係る支払債務にあっては、当社が規則で定めるところにより日本円に換算する。次号において同じ。）

（２）　破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに行う差引計算及び担保の充当の方法

ａ　破綻処理清算約定の終了に伴って生じる破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとの当社の期限前終了手数料の支払債務（破綻清算参加者の清算参加者口座にクロスマージン対象国債先物清算約定又はクロスマージン対象金利先物清算約定が記録されている場合にあっては、日本円建ての破綻処理清算約定について生じる当社の期限前終了手数料の支払債務に第８４条の５第１項の規定により成立した債権債務に関する当社の支払債務を含むものとする。）と破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとの未決済債務を差引計算し、前号に掲げる

未決済債務を破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに合計した額（以下「破綻清算参加者支払額」という。）から当該期限前終了手数料の額を控除する。

b　破綻清算参加者が破綻処理清算約定に関し当社に預託済みの変動証拠金を破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとの未決済債務に充当し、上記ａの控除を行った残額からその充当額を控除する。

c　第８９条第２項の規定により破綻清算参加者に対する引渡しを停止した金銭等（有価証券については、当社による換価処分後の金銭から当該換価処分に要した費用を控除した残額とし、日本円以外の通貨の金銭については、当社が規則で定めるところにより日本円に換算した額から両替した際に要した費用を控除した残額とする。）を破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとの未決済債務に充当し、上記ｂの控除を行った残額からその充当額を控除する。

d　破綻処理清算約定に係る当初証拠金（当初証拠金が代用有価証券である場合には、その換価処分後の金銭から当該換価処分に要した費用を控除した残額）（第７６条の規定により清算委託者が返還請求権を有する部分を除く。）について当社が規則で定めるところにより当該通貨の種類ごとに按分した額を当該通貨の種類ごとの未決済債務に充当し、上記ｃの控除を行った残額からその充当額を控除する。

e　破綻清算参加者から預託を受けた金利スワップ清算基金及び破綻時証拠金（金利スワップ清算基金又は破綻時証拠金が代用有価証券である場合には、その換価処分後の金銭から当該換価処分に要した費用を控除した残額）について当社が規則で定めるところにより破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに按分した額を当該通貨の種類ごとの未決済債務に充当し、上記ｄの控除を行った残額からその充当額を控除する。

f　破綻清算参加者から預託を受けた他の清算業務に係る余剰担保（破綻清算参加者が他の清算業務について当社に預託した取引証拠金、清算基金その他の担保（破綻清算参加者が返還請求権を有するものに限る。）のうち、他の清算業務に係る業務方法書の定めるところにより破綻清算参加者の債務の弁済に充当した残額に係るものをいう。）（当該余剰担保が有価証券である場合には、その換価処分後の金銭から当該換価処分に要した費用を控除した残額）について当社が規則で定めるところにより破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに按分した額を当該通貨の種類ごとの未決済債務に充当し、上記ｅの控除を行った残額からその充当額を控除する。

２　前項の規定による破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに行う差引計算及び担保の充当の結果、当該破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとの破綻清算参加者支払額がなお残存する場合には、本業務方法書の他の規定にかかわらず、その残存額を合計した額をもってすべての破綻処理清算約定の終了に伴う当社の破綻清算参加者に対する一の債権とする。

第４節　他の清算参加者による損失の負担

（破綻処理損失の算出）

第１０２条　当社は、当社が規則で定める日（以下「当初損失確定日」という。）において、前条

第１項第２号の規定による差引計算及び担保の充当の後、再配分当初証拠金等（次条に規定するものをいう。）を当該差引計算等の結果得られた残額から更に控除することで、当社に生じ得る損失の有無及びその額を算出する。

２　前項の場合において、額の確定していない債権債務又は担保があるときは、当社は、債権債務又は担保の額と見込まれる額として当社が暫定的に定める額を当該債権債務又は担保の額とみなして、同項の規定による算出を行う。

（異なる通貨に係る破綻処理清算約定への担保等の配分）

第１０２条の２　破綻処理清算約定に係る通貨の種類が複数ある場合において、一の通貨に係る破綻処理清算約定について前条第１項の規定による損失の算出を行った結果、当該算出結果が負の数になったときは、当該負の数の絶対値を当社が規則で定めるところにより按分した金額を、他の通貨に係る破綻処理清算約定（前条第１項の規定による損失の算出を行っている通貨の破綻処理清算約定及び第９７条第１項の規定により終了した清算約定に係る通貨の破綻処理清算約定を除く。）に関する破綻処理損失と差引計算を行う再配分当初証拠金等として配分する。

（金利スワップ決済保証準備金等による損失の補填）

第１０３条　第１０２条の規定による算出の結果、当社に損失が生じ得る場合には、当社は、当初損失確定日において、当該損失の額に対応する当該破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに算出した当社の損失（当社が規則で定めるものを除く。）及び破綻清算参加者の破綻処理（当該破綻清算参加者の破綻等に伴う破綻処理入札の実施その他の必要な処理をいう。以下同じ。）について当初損失確定日までに当社に生じた破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとのその他の損失（当社が規則で定めるものに限る。）（以下「破綻処理損失」という。）を、次の各号に掲げる順序に従い、当該各号に定める方法により破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに補填する。

（１）　第一階層金利スワップ決済保証準備金を当社が規則で定めるところにより破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに按分した額の取崩し

（１）の２　次条第１項の規定により破綻処理損失を補填するために配分される再配分第一階層金利スワップ決済保証準備金の取崩し

（２）　破綻清算参加者以外の各清算参加者が当社に預託した金利スワップ清算基金（当該各清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額（同一の破綻処理単位期間において認定された他の破綻等について生じた当社の損失を補填するために、本条の規定により当該各清算参加者が当社に預託した金利スワップ清算基金から取り崩された額があるときは、当該額を控除した残額とする。以下本条において同じ。）を当社が規則で定めるところにより破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに按分した額を上限とする。）及び第二階層金利スワップ決済保証準備金を当社が規則で定めるところにより破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに按分した額の取崩し

（３）　次条第２項の規定により破綻処理損失を補填するために配分される再配分金利スワップ清算基金（当該配分された通貨の種類の破綻処理清算約定に係る破綻処理入札に参加する義務

を負う清算参加者が預託した金利スワップ清算基金に限る。）及び再配分第二階層金利スワップ決済保証準備金の取崩し

（４）　次条第２項の規定により破綻処理損失を補填するために配分される再配分金利スワップ清算基金（当該配分された通貨の種類の破綻処理清算約定に係る破綻処理入札に参加する義務を負わない清算参加者が預託した金利スワップ清算基金に限る。）の取崩し

２　前項第１号及び第１号の２の方法による補填後の破綻処理損失の全部が同項第２号の方法により補填される場合、破綻清算参加者以外の各清算参加者が当社に預託した金利スワップ清算基金及び第二階層金利スワップ決済保証準備金から取崩しをする額は、次に定めるとおりとする。

（１）　破綻清算参加者以外の各清算参加者が当社に預託した前項第２号に定めるところにより破綻処理清算約定の通貨の種類ごとに按分された金利スワップ清算基金から取崩しをする額の総額（以下本項において「第二階層清算参加者負担総額」という。）及び同号に定めるところにより破綻処理清算約定の通貨の種類ごとに按分された第二階層金利スワップ決済保証準備金から取崩しをする額は、当該破綻処理損失の額を、破綻清算参加者以外の各清算参加者の当該破綻処理清算約定の通貨に係る第二階層清算参加者負担限度額の総額及び当該按分された第二階層金利スワップ決済保証準備金の額に応じて按分した額とする。

（２）　破綻清算参加者以外の各清算参加者（当該破綻処理入札に参加する義務を負う清算参加者に限る。以下本号において同じ。）が当社に預託した金利スワップ清算基金のうち前項第２号に定めるところにより按分された金利スワップ清算基金から取崩しをする額は、次のａからｄまでに掲げる金利スワップ清算基金の順序に従い、当該ａからｄまでに定める額とする。

ａ　当該破綻処理入札に参加しなかった清算参加者又は当該破綻清算参加者に係る破綻認定日の属する破綻処理単位期間中に実施された他の破綻処理入札であって、参加する義務のあるもの（当該破綻処理入札までに実施されたものに限る。）のうちのいずれかに参加しなかった清算参加者（これらの他の破綻処理入札のいずれかにおいて入札対象取引を落札し、かつその後に実施されたすべての破綻処理入札に参加している清算参加者を除く。以下このａにおいて「対象清算参加者」という。）が当社に預託した金利スワップ清算基金　第二階層清算参加者負担総額を各対象清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額に応じて按分した額（第二階層清算参加者負担総額が対象清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額の総額以上である場合には、各対象清算参加者の当該第二階層清算参加者負担限度額）

ｂ　当該破綻処理入札に相場から著しく乖離した価格として当社が規則で定める価格（以下本ｂ及び第４項第２号において「乖離価格」という。）による入札を行った清算参加者又は当該破綻清算参加者に係る破綻認定日の属する破綻処理単位期間中に実施された他の破綻処理入札であって、参加する義務のあるもの（当該破綻処理入札までに実施されたものに限る。）のうちのいずれかにおいて、乖離価格による入札を行った清算参加者（これらの他の破綻処理入札のいずれかにおいて入札対象取引を落札し、かつその後に実施されたすべての破綻処理入札において乖離価格による入札を行っていない清算参加者及び上記ａに掲げる清算参加者を除く。以下このｂにおいて「対象清算参加者」という。）が当社に預託した金利スワップ清算基金　第二階層清算参加者負担総額から上記ａに定める取崩し額の総額を

控除した残額を各対象清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額に応じて按分した額（当該残額が対象清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額の総額以上である場合には、各対象清算参加者の当該第二階層清算参加者負担限度額）

ｃ　当該各清算参加者（ａ、ｂ及びｄに掲げる清算参加者を除く。）が当社に預託した金利スワップ清算基金　第二階層清算参加者負担総額から上記ａ及びｂに定める取崩し額の総額を控除した残額を当該各清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額に応じて按分した額（当該残額が当該各清算参加者の第二階層清算参加者負担限度額の総額以上である場合には、当該各清算参加者の当該第二階層清算参加者負担限度額）

ｄ　当該破綻処理入札において入札対象取引を落札した清算参加者（当該破綻清算参加者に係る破綻認定日の属する破綻処理単位期間中に実施された他の破綻処理入札（当該破綻処理入札までに実施されたものに限る。）のうち、直近に実施された破綻処理入札において、上記ａ又はｂの適用を受けていた清算参加者及び金利スワップ清算基金の取崩しを受けていたとすれば上記ａ又はｂの適用を受けていた清算参加者を除く。）が当社に預託した金利スワップ清算基金　第二階層清算参加者負担総額から上記ａからｃまでに定める取崩し額の総額を控除した残額

３　第１項第１号から第２号までの方法による補填後の破綻処理損失の残額の全部が同項第３号の方法により補填される場合、同号の規定により再配分金利スワップ清算基金及び再配分第二階層金利スワップ決済保証準備金から取崩しをする額は、次に定めるとおりとする。

（１）　破綻清算参加者以外の各清算参加者が当社に預託した再配分金利スワップ清算基金及び再配分第二階層金利スワップ決済保証準備金から取崩しをする額は、当該破綻処理損失の残額を、第１項第３号及び第４号の再配分金利スワップ清算基金の合計額と再配分第二階層金利スワップ決済保証準備金の額に応じて按分した額とする。

（２）　前項第２号の規定は、破綻清算参加者以外の各清算参加者（当該破綻処理入札に参加する義務を負う清算参加者に限る。以下本号において同じ。）が当社に預託している金利スワップ清算基金のうち、第１項第３号の再配分金利スワップ清算基金から取崩しをする場合に準用する。この場合において、前項第２号中「金利スワップ清算基金」及び「第二階層清算参加者負担限度額」とあるのは「再配分金利スワップ清算基金の額」と、「第二階層清算参加者負担総額」とあるのは「当該破綻処理損失の残額」と読み替えるものとする。

４　第１項第１号から第３号までの方法による補填後の破綻処理損失の全部が同項第４号の方法により補填される場合、同号の規定により再配分金利スワップ清算基金から取崩しをする額は、次の各号に掲げる再配分金利スワップ清算基金の順序に従い、当該各号に定める額とする。

（１）　当該破綻処理入札に参加しなかった清算参加者（当該破綻処理入札に参加する義務を負わない清算参加者に限る。以下本号において「対象清算参加者」という。）が当社に預託した再配分金利スワップ清算基金　当該破綻処理損失の残額を各対象清算参加者の再配分金利スワップ清算基金負担限度額（第１項第４号の規定により取り崩される再配分金利スワップ清算基金をいい、同一の破綻処理単位期間において認定された他の破綻等について生じた当社の損失を補填するために、本条の規定により当該各清算参加者が当社に預託した金利スワップ清算

基金から取り崩された額があるときは、当該額を控除した後の残額とする。以下本項において同じ。）に応じて按分した額（当該破綻処理損失の総額が各対象清算参加者の再配分金利スワップ清算基金負担限度額以上である場合には、各対象清算参加者の再配分金利スワップ清算基金負担限度額）

（２）　当該破綻処理入札に乖離価格による入札を行った清算参加者（当該破綻処理入札に参加する義務を負わない清算参加者に限る。以下本号において「対象清算参加者」という。）が当社に預託した再配分金利スワップ清算基金　当該破綻処理損失の残額から前号に定める取崩し額の総額を控除した残額を各対象清算参加者の再配分金利スワップ清算基金負担限度額に応じて按分した額（当該残額が対象清算参加者の当該再配分金利スワップ清算基金負担限度額の総額以上である場合には、各対象清算参加者の再配分金利スワップ清算基金負担限度額）

（３）　当該各清算参加者（当該破綻処理入札に参加する義務を負わない清算参加者であって、前２号及び次号に掲げる清算参加者を除く。）が当社に預託した再配分金利スワップ清算基金　当該破綻処理損失の残額から前２号に定める取崩し額の総額を控除した残額を各対象清算参加者の再配分金利スワップ清算基金負担限度額に応じて按分した額（当該残額が当該各清算参加者の再配分金利スワップ清算基金負担限度額の総額以上である場合には、当該各清算参加者の再配分金利スワップ清算基金負担限度額）

（４）　当該破綻処理入札において入札対象取引を落札した清算参加者（当該破綻処理入札に参加する義務を負わない清算参加者に限る。）が当社に預託した再配分金利スワップ清算基金　当該破綻処理損失の残額から第１号から前号までに定める取崩し額の総額を控除した残額

５　各清算参加者（破綻清算参加者を除く。以下本項において同じ。）は、前３項の規定により自己が当社に預託した金利スワップ清算基金（第１項第３号及び第４号の規定により再配分金利スワップ清算基金を含む。以下本項において同じ。）から取り崩されるべき金額を当社に支払う義務を負うものとし、前各項の規定による金利スワップ清算基金の取崩しは、当初損失確定日において、当社及び各清算参加者から別段の意思表示を要することなく、当然に、当該義務に対応する当社の債権と、当該義務を負う清算参加者が当社に対して有する金利スワップ清算基金の返還請求権とを対当額で相殺する方法により行う。

６　特定承継金融機関等である清算参加者が当社に預託した金利スワップ清算基金は、第２項第２号ｃに定める金利スワップ清算基金として同号の順序に従って取り崩されるものとする。

７　第９条第１項第３号ｂの委託を行っている清算参加者に係る第２項第２号及び第４項各号（第３項の規定により準用する場合を含む。）の規定の適用は、次に定めるところによる。

（１）　破綻処理入札への参加

当該清算参加者から委託を受けた者が、破綻処理入札において当該委託に係る入札を行ったことをいう。

（２）　入札対象取引の落札

当該清算参加者から委託を受けた者が、破綻処理入札において当該委託に係る入札により入札対象取引を落札したことをいう。

（３）　破綻処理入札において相場から著しく乖離した価格として当社が規則で定める価格によ

る入札

当該清算参加者から委託を受けた者が、破綻処理入札において第２項第２号ｂ又は第４項第２号に規定する価格により当該委託に係る入札を行ったことをいう。

（異なる通貨に係る破綻処理清算約定の金利スワップ決済保証準備金等の配分）

第１０３条の２　破綻処理清算約定に係る通貨の種類が複数ある場合において、一の通貨に係る破綻処理清算約定について前条第１項第１号の規定による第一階層金利スワップ決済保証準備金の取崩しを行った結果、破綻処理損失の残額が生じなかったときは、当該第一階層金利スワップ決済保証準備金の取崩し後の残額を当社が規則で定めるところにより按分した金額を、他の通貨に係る破綻処理清算約定（第１０２条第１項の規定による損失の算出を行っている通貨の破綻処理清算約定及び第９７条第１項の規定により終了した清算約定に係る通貨の破綻処理清算約定を除く。）に関する破綻処理損失のために取崩しをする前条第１項第１号の２に定める再配分第一階層金利スワップ決済保証準備金として配分する。

２　破綻処理清算約定に係る通貨の種類が複数ある場合において、一の通貨に係る破綻処理清算約定について前条第１項第２号の規定による金利スワップ清算基金及び第二階層金利スワップ決済保証準備金の取り崩しを行った結果、破綻処理損失の残額が生じなかったときは、当該金利スワップ清算基金及び第二階層金利スワップ決済保証準備金の取崩し後の残額を当社が規則で定めるところにより按分した金額を、他の通貨に係る破綻処理清算約定（第１０２条第１項の規定による損失の算出を行っている通貨の破綻処理清算約定及び第９７条第１項の規定により終了した清算約定に係る通貨の破綻処理清算約定を除く。）に関する破綻処理損失のために取崩しをする前条第１項第３号及び第４号に定める再配分金利スワップ清算基金及び再配分第二階層金利スワップ決済保証準備金として配分する。

（破綻処理単位期間における金利スワップ清算基金に関する特則）

第１０４条　破綻処理単位期間における各清算参加者の金利スワップ清算基金所要額は、第１７条第２項の規定による規則の定めにかかわらず、当該破綻処理単位期間の開始日の前当社営業日における当該各清算参加者の金利スワップ清算基金所要額とする。

２　破綻処理単位期間において第１０３条第１項第２号から第４号の規定により金利スワップ清算基金の全部又は一部が取り崩された場合、第１７条第２項の規定にかかわらず、当該破綻処理単位期間が終了するまでの間、清算参加者は、当該取崩しに対応する額の金利スワップ清算基金の追加預託義務を負わない。

３　第１項の規定にかかわらず、破綻処理単位期間の終了日における各清算参加者の金利スワップ清算基金所要額は、当該破綻処理単位期間の終了日において算出した当該各清算参加者の金利スワップ清算基金所要額とし、第１７条第２項の規定による規則の定めにより新たに金利スワップ清算基金所要額を算出する日の前日まで適用する。この場合において、破綻処理単位期間の終了日において各清算参加者が当社に預託している金利スワップ清算基金及び破綻時証拠金の額が、破綻処理単位期間の終了日における金利スワップ清算基金所要額に満たない場合には、当該各清

算参加者は、不足額以上の金利スワップ清算基金を、破綻処理単位期間の終了日の翌当社営業日の午後２時までに、当社に追加預託しなければならない。

（第三階層特別清算料による損失の補填）

第１０５条　破綻処理損失について、第１０３条に定めるところによってもなお補填することができない損失がある場合には、破綻認定日における破綻清算参加者以外の清算参加者（以下「第三階層特別清算料負担参加者」という。）は、当社が規則で定めるところにより、第三階層特別清算料を当社に支払う義務を負う。この場合において、当社は、第三階層特別清算料負担参加者から支払いを受けた第三階層特別清算料をもって、当該損失を補填する。

２　前項の第三階層特別清算料の額は、第三階層特別清算料負担参加者ごとに、破綻認定日の属する破綻処理単位期間の開始日の前当社営業日における当該第三階層特別清算料負担参加者に係る金利スワップ清算基金所要額を当社が規則で定めるところにより破綻処理清算約定の通貨の種類ごとに按分した額を上限として当社が規則で定める額とする。

（異なる通貨に係る破綻処理清算約定の第三階層特別清算料の配分）

第１０５条の２　破綻処理清算約定に係る通貨の種類が複数ある場合において、一の通貨に係る破綻処理清算約定について前条第１項の規定による第三階層特別清算料による補填を行ったときに破綻処理損失の残額が生じなかったときは、当該第三階層特別清算料の残額を当社が規則で定めるところにより按分した金額を、他の通貨に係る破綻処理清算約定（第１０２条第１項の規定による損失の算出を行っている通貨の破綻処理清算約定及び第９７条第１項の規定により終了した清算約定に係る通貨の破綻処理清算約定を除く。）に関する破綻処理損失のために取崩しをする再配分第三階層特別清算料として配分する。

（第四階層特別清算料による損失の補填）

第１０６条　破綻処理損失について、第１０５条に定めるところによってもなお補填することができない損失（当社が規則で定めるものを除く。）がある場合には、破綻認定日における破綻清算参加者以外の清算参加者のうち、破綻認定日から当初損失確定日までの当該破綻処理損失に係る破綻処理清算約定と同一の通貨の種類である通貨のすべての清算約定（破綻認定日後に成立した清算約定及び当初損失確定日までに終了した清算約定を含む。以下同じ。）に係る変動証拠金等の受け取るべき額の総額が支払うべき額の総額を上回る者（以下本条において「第四階層特別清算料負担参加者」という。）は、当社が規則で定めるところにより、当該破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとに第四階層特別清算料を当社に支払う義務を負う。この場合において、当社は、第四階層特別清算料負担参加者から支払いを受けた第四階層特別清算料をもって、当該損失を補填する。

２　前項の破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとの第四階層特別清算料の額は、通貨の種類ごとの破綻処理清算約定等に係る損失相当額（破綻認定日（当該破綻認定日に当社と破綻清算参加者との間で当該通貨の破綻処理清算約定に係る決済が終了している場合には、当該破綻認定日の翌

当社営業日。以下本項について同じ。）から当初損失確定日までの各当社営業日において、当該通貨の種類ごとの破綻処理清算約定について当社が破綻清算参加者から受領できなかった変動証拠金等の総額並びに第９３条第２項の規定により清算約定とみなされた当該通貨の種類ごとの損失回避取引及びクロスマージン処分取引について、当社が清算参加者に支払うべき変動証拠金等の総額から当社が当該清算参加者から受け取るべき変動証拠金等の総額を控除した額を合計した額が正数である場合の当該額をいう。）を、各第四階層特別清算料負担参加者に係る利益相当額（破綻認定日から当初損失確定日までの間に、各第四階層特別清算料負担参加者を当事者とする当該通貨の種類ごとのすべての清算約定に係る変動証拠金等の総受取額から総支払額を控除した額が正数である場合の当該額をいう。）で按分した額を上限として当社が規則で定める額とする。

３　当社は、第１項に規定する第１０５条に定めるところによってもなお補填することができない損失から除かれるものを、証券取引等業務方法書が定めるところにより補填する。

（特別清算料担保金の預託）

第１０７条　清算参加者は、次の各号に掲げる特別清算料担保金の区分に応じて、当該各号に掲げる債務（第３項において「被担保債務」という。）を担保する目的で、当社が規則で定めるところにより、特別清算料担保金を当社に預託しなければならない。

（１）　第三階層特別清算料担保金

第三階層特別清算料の支払債務

（２）　第四階層特別清算料担保金

第四階層特別清算料の支払債務

２　第四階層特別清算料担保金には利息を付さない。

３　当社は、本業務方法書等の定めるところにより、特別清算料担保金を被担保債務の弁済に充当することができる。

４　第三階層特別清算料担保金の預託は、担保目的の消費寄託とし、第四階層特別清算料担保金の預託は、担保目的の無償の消費寄託とする。

５　清算参加者は、民法及び商法の規定にかかわらず、本業務方法書等で定める場合に限り、特別清算料担保金の返還その他の請求をすることができる。

（破綻時証拠金の預託）

第１０８条　清算参加者（破綻清算参加者を除く。以下本条において同じ。）は、当該清算参加者が清算約定に関して当社に対して負担する債務（当該清算約定の終了に伴って生じる債務を含む。）を担保する目的で、破綻時証拠金を当社に預託しなければならない。

２　破綻時証拠金の預託を受けた当社は、本業務方法書等の定めるところにより、破綻時証拠金（金銭を異なる通貨へ両替した際に要した費用及び代用有価証券の換価処分に要した費用を控除した残額。以下本項において同じ。）を被担保債務の弁済に充当し、又は破綻時証拠金の返還請求権と被担保債務に係る債権とを対当額で相殺することができる。

３　清算参加者の破綻時証拠金所要額は、当社が規則で定める。

４　当社は、算出した破綻時証拠金所要額を、当社が規則で定めるところにより清算参加者に通知する。

５　清算参加者は、破綻時証拠金として当社に預託した金銭及び代用有価証券の代用価格の合計額が、当社に預託すべき破綻時証拠金所要額に不足する場合には、その不足が生じた日の翌当社営業日の午前１１時までに、その不足額を当社に預託しなければならない。

６　破綻処理単位期間が終了した時点において、清算参加者が当社に現に預託している破綻時証拠金があるときは、当該時点をもって、当該破綻時証拠金の全額が当該清算参加者に返還されたものとみなされるとともに、当該破綻時証拠金と同額の金利スワップ清算基金が当該清算参加者から当社に預託されたものとみなされるものとする。

７　第１７条第３項、第６１条第３項、第６２条及び第７１条の規定は、破綻時証拠金について準用する。

（特別清算料担保金の未払い）

第１０９条　清算参加者が、第１０７条第１項の規定による特別清算料担保金の預託をしない場合には、当該清算参加者について破綻等が認定されたものとみなして、本章の規定を適用する。

（最終損失確定時の調整）

第１１０条　第１０１条第２項の規定による当社の破綻清算参加者に対する債権の額が確定した場合において、当該債権の額が破綻処理損失の額の合計額を上回るときは、当社は、当該債権の額が確定した日において、その超過額に対応する当社の損失を、当該損失に係る通貨の種類の破綻処理清算約定ごとに、次の各号に掲げる順序に従い、当該各号に掲げる方法により補填する。

（１）　第１０３条第１項第１号の規定により通貨の種類ごとに按分された第一階層金利スワップ決済保証準備金の取崩し

（２）　第１０３条第１項第２号の規定により通貨の種類ごとに按分された破綻清算参加者以外の各清算参加者が当社に預託した金利スワップ清算基金（本項柱書の破綻清算参加者に係る破綻認定日の属する破綻処理単位期間の開始日の前当社営業日における当該各清算参加者の金利スワップ清算基金所要額から第１０３条の規定により取り崩された額を控除した残額を上限とする。）及び同号の規定により通貨の種類ごとに按分された第二階層金利スワップ決済保証準備金の取崩し

（３）　第三階層特別清算料負担参加者から支払われるべき第三階層特別清算料（当該債権の額を破綻処理損失とみなして第１０５条第２項の規定により算出する第三階層特別清算料の額から同条第１項の規定に基づき既に支払われた第三階層特別清算料の額を控除した残額を上限とする。）

（４）　第四階層特別清算料負担参加者から支払われるべき第四階層特別清算料（当該債権の額を破綻処理損失とみなして第１０６条第２項の規定により算出する第四階層特別清算料の額から同条第１項の規定に基づき既に支払われた第四階層特別清算料の額を控除した残額を上

限とする。）

２　前項の規定による補填に関し必要な事項は、当社が規則で定める。

（最終損失確定後における通貨間の損失補填財源の調整）

第１１０条の２　前条の規定に従い確定した破綻処理損失について補填を行った結果、破綻処理清算約定に係る通貨の種類ごとのいずれかの破綻処理損失を補填するために損失補填財源を費消する場合において、当社は、当社が規則で定めるところにより、損失補填財源を通貨の種類間で調整することができる。

（破綻清算参加者からの回収金等の分配）

第１１１条　当社は、破綻清算参加者の破綻処理を行った場合において、次の各号に掲げる場合に応じて、当該各号に掲げる額を、当社が規則で定めるところにより当社が規則で定める者に分配する。

（１）　第１０１条第２項の規定による当社の当該破綻清算参加者に対する債権について弁済又は配当を受けたとき　当該弁済又は配当を受けた額

（２）　前号の債権の額が確定した場合において、破綻処理損失の額が当該債権の額を上回るとき　その超過額

２　当社は、前項各号に掲げる額の分配を受ける者が存在しない場合には、当社が規則で定めるところにより当該額の処理を行う。

第５節　委任

（規則への委任）

第１１２条　本章に定めるもののほか、清算参加者の破綻等に伴う破綻処理清算約定の決済及び損失の処理等に関し必要な事項は、当社が規則で定める。

第１０章　雑則

（決済時限の臨時変更）

第１１３条　当社は、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社又は当社以外の機関が設置する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清算約定に係る債務を履行すべき時刻（以下「決済時限」という。）を臨時に変更する必要があると認める場合に限り、決済時限を臨時に変更することができる。この場合において、当社は、すべての清算参加者に対し、あらかじめその旨を通知する。

（システム障害時等における決済日の繰延べ）

第１１４条　当社は、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社又は当

社以外の機関が設置する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、清算約定に係る債務の全部又は一部について、当該債務を履行すべき日（以下「決済日」という。）に履行することが不可能又は困難であると認める場合には、当該債務の全部又は一部につき決済日をその翌日以降に繰り延べることができる。この場合において、当社は、清算参加者に対し、あらかじめその旨を通知する。

２　前項に規定する決済日の繰延べに関し必要な事項は、当社がその都度定める。

（天災地変等の場合における非常措置）

第１１５条　当社は、天災地変、経済事情の激変その他やむを得ない理由により、清算約定に係る債務の履行が不可能又は著しく困難であると認める場合には、取締役会の決議により、当該清算約定に係る債務の履行条件（債務の弁済期、履行方法その他債務の履行に係る条件をいう。以下本条において同じ。）を改めて定めることができる。

２　前項の規定により当社が清算約定に係る債務の履行条件を定めたときは、清算参加者は、これに従わなければならない。

３　第１項の場合において、緊急の必要があるときは、当社は、取締役会の決議を経ずに、清算約定に係る債務の履行条件を改めて定めることができる。

（他の清算業務における金利スワップ取引清算業務に係る余剰担保の利用）

第１１６条　当社は、破綻清算参加者から預託を受けた金利スワップ取引清算業務に係る余剰担保（破綻清算参加者が金利スワップ取引清算業務に関して当社に対して返還請求権を有する当初証拠金、変動証拠金、金利スワップ清算基金、破綻時証拠金及び特別清算料担保金のうち、本業務方法書等の定めるところにより破綻清算参加者の債務の弁済に充当した残額に係るものをいう。）（当該余剰担保が代用有価証券である場合には、その換価処分後の金銭から当該換価処分に要した費用を控除した残額とし、当該余剰担保が日本円以外の通貨の金銭である場合には、当該通貨を両替した際に要した費用を控除した残額とする。）を、他の清算業務に係る業務方法書の定めるところにより破綻清算参加者の当社に対する他の債務の弁済に充当することができる。

（債権譲渡の禁止等）

第１１７条　清算参加者及び清算委託者は、本業務方法書に規定する一切の債権（金利スワップ清算基金の返還請求権及び証拠金の返還請求権を含むが、これらに限られない。）を、他の者に譲渡し、譲渡の予約をし、又は担保の目的に供することはできない。ただし、あらかじめ、当社所定の申請書により当社に対して申請を行い、当社の書面による承認を受けた場合にはこの限りでない。

（事務の委任）

第１１８条　当社は、金利スワップ取引清算業務に関し、当社が定める事務を、当社が指定する者に委任することができる。

２　清算参加者は、本業務方法書に定めるほか、前項の事務に関して同項により指定する者が当社の承認を受けて定めるところによらなければならない。
３　第１８条の規定は、第１項の規定により事務の委任を受けた者について準用する。

（金利スワップ取引清算業務に関する必要事項の決定）
第１１９条　当社は、本業務方法書に定める事項のほか、金利スワップ取引清算業務に関して必要がある場合には、所要の取扱いについて規則で定めることができる。

（附帯業務）
第１２０条　当社は、金融商品債務引受業等（第３条に規定するものに限る。）に附帯する業務を行う。

（本業務方法書の変更）
第１２１条　本業務方法書等の変更（新たな規則の制定及び廃止を含む。以下同じ。）は、当社が取締役会の決議をもって行う。ただし、本業務方法書を除く本業務方法書等の変更及び軽微な変更については、当社は、取締役会の決議を経ることなく当該変更をすることができる。
２　当社が前項の規定により本業務方法書等を変更する場合、当社は、当社が定める方法により、当該変更の効力が生じる前に、清算参加者に対して当該変更の内容を通知する。ただし、当該変更が清算参加者及び清算委託者の権利義務に影響を与えないものである場合又はその変更の内容が軽微なものである場合は、事前の通知に代えて事後速やかに通知することで足りるものとする。
３　清算参加者は、前項の規定により本業務方法書等の変更について当社から通知を受けた場合には、その内容を、速やかに清算受託契約を締結している清算委託者に通知するものとする。
４　当社が第１項の規定により本業務方法書等を変更した場合、当社、清算参加者及び清算委託者は、当該変更の効力が生じた日以降、変更後の本業務方法書等の規定に従うものとする。

（金利スワップ運営委員会）
第１２２条　当社は、前条に規定する本業務方法書等の変更を行おうとする場合において、当該変更が次の各号に掲げる事項に該当するときは、当該変更を行うことの適否につき、金利スワップ運営委員会に諮問し、その意見を尊重するものとする。ただし、当該変更の内容が軽微なものである場合は、この限りでない。
（１）　第４条に規定する清算対象取引に関する事項
（２）　第９条に規定する金利スワップ清算資格の要件に関する事項
（３）　第１７条に規定する金利スワップ清算基金に関する事項
（４）　第２章第４節に規定する清算参加者の申請による金利スワップ清算資格の喪失に関する事項
（５）　第２章第６節に規定する清算参加者に対する措置等に関する事項

（６）　第３章に規定する有価証券等清算取次ぎに関する事項
（７）　第６章に規定する証拠金に関する事項
（８）　第８章に規定する清算預託金に関する事項
（９）　第９章に規定する清算参加者の決済不履行時の措置に関する事項
（１０）　前条に規定する本業務方法書等の変更の方法に関する事項
（１１）　本条に規定する金利スワップ運営委員会への諮問に関する事項

２　前項に定めるもののほか、金利スワップ運営委員会に関する事項は当社が規則で定める。

（本業務方法書等の性質）

第１２３条　本業務方法書等の各条項は、当該各条項が規定する範囲内において、当社、清算参加者及び清算委託者を集団的に拘束する。清算参加者及び清算委託者は、清算参加者契約の締結又は第４３条第２項の誓約書の提出により、他の清算参加者及び他の清算委託者（将来清算参加者又は清算委託者となる者を含む。）との間で別段の合意をすることなく、本業務方法書等の定めるところにより当該他の清算参加者及び他の清算委託者との間で権利義務が生じることに同意する。

（標準時）

第１２４条　本業務方法書等において使用される年月日時は、本業務方法書等に別段の定めがあるものを除くほか、すべて日本標準時を意味するものとする。

（通知等の方法）

第１２５条　本業務方法書等の規定により当社が行う通知、公示及び公表の方法は、当社が定める。

（準拠法）

第１２６条　本業務方法書等（本業務方法書等に従って成立する清算参加者契約その他の合意を含む。次条において同じ。）は日本法に準拠するものとし、日本法に従って解釈されるものとする。

（裁判管轄）

第１２７条　本業務方法書等に関し、当社及び清算参加者又は清算委託者の間において訴訟の必要が生じた場合は、東京地方裁判所を第一審の専属的合意管轄裁判所とする。

付　　則

１　本業務方法書は、平成２４年１０月９日（以下「施行日」という。）から施行する。ただし、第２章第１節及び第１２２条の規定は同年８月２０日から施行する。

２　当社が第８条第２項の規定により取得申請者について金利スワップ清算資格の取得の承認を行った場合であって、施行日前に当該取得申請者に係る金利スワップ清算資格を取得すべき期日が到来するときは、第１０条第１項中「資格取得予定期日の前当社営業日までに、金利スワップ

清算基金の預託その他当社が定める金利スワップ清算資格の取得手続を」とあるのは「施行日の前当社営業日までに、金利スワップ清算基金の預託を、資格取得予定期日の前当社営業日までに、その他当社が定める金利スワップ清算資格の取得手続を」と、同条第２項中「同項の手続を」とあるのは「同項に規定するその他当社が定める金利スワップ清算資格の取得手続を」と読み替えて同条の規定を適用するものとする。

３　当社は、第１号から第３号までに掲げる事項については、第１項ただし書に定める日より前においても、第４号から第６号までに掲げる事項及び当該事項に関し必要な手続その他の行為については、施行日前においても、本業務方法書等の例により、行うことができる。

（１）　本業務方法書第８条第２項の規定による取得申請者に対する金利スワップ清算資格の取得の承認

（２）　本業務方法書第９条の規定による承認審査の実施

（３）　本業務方法書第１１条の規定による清算参加者契約の締結

（４）　本業務方法書第１３条の規定による清算参加者からの清算参加者代表者の届出の受理

（５）　本業務方法書第１４条の規定による清算参加者からの決済業務責任者の届出の受理

（６）　本業務方法書第１７条の規定による清算参加者からの金利スワップ清算基金の預託の受入れ

４　本業務方法書第８０条の規定は、施行日から９か月を経過する日までの間は、これを適用しない。

付　　則

この改正規定は、平成２５年２月２５日から施行する。

付　　則

１　この改正規定は、平成２５年３月３１日から施行する。

２　平成２５年３月３１日から平成２６年３月３０日までの間における改正後の第９条第１項第２号ｂの（ｂ）、第２８条第３項第１号ｂ、同項第２号ｂ、同条第４項第２号、同条第５項第１号ｄ及び同条第６項第２号の規定の適用については、第９条第１項第２号ｂの（ｂ）イ、第２８条第５項第１号ｄの（ａ）、同条第６項第２号ａ中「４．５パーセント」とあるのは「３．５パーセント」と、第９条第１項第２号ｂの（ｂ）イ、第２８条第３項第１号ｂの（ａ）、同項第２号ｂの（ａ）、同条第４項第２号ａ中「５．６２５パーセント」とあるのは「４．３７５パーセント」と、第９条第１項第２号ｂの（ｂ）ロ、第２８条第５項第１号ｄの（ｂ）、同条第６項第２号ｂ中「６パーセント」とあるのは「４．５パーセント」と、第９条第１項第２号ｂの（ｂ）ロ、第２８条第３項第１号ｂの（ｂ）、同項第２号ｂの（ｂ）、同条第４項第２号ｂ中「７．５パーセント」とあるのは「５．６２５パーセント」とする。

３　平成２６年３月３１日から平成２７年３月３０日までの間における改正後の第９条第

１項第２号ｂの（ｂ）、第２８条第３項第１号ｂ、同項第２号ｂ、同条第４項第２号、同条第５項第１号ｄ及び同条第６項第２号の規定の適用については、第９条第１項第２号ｂの（ｂ）イ、第２８条第５項第１号ｄの（ａ）、同条第６項第２号ａ中「４．５パーセント」とあるのは「４パーセント」と、第９条第１項第２号ｂの（ｂ）イ、第２８条第３項第１号ｂの（ａ）、同項第２号ｂの（ａ）、同条第４項第２号ａ中「５．６２５パーセント」とあるのは「５パーセント」と、第９条第１項第２号ｂの（ｂ）ロ、第２８条第５項第１号ｄの（ｂ）、同条第６項第２号ｂ中「６パーセント」とあるのは「５．５パーセント」と、第９条第１項第２号ｂの（ｂ）ロ、第２８条第３項第１号ｂの（ｂ）、同項第２号ｂの（ｂ）、同条第４項第２号ｂ中「７．５パーセント」とあるのは「６．８７５パーセント」とする。

付　　則

この改正規定は、平成２５年５月１５日から施行する。

付　　則

１　この改正規定は、平成２６年２月２４日から施行する。

２　この業務方法書の施行時における債務負担の取扱いその他必要な事項については、当社がその都度定める。

付　　則

この改正規定は、当社が定める日から施行する。

（注）「当社が定める日」は平成２６年３月７日。

付　　則

この改正規定は、平成２６年３月３１日から施行する。

付　　則

この改正規定は、平成２６年４月１日から施行する。

付　　則

この改正規定は、平成２６年１１月４日から施行する。

付　　則

１　この改正規定は、平成２７年９月２４日から施行する。

２　前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社が設置する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、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、平成２７年９月２４日以後の当社が定め

る日から施行する。

付　　則

1　この改正規定は、平成２７年１０月１９日から施行する。

2　前項の規定にかかわらず、改正後の第２条第１項第１号及び第１号の２、第５３条の４第６項、第５８条の４、第５８条の６並びに第５８条の７の規定は、当社が定める日から施行する。

（注）「当社が定める日」は平成２８年４月１１日。

付　　則

1　この改正規定は、平成２８年４月１１日から施行する。

2　前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社が設置する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、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、平成２８年４月１１日以後の当社が定める日から施行する。

付　　則

この改正規定は、平成２８年１２月１９日から施行する。

付　　則

1　この改正規定は、平成２９年１月３０日から施行する。

2　前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社が設置する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、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、平成２９年１月３０日以後の当社が定める日から施行する。

付　　則

この改正規定は、平成３０年４月６日から施行する。

付　　則

1　この改正規定は、平成３０年９月２５日から施行する。

2　前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社が設置する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、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、平成３０年９月２５日以後の当社が定める日から施行する。

付　　則

この改正規定は、平成３１年４月１５日から施行する。

付　　則

この改正規定は、令和元年９月１日から施行する。

付　　則

この改正規定は、令和２年８月１日から施行する。

付　　則

１　この改正規定は、令和３年５月１７日から施行する。

２　前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社が設置する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、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、令和３年５月１７日以後の当社が定める日から施行する。

付　　則

１　この改正規定は、令和３年１２月６日から施行する。

２　前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社が設置する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、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、令和３年１２月６日以後の当社が定める日から施行する。

付　　則

１　この改正規定は、令和５年９月１９日から施行する。

２　前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社が設置する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、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、令和５年９月１９日以後の当社が定める日から施行する。

付　　則

１　この改正規定は、令和６年３月４日から施行する。

２　前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社が設置する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、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、令和６年３月４日以後の当社が定める日から施行する。

付　　則

１　この改正規定は、令和６年４月１日から施行する。

２　前項の規定にかかわらず、清算約定に係る当社と清算参加者の間の決済を行うために必要な当社が設置する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、改正後の規定を適用することが適当でないと当社が認める場合には、令和６年４月１日以後の当社が定める日から施行する。

（注）「当社が定める日」は令和７年１月６日

別表

用語	条項	ＩＳＤＡ定義集
コンファメーション	１．１．９	Ｃｏｎｆｉｒｍａｔｉｏｎ
営業日	２．１．１	Ｂｕｓｉｎｅｓｓ　Ｄａｙ
固定金利支払人	５．１．３	Ｆｉｘｅｄ　Ａｍｏｕｎｔ　Ｐａｙｅｒ
変動金利支払人	６．１．２	Ｆｌｏａｔｉｎｇ　Ａｍｏｕｎｔ　Ｐａｙｅｒ
契約期間	３．２．１	Ｔｅｒｍ
終了日	３．１．３	Ｔｅｒｍｉｎａｔｉｏｎ　Ｄａｔｅ
取引日	３．１．１	Ｔｒａｄｅ　Ｄａｔｅ
固定金額	５．１．２	Ｆｉｘｅｄ　Ａｍｏｕｎｔ
変動金額	６．１．３	Ｆｌｏａｔｉｎｇ　Ａｍｏｕｎｔ
想定元本	４．４．２	Ｎｏｔｉｏｎａｌ　Ａｍｏｕｎｔ
金利支払日	３．１．８	Ｐａｙｍｅｎｔ　Ｄａｔｅ
営業日調整	２．３．１	Ｂｕｓｉｎｅｓｓ　Ｄａｙ　Ｃｏｎｖｅｎｔｉｏｎ
日数計算	４．６．１	Ｄａｙ　Ｃｏｕｎｔ　Ｆｒａｃｔｉｏｎ
固定金利	５．３	Ｆｉｘｅｄ　Ｒａｔｅ
変動金利	６．３．１	Ｆｌｏａｔｉｎｇ　Ｒａｔｅ
金利更改日	６．５．５	Ｒｅｓｅｔ　Ｄａｔｅ
変動金利の決定方法	６．５．１	Ｆｌｏａｔｉｎｇ　Ｒａｔｅ　Ｏｐｔｉｏｎ
金利計算期間	６．７．４	Ｄｅｓｉｇｎａｔｅｄ　Ｍａｔｕｒｉｔｙ