金利スワップ破綻管理委員会規則

（目的）

第１条　この金利スワップ破綻管理委員会規則（以下「本規則」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。）が制定した金利スワップ取引清算業務に関する業務方法書（以下「業務方法書」という。）に基づき、金利スワップ破綻管理委員会の権限、組織、委員の選任方法その他委員会の運営に関し必要な事項を定めることを目的とする。

（定義）

第２条　本規則において使用する用語は、本規則に別段の定めがある場合を除き、業務方法書において使用する用語の例による。

（金利スワップ破綻管理委員会の設置）

第３条　当社は、取締役会の常設の諮問委員会として、金利スワップ破綻管理委員会（以下「委員会」という。）を設置する。

２　委員会は、第６条から第６条の４までの規定により選任される５社以下の委員により構成される。

（諮問事項）

第４条　業務方法書第９２条第１項に規定する当社が定める事項は、次に掲げる事項とする。

（１）　損失回避取引の実施、取引条件及び取引の相手方に関する事項

（２）　破綻処理入札の実施、開催条件、開催日時及び運営に関する事項

（３）　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転売（証券取引等業務方法書第４５条の２第２項に規定する転売をいう。）又は買戻し（証券取引等業務方法書第４５条の２第２項に規定する買戻しをいう。）の実施、取引条件及び取引の相手方に関する事項

（４）　クロスマージン処分取引の実施、取引条件及び取引の相手方に関する事項

（５）　上記のほか、破綻処理清算約定、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等に関し、当社が個別に諮問する事項

２　当社は、前項各号に掲げる事項について委員会又は委員の助言があった場合には、その助言を尊重する。

（清算参加者リスト）

第５条　当社は、すべての清算参加者（特定承継金融機関等である清算参加者を除く。以下この条及び次条において同じ。）を無作為の順序で記載した表（以下「清算参加者リスト」という。）を作成する。

２　当社は、清算参加者が金利スワップ清算資格を喪失した場合（当社による金利スワップ清算資格の取消しの措置によって喪失する場合を含む。次条において同じ。）又は清算参加者について破綻等を認定した場合には、当該喪失又は破綻等の認定時に、これらの清算参加者を清算参加者リストから抹消する。

３　当社は、次条から第６条の４までの規定により清算参加者を委員に選任した場合には、当該清算参加者を、清算参加者リストから抹消する。

４　当社は、清算参加者リストに記載された清算参加者が５社に満たなくなった場合には、第１項の定めるところにより、清算参加者リストを新規に作成することとする。この場合において、現に存する清算参加者リストは、当該清算参加者リストの末尾の清算参加者を委員に選任した時点で効力を失うものとする。

（委員の選任等）

第６条　当社は、清算参加者リストの順序に従い、５社の清算参加者（清算参加者リストに記載された清算参加者が５社に満たない場合には、清算参加者リストに記載されたすべての清算参加者及び前条第４項の規定により新たに作成された清算参加者リストの順序に従い合わせて５社に満つるまでの清算参加者）を、委員に選任する。

２　前項の規定による委員の選任後に、委員が金利スワップ清算資格を喪失した場合又は当社が委員の破綻等を認定した場合には、当社は、当該喪失又は認定と同時に当該委員の選任を取り消すものとする。この場合、当社は、清算参加者リストの順序に従い、補充の委員を選任する。

３　当社は、金利スワップ取引の取引状況等を踏まえ委員又はその委員代表者が委員としての職務の遂行に堪えないと認めるときその他やむを得ない事由があると認めるときは、委員の選任を取り消すことができる。この場合、当社は、清算参加者リストの順序に従い、補充の委員を選任する。

４　第１項の規定により選任された委員の数が５社に満たない場合において、その後に当社が、新たに金利スワップ清算資格を付与した場合には、当該付与時に、当該付与を受けた清算参加者（同時に複数の者に清算資格を付与した場合には、無作為の順序で委員の数が５社に満つるまでの清算参加者）を補充の委員として選任する。

５　委員の任期は、当社がその選任の際に特に指定する場合を除き、選任の日から１年間とする。

（クロスマージン利用者の破綻処理に係る助言を行う委員に関する特則）

第６条の２　前条の規定にかかわらず、クロスマージン利用者である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が委員である場合において、委員会が当該清算委託者の計算により成立し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に関して助言を行うときは、当該委員の選任を取り消すものとする。この場合、当社は、清算参加者リストの順序に従い、補充の委員を選任する。

２　当社は、前項の規定に従い補充の委員を選任した場合には、前項の規定により委員の選任を取

り消した清算参加者を、現に存する清算参加者リストの最上位に記載する。

（外貨建清算約定の破綻処理に係る助言を行う委に関する特則）

第６条の３　当社は、外貨建清算約定の当事者である清算参加者の破綻等を認定した場合に第４条第１項各号に掲げる事項のうち、特に当該外貨建清算約定である破綻処理清算約定（以下本条及び次条において「外貨建破綻処理清算約定」という。）に関する第４条第１項第１号、第２号及び第５号に掲げる事項を諮問する委員（以下本条及び次条において「外貨建破綻処理清算約定に係る委員」という。）として、あらかじめ、委員に選任された日から起算して過去３０日の間において外貨建清算約定の当事者であった委員のうち２社を指定する。

２　前項に規定する外貨建破綻処理清算約定に係る委員は、現に委員に選任されている５社の清算参加者が第６条第１項の規定により委員に選任される際の清算参加者リストの順序に従い、指定するものとする。

３　当社は、第１項の規定に従い指定した外貨建破綻処理清算約定に係る委員に関して、当該委員の日本円建て以外の金利スワップ取引に関する業務執行体制等を踏まえ、当該委員又はその委員代表者が外貨建破綻処理清算約定に係る委員としての職務の遂行に堪えないと認めるときその他やむを得ない事情があると当社が認める場合に限り、当該委員について、外貨建破綻処理清算約定に係る委員の指定を取り消すことができる。この場合、当社は、前２項の規定に従い、補充の外貨建破綻処理清算約定に係る委員を指定する。

４　前項後段の規定は、第１項の規定による外貨建破綻処理清算約定に係る委員の指定後に、外貨建破綻処理清算約定に係る委員が第６条第２項の規定により委員の選任を取り消された場合に準用する。

（外貨建破綻処理清算約定に係る委員の候補の指名等）

第６条の４　当社は、委員を選任する時点又は前条第３項（前条第４項において準用する場合を含む。）の規定により補充の外貨建破綻処理清算約定に係る委員を指定する時点において、外貨建破綻処理清算約定に係る委員を２社指定することができない場合には、当該時点で、清算参加者リスト（第５条第４項の規定により新たな清算参加者リストが作成されている場合には、当該新たな清算参加者リストを含む。）の順序に従い、外貨建破綻処理清算約定に係る委員の候補を、外貨建破綻処理清算約定に係る委員と合わせて２社に満つるまで指名するものとする。この場合において、現に存する清算参加者リストの末尾に記載された清算参加者までで、外貨建破綻処理清算約定に係る委員の候補を、外貨建破綻処理清算約定に係る委員と合わせて２社に満つるまで指名できないときは、第５条第１項に定めるところにより、清算参加者リストを新規に作成し、当該清算参加者リストの順序に従い外貨建破綻処理清算約定に係る委員と合わせて２社に満つるまで指名するものとする。

２　前項に規定する外貨建破綻処理清算約定に係る委員の候補の指名は、清算参加者リスト（前項後段又は第５条第４項の規定により新たな清算参加者リストが作成されている場合は、当該新た

な清算参加者リストを含む。）に記載されている清算参加者のうち、指名をする日から起算して過去３０日の間において外貨建清算約定の当事者となっている清算参加者のうちから行うものとする。

３　清算参加者が外貨建破綻処理清算約定に係る委員の候補に指名されている場合において、当社が外貨建清算約定の当事者である清算参加者について破綻等を認定したときは、当社は、当該外貨建破綻処理清算約定に係る委員の候補を委員に選任するとともに、外貨建破綻処理清算約定に係る委員に指定する。この場合において、当該新たに委員に選任した清算参加者は、清算参加者リストから抹消する。

４　前項の規定に従い外貨建破綻処理清算約定に係る委員の候補を委員に選任した場合には、現に委員に選任されている委員５社が清算参加者リストに記載されていた時点における当該清算参加者リスト（第５条第４項の規定により新たな清算参加者リストが作成されている場合には、当該新たな清算参加者リストを含む。）の末尾側に記載されていた清算参加者から順に、当該新たに委員に選任した数に応じて、委員の選任を取り消すとともに、当該委員の選任を取り消した清算参加者を現に存する清算参加者リストの最上位に記載する。

５　前各項の規定により委員に選任された清算参加者の任期その他必要な事項は、当社がその都度定める。

（委員代表者の届出等）

第７条　委員は、その選任後直ちに、当該委員又は当該委員を含む企業集団に含まれる他の法人等の役職員のうち金利スワップ取引の実務に精通し、委員としての職務（外貨建破綻処理清算約定に係る委員に指定された委員にあっては、外貨建破綻処理清算約定に係る委員としての職務を含む。）に関し当該委員を代表又は代理する者として少なくとも１名を、委員の代表者又は代理人（以下「委員代表者」という。）として当社所定の書面により当社に届け出るものとする。

２　委員は、委員代表者を変更する場合には、当社所定の書面により変更後の委員代表者を当社に届け出るものとする。

（委員等の義務）

第８条　委員は、個別に、又は委員会として、第４条第１項各号に掲げる事項について当社に対し助言を行うものとする。

２　委員及び委員代表者（これらであった者を含む。）は、その職務上知り得た秘密（一般に知られておらず、他人に知られないことについて客観的に相当の利益を有する事実をいう。）を保持するものとし、次に掲げる場合その他正当な理由なく、委員としての職務遂行の目的以外の目的のために利用し、又は第三者（自己の所属する法人等を含む。）に漏らしてはならない。

（１）　当社の事前の書面による同意を得た場合

（２）　裁判所、監督官庁その他公的機関若しくは金融商品取引所その他自主規制機関の命令若しくは要請、又は法令の規定に基づき、開示又は提供を求められた場合

（３）　委員としての職務の遂行に必要である場合

（４）　本規則に基づく義務の履行又は自らの権利を保全若しくは行使するために必要な範囲で、弁護士、公認会計士、税理士等の専門家又は自社を含む企業集団に含まれる他の法人等に開示又は提供する場合（法令上秘密保持義務を負う者以外の者に開示又は提供する場合には、あらかじめ当該者に本項と同一の内容の秘密保持義務を負わせた上で開示又は提供する場合に限る。）

３　当社は、前条の規定により委員代表者の届出を受けた場合には、委員代表者に、前項の義務を遵守する旨の当社所定の誓約書を提出させるものとする。

（破綻処理演習の実施）

第９条　当社及び委員会は、共同で、当社が清算参加者の破綻等を認定した場合における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（当該再構築が完了するまでの間に生じ得る当社の損失を回避するための措置を含む。）その他破綻等の認定に伴う処理を適正かつ円滑に行うための演習（以下「破綻処理演習」という。）を実施する。

２　すべての清算参加者（特定承継金融機関等である清算参加者を除く。）は、破綻処理演習に参加し、当社及び委員会がその実施の都度作成する手順に従うものとする。この場合において、業務方法書第９条第１項第３号ｂの委託を行っている清算参加者は、当該委託を受けた者をして、破綻処理演習に参加させるものとする。

（委任）

第１０条　本規則に定めるもののほか、委員会の運営に関し必要な事項は、委員会がその都度定める。

付　　則

１　本規則は、平成２４年１０月９日（以下「施行日」という。）から施行する。

２　当社は、委員の選任及び委員代表者の届出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、本規則の例により、行うことができる。

３　当社は、施行日以降速やかに、清算参加者リストの上位５社に該当する清算参加者（清算参加者リストに記載された清算参加者リストが５社に満たない場合には、清算参加者リストに記載されたすべての清算参加者）を委員に選任し、委員会を設置する。

付　　則

１　この改正規定は、平成２５年４月９日（以下「施行日」という。）から施行する。

２　当社は、改正後の第５条及び第６条の規定にかかわらず、施行日において当社の定めるところにより、新たに清算参加者リストを作成し、当該清算参加者リストに基づき委員の選任を行うものとする。当該委員の任期は、当社が定めるところによる。

３　改正後の第５条の規定にかかわらず、前項の規定により作成する清算参加者リストは、その末

尾から起算して５番目に記載された清算参加者を委員に選任する場合を、改正後の第５条第４項に規定する場合に該当するものとする。

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４月１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（以下「施行日」という。）から施行する。

2　改正後の第６条の３及び第６条の４の規定にかかわらず、当社は、施行日以降最初に行う外貨建破綻処理清算約定に係る委員の指定又は外貨建破綻処理清算約定に係る委員の候補の指名を、日本円以外の通貨の金利スワップ取引の債務負担の状況を踏まえ、当社が定めるところにより行うものとする。

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。