附則

適用時期)

第一条 この告示は、平成三十年三月三十一日から適用する。

(派生商品取引及び長期決済期間取引の与信相当額の算出に係る経過措置

- その経営の健全性を判断するための基準(以下「旧告示」という。)第五十七条に定めるところにより与信相当額を算出する方式をいう。 中央金庫は、 同じ。)を用いて、先渡、 スポージャー方式 百四十三条第二項及び第二百五十三条の七第一項において準用する場合を含む。)の規定にかかわらず、商工組合中央金庫は、 の経営の健全性を判断するための基準(以下「新告示」という。)第五十六条第一項(新告示第百三十九条第五項、第百四十七条第五項、 当分の間、 全ての派生商品取引について、SA-CCRを用いて与信相当額を算出することができない。 第●条の規定による改正後の株式会社商工組合中央金庫法第二十三条第一項の規定に基づき、 (第●条の規定による改正前の株式会社商工組合中央金庫法第二十三条第一項の規定に基づき、 スワップ及びオプションその他の派生商品取引の与信相当額を算出することができる。この場合において、商工組合 株式会社商工組合中央金庫 株式会社商工組合中央金庫が カレント・エク
- き又は新告示第五十九条第一項の承認を受けたときを除き、これを継続して用いるものとする。 前項の規定にかかわらず、商工組合中央金庫が、 あらかじめ、やむを得ない理由によりその使用を継続することができない旨を経済産業大臣、 直近の算出基準日においてSA-CCRを用いて派生商品取引の与信相当額を算出している 財務大臣及び金融庁長官に届け出たと
- 中央金庫は、 前二項の規定は、 派生商品取引と長期決済期間取引について異なる方式を用いることができる。 新告示第五十六条第二項に規定する長期決済期間取引の与信相当額の算出について準用する。この場合において、 商工 組
- ポージャー方式を使用し、 〜 算出するものとする。 商工組合中央金庫が包括的手法を適用する場合であって、先渡、 かつ、 適格金融資産担保を用いるときのエクスポージャーの額は、 スワップ及びオプション等の派生商品取引について、 当分の間、 旧告示第四章第六節第三款の規定によ カレント・エクス
- ャー方式を使用し、 商工組合中央金庫が簡便手法を適用する場合において、 当分の間、 かつ、 同条第三号及び第四号に定めるリスク・ウェイトを適用することができる。 適格金融資産担保を用いるときに、 先渡、 当該適格金融資産担保が旧告示第九十七条第三号及び第四号に掲げるものである スワップ及びオプション等の派生商品取引について、 カレント・エクスポージ
- 第四条 商工組合中央金庫が標準的手法を採用する場合において、 直接清算参加者として間接清算参加者の適格中央清算機関に対するトレード

号の合計額の算出に当たっては、 示第百二十条の二の規定により算出した額を当該信用リスク・アセットの額とみなすことができる。この場合において、新告示第二十五条第 者に対するトレード・エクスポージャーについて、与信相当額の算出にカレント・エクスポージャー方式を用いているときは、当分の間、 ード・エクスポージャーに係る取次ぎ又はこれらに類する海外の取引(以下「清算取次ぎ等」という。)を行うことにより生ずる間接清算参加 エクスポージャーに係る金融商品取引法第二条第二十七項に規定する有価証券等清算取次ぎ、間接清算参加者の適格中央清算機関に対するトレ -ド・エクスポージャーに係る商品先物取引法第二条第二十項に規定する商品清算取引その他間接清算参加者の適格中央清算機関に対するトレ 当該信用リスク・アセットの額を用いるものとする 旧告

エクスポージャーに係るものに限る。)に次の掛目を乗じた額を当該間接清算参加者に対するトレード・エクスポージャーのEADとすることが の算出に当たってカレント・エクスポージャー方式を用いているときは、 ポージャーに係る清算取次ぎ等を行うことにより生ずる間接清算参加者に対するトレード・エクスポージャーのEADを算出するときに、 商工組合中央金庫が内部格付手法を採用する場合において、直接清算参加者として間接清算参加者の適格中央清算機関向けトレード・エクス 当分の間、 新告示第百三十九条各項の規定により算出したEAD

掛目=√ (Tm/10)

3

Tmは、新告示第五十九条第七項の規定を準用して算出したリスクのマージン期間をいう。この場合において、同項中「돑嘢」とあるのは ネッティング・セット 第四条第二項」と、回過第一中日「ネッティング・セット 二十営業日」とあり、及び「ネッティング・セット 正営業日」と読み替えるものとする 十営業日」とあるのは、「 「附則

として間接清算参加者の適格中央清算機関向けトレード・エクスポージャーに係る清算取次ぎ等を行うことにより生ずる間接清算参加者に対す るトレード・エクスポージャーのEADを算出するときについて準用する。 前項の規定は、 商工組合中央金庫が内部格付手法を採用する場合において、リテール向けエクスポージャーであって、自己が直接清算参加

第五条 手法を適用した後のエクスポージャーの額の割引現在価値を、取引相手方iに係るネッティング・セットごとに算出した額とする。 測定方式によるCVAリスク相当額を算出するときは、当分の間、 商工組合中央金庫がカレント・エクスポージャー方式を用いる場合において、新告示第二百五十三条の三第一項に規定する標準的リスク 同項の算式におけるEADitotalは、 包括的手法を使用する場合の信用リスク削減

(暟引)温 () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | () | ()

2

- 9 -

M/は、新告示第二百五十三条の三第一項に規定するM

る。 ージャーに係るEAD: "otal を算出するときは、第一項に規定する額に次の掛目を乗じた額を、当該ネッティング・セットのEAD: "otal とすることができ の適格中央清算機関向けトレード・エクスポージャーに係る清算取次ぎ等を行うことにより生ずる間接清算参加者に対するトレード・エクスポ 項の規定により新告示第二百五十三条の三第一項の算式におけるEADicomiを算出する場合において、直接清算参加者として間接清算参加者

掛目=√ (Tm/10)

Tmは、新告示第五十九条第七項の規定を準用して算出したリスクのマージン期間。この場合において、同項中「斒呼」とあるのは「弦貮第日条 第三項」と、回過第一中日「ネッティング・セット 二十営業日」とあり、及び「ネッティング・セット イング・セット 五営業日」と読み替えるものとする。 十営業日」とめるのは、「ネッテ

(適格中央清算機関に係る経過措置)

めるところによる。 当分の間、新告示第一条第六号の三に掲げる用語の意義は、新告示第一条第六号の三の規定にかかわらず、旧告示第一条第六号の三に定

は、 当分の間、新告示第二百五十三条の八の規定にかかわらず、適格中央清算機関に係る清算基金の信用リスク・アセットの額の算出に当たって 旧告示第二百五十三条の八の規定により算出するものとする。