0 どうかを判断するための基準を定める件(平成二十二年金融庁告示第百三十号) 最終指定親会社及びその子法人等の保有する資産等に照らし当該最終指定親会社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

改正前欄及び改正後欄に対応して掲げるその標記部分に二重傍線を付した規定(以下「対象規定」という。)は、当該対象規定を改正後欄に 掲げるもののように改め、改正後欄に掲げる対象規定で改正前欄にこれに対応するものを掲げていないものは、これを加える。 次の表により、改正前欄に掲げる規定の傍線を付した部分をこれに順次対応する改正後欄に掲げる規定の傍線を付した部分のように改め、

(リスク・ウェイトのみなし計算) (リスク・ウェイトのみなし計算) (リスク・ウェイトのみなし計算) (リスク・ウェイトのみなし計算) (リスク・ウェイトのみなし計算) (リスク・ウェイトを直接に判定するところにより算出するものとする。 には、当該リスク・ウェイトを直接に判定するところにより算出するものとする。 には、当該裏付けとなる資産等を実際に保有する会社、組合その他これらには、当該裏付けとなる資産等を実際に保有する会社、組合その他これらには、当該裏付けとなる資産等を実際に保有する会社、組合その他これらに準ずる事業体(以下この条及び第百四十四条において「事業体」となる事業体(以下この条及び第百四十四条において「事業体」との総額を当該裏付けとなる資産等を実際に保有する会社、組合その他これらに準ずる事業体(以下この条及び第百四十四条において「事業体」と総称する。)の総資産の額で除して得た割合を、当該保有エクスポージャーの裏付けとなる資産等を実際に保有する会社、組合その他これらに準する事業体(以下この条及び第百四十四条において「事業体」と	改正後
条を加える。」	改正前

-ジャーのリスク・ウェイトとして用いるものとする。

- されていること。

  一 当該標準的手法採用最終指定親会社により十分かつ頻繁に取得
- 一 独立した第三者により検証されていること。
- とする。 定を準用する。この場合において、同条中「掲げる額の合計額」と 相当額並びに長期決済期間取引の与信相当額)」と読み替えるも 五を乗じて得た額及び当該派生商品取引以外の派生商品取引の与信 バランス取引の与信相当額、 相手方とする派生商品取引が含まれている場合にあっては、オフ・ 品取引に第二百四十八条の二第一項各号に掲げる者以外の者を取引 同条第一号中「与信相当額」とあるのは「与信相当額 あるのは「掲げる額 該裏付けとなる資産等を直接保有する者とみなして、第十四条の規 を算出するに当たっては、当該標準的手法採用最終指定親会社を当 スポージャーの裏付けとなる資産等の信用リスク・アセットの総額 前項の場合において、標準的手法採用最終指定親会社が保有エク (第二号に掲げる額を除く。)の合計額」と、 当該派生商品取引の与信相当額に一・ (当該派生商
- ているときには、当該エクスポージャーについて当該第三者によりスポージャーに関する情報が第三者により十分かつ頻繁に取得されのみを満たすことができず、かつ、当該裏付けとなる資産等のエクエクスポージャーの裏付けとなる資産等の信用リスク・アセットの乗準的手法採用最終指定親会社は、第二項の場合において、保有

当額並びに長期決済期間取引の与信相当額)」と読み替えるものと 乗じて得た値をリスク・ウェイトとして用いた上で、同節」と、同 引に適用するリスク・ウェイトに一・二を乗じる調整を行うものと ランス取引の与信相当額、 手方とする派生商品取引が含まれている場合にあっては、オフ・バ 条第一号中「与信相当額」とあるのは「与信相当額(当該派生商品 する」と、 の合計額とし、当該合計額の算出に当たっては、個々の資産及び取 額の合計額をいう」とあるのは なして、第十四条の規定を準用する。この場合において、同条中一 けとなる資産等を直接保有する標準的手法採用最終指定親会社とみ を乗じて得た額及び当該派生商品取引以外の派生商品取引の与信相 取引に第二百四十八条の二第一項各号に掲げる者以外の者を取引相 を用いて保有エクスポージャーの裏付けとなる資産等の信用リスク ・アセットの総額を算出するに当たっては、当該第三者を当該裏付 項の場合において、 「同節」とあるのは「当該リスク・ウェイトに一・二を 同項の第三者が判定したリスク・ウェイト 当該派生商品取引の与信相当額に一・五 「額(第二号に掲げる額を除く。)

判定されたリスク・ウェイトを用いることができる。

最大となるように算出した保有エクスポージャーの裏付けとなる資

という。)が明示されているときには、

当該資産運用基準に基づき

する基準(以下この条及び第百四十四条において「資産運用基準」

たすことができない場合であって、裏付けとなる資産等の運用に関

標準的手法採用最終指定親会社は、

第二項各号に掲げる要件を満

ポージャーのリスク・ウェイトとして用いることができる。際に保有する事業体の総資産の額で除して得た割合を、保有エクス産等の信用リスク・アセットの総額を当該裏付けとなる資産等を実

者を取引相手方とする派生商品取引が含まれている場合にあっては 四条の規定を準用する。この場合において、同条中「掲げる額の合 構成による裏付けとなる資産等を直接保有する者とみなして、第十 えるものとする。 引の与信相当額並びに長期決済期間取引の与信相当額)」と読み替 額に一・五を乗じて得た額及び当該派生商品取引以外の派生商品取 額」と、同条第一号中「与信相当額」とあるのは「与信相当額 計額」とあるのは「掲げる額 定するものとし、 スポージャーの裏付けとなる資産等の信用リスク・アセットの総額 該派生商品取引に第二百四十八条の二第一項各号に掲げる者以外の スク・アセットの総額が最大となる裏付けとなる資産等の構成を想 を算出するに当たっては、 オフ・バランス取引の与信相当額、 前項の場合において、標準的手法採用最終指定親会社が保有エク かつ、当該標準的手法採用最終指定親会社を当該 同項の資産運用基準に基づき当該信用リ (第二号に掲げる額を除く。) の合計 当該派生商品取引の与信相当

調整を行ってリスク・ウェイトを算出するものとする。ただし、当次の各号に掲げるリスク・ウェイトに当該各号に定める値を乗じるり保有エクスポージャーのリスク・ウェイトを算出するときには、

標準的手法採用最終指定親会社が、

第二項又は第六項の規定によ

該調整の結果として得られるリスク・ウェイトが千二百五十パー

-4-

ントを超える場合には、千二百五十パーセントとする。

で除して得た値 第二項のリスク・ウェイト 事業体の総資産の額を純資産の額

用基準において許容される最大のもの 一 第六項のリスク・ウェイト 前号に定める値であって、資産運

ができる。 標準的手法採用最終指定親会社は、第二項各号に掲げる要件を満って、保有エクスポージャーのリスク・ウェイトについて、きであって、保有エクスポージャーのリスク・ウェイトについて、当該各号に掲げる比率である蓋然性が高いことを疎明したときには次の各号に掲げる比率である蓋然性が高いことを疎明したときには、当該各号に掲げる要件を満ができる。

一 二百五十パーセント以下 二百五十パーセント

二 二百五十パーセントを超え四百パーセント以下

四百パーセン

きないときには、保有エクスポージャーに千二百五十パーセントのたすことができず、かつ、第六項及び前項の適用を受けることがで10 標準的手法採用最終指定親会社は、第二項各号に掲げる要件を満

(期待損失額)

リスク・ウェイトを用いるものとする。

第百二十六条 [略]

[2 6 略

7 内部格付手法採用最終指定親会社が、第百四十四条の規定により

(期待損失額

第百二十六条 [同上]

 [項を加える。]

出については、前各項の規定を準用する。

出については、前各項の規定を準用する。)の期待損失額の算が含まれるときは、当該エクスポージャー(同条第一項に規定するが含まれるときは、当該エクスポージャー(同条第二項の場合において、保有エクスポージャーの裏付けとなる資産等に内部格付手法を適用するエクスポージャーの裏付けにの、同条第二項の場合において、保有エクスポージャーの裏付けについては、前各項の規定を準用する。

の額の合計額) (内部格付手法採用最終指定親会社における信用リスク・アセット

内部格付手法採用最終指定親会社の信用リスク・アセ

第百二十八条

合計額とは、次に掲げる額の合計額をいう。 内部格付手法採用最終指定親会社の信用リスク・アヤ

ットの額の合計額とは、

第百二十八条

ットの額の合計額とは、 式等エクスポージャー及び証券化エクスポージャーについて算出 により算出される信用リスク・アセットの額並びに特定項目のう 算出される信用リスク・アセットの額、 ク・ウェイトを乗じて得た額 等エクスポージャー 四十三条第 同時決済取引に係る信用リスク・アセットの額を含む。 した信用リスク・アセットの額(購入債権、 人等向けエクスポージャー、 条第一項に規定するリース料をいう。)、同時決済取引及び非 内部格付手法採用最終指定親会社が内部格付手法により事業法 一項第二号に掲げるPD/LGD方式の適用対象となる株式 の期待損失額に千二 次に掲げる額の合計額をいう。 リテール向けエクスポージャー、 第百四十四条第十項の規定により 第百五十六条の二の規定 百五十パ リース料 ーセントのリス (第百五十 第百 株

> )額の合計額) (内部格付手法採用最終指定親会社における信用リスク・アセット

のリスク・ウェイトを乗じて得た額、 四十三条第一項第二号に掲げるPD/LGD方式の適用対象とな 同時決済取引に係る信用リスク・アセットの額を含む。 式等エクスポージャー及び証券化エクスポージャーについて算出 第二条第一号の算式における普通株式等Ti より算出される信用リスク・アセットの額並びに特定項目のうち る株式等エクスポージャー した信用リスク・アセットの額(購入債権、 人等向けエクスポージャー、 条第一項に規定するリース料をいう。)、同時決済取引及び非 内部格付手法採用最終指定親会社が内部格付手法により事業法 の期待損失額に千二百五十パ リテール向けエクスポージャー、 第百五十六条の二の規定に リース料 е r 1 資本に係る調 (第百五十 -セント 第百

信用リスク・アセットの額の合計額ポージャー、その他資産及びリース取引における見積残存価額のに第百四十四条(第十項を除く。)の規定が適用されるエクスでに第百四十四条(第十項を除く。)の規定が適用されるエクス調整項目の額に算入されなかった部分に係るエクスポージャーの調整項目の額に算入されなかった部分に係るエクスポージャーの表の第二条第一号の算式における普通株式等Tier1資本に係る

み替えるものとする。 内部格付手法採用最終指定親会社」と読額の合計額。この場合において、同条中「標準的手法採用最終指 の合計額。この場合において、同条中「標準的手法採用最終指 で親会社」とあるのは「内部格付手法採用最終指定親会社が標準的手法を適用する部分 内部格付手法採用最終指定親会社が標準的手法を適用する部分

三・四略]

(マチュリティ)

第百三十五条 [略]

2 [略]

、一日以上の実効マチュリティを用いるものとする。は、一年の下限を適用しない。この場合において、マチュリティはエクスポージャーのうち契約当初の満期が一年未満のものについて3 第一項ただし書の規定にかかわらず、次の各号に該当する短期の

ー・二 略

三 短期かつ流動性の高い貿易関連偶発債務その他これに類するも

にその他資産及びリース取引における見積残存価額の信用リスク用リスク・アセットの額の合計額に一・○六を乗じて得た額並び整項目の額に算入されなかった部分に係るエクスポージャーの信

アセットの額の合計額

ストラック 一 内部格付手法採用最終指定親会社」と読 で親会社」とあるのは「内部格付手法採用最終指定親会社」と読 額の合計額。この場合において、同項中「標準的手法採用最終指 定親会社」とあるのは「内部格付手法採用最終指定親会社が標準的手法を適用する部分 二 内部格付手法採用最終指定親会社が標準的手法を適用する部分

三・四 同上]

(マチュリティ)

第百三十五条 [同上]

2 [同上]

3

同上

[一·二 同上]

三 短期かつ流動性の高い貿易関連偶発債務

 $\mathcal{O}$ 

四 [略]

[4~8 略]

(内部格付手法採用最終指定親会社における信用リスク・アセット

のみなし計算)

額をこの条に規定するところにより算出するものとする。 いときには、当該保有エクスポージャーの信用リスク・アセットのジャーの信用リスク・アセットの額を直接に算出することができなジャーの信用リスク・アセットの額を直接に算出することができな

でででは、当該保有エクスポージャーの信用リスク・アセットの額として用いるものとする。 では、当該保有エクスポージャーの信用リスク・アセットの額を等を実際に保有する事業体の総資産の額で除して得た割合を を資産等を実際に保有する事業体の総資産の額で除して得た割合を の資産等を実際に保有する事業体の総資産の額で除して得た割合を を資産等のエクスポージャーに関する情報が、次に掲げる を対して得た額を、当該保有エクスポージャーの裏 とは、当該エクスポージャーの額に当該裏 の額として用いるものとする。

得されていること。 当該内部格付手法採用最終指定親会社により十分かつ頻繁に取

二 独立した第三者により検証されていること。

額を算出するに当たっては、当該内部格付手法採用最終指定親会社クスポージャーの裏付けとなる資産等の信用リスク・アセットの総のが重視の場合において、内部格付手法採用最終指定親会社が保有エ

四[同上]

「4~8 同上」

(信用リスク・アセットのみなし計算)

ットの総額をもって当該エクスポージャーの信用リスク・アセット明らかなときは、当該裏付けとなる個々の資産の信用リスク・アセポージャーの信用リスク・アセットの額を直接に計算することがで第百四十四条 内部格付手法採用最終指定親会社は、保有するエクス

2 前項に規定する場合において、当該エクスポージャーの裏付けとなる資産の総額の過半数を株式等エクスポージャーの裏付けとなる資産の総額の過半数を株式等エクスポージャーの裏付けとなる資産の総額の過半数を株式等 当該エクスポージャーの裏付けとなる資産の総額の過半数を株式等 当該エクスポージャーの裏付けとなる資産の総額の過半数を株式等 きる。

、前二項の規定によることができない場合であって、当該エクスポーの信用リスク・アセットの額を直接に計算することができず、かつ3 内部格付手法採用最終指定親会社は、保有するエクスポージャー

の額とすることができる。

第 のは 得た額及び当該派生商品取引以外の派生商品取引の与信相当額並び 引の与信相当額 のEADとして算出した信用リスク・アセットの額とする」と、 により算出されるEADに 八条の規定を準用する。 に長期決済期間取引の与信相当額)」と読み替えるものとする」と る派生商品取引が含まれている場合にあっては、 引については、 の二第一 を当該裏付けとなる資産等を直接保有する者とみなして、 一百四十八条の二第一項各号に掲げる者以外の者を取引相手方とす 額」とあるのは 一号中 「与信相当額」 と 「信用リスク・アセットの額を含むものとし 項各号に掲げる者以外の者を取引相手方とする派生商品取 同条第一号中 「と読み替えるものとする」とあるのは 第百三十四条第五項又は第百四十二条第五項の規定 当該派生商品取引の与信相当額に とあるのは 「掲げる額 「信用リスク・アセットの額を含む」とある この場合において 五を乗じて得た額を当該派生商品取引 (第三号に掲げる額を除く。 与信相当額 (当該派生商品取引に第 同条中 オフ・バランス取 \_ كر 第二百四十八条 「掲げる額の合 ・五を乗じて 同条第 第百二十 の合計 同条 一号

る手法により算出するものとする。 のエクスポージャーの信用リスク・アセットの額を当該各号に定めのエクスポージャーの信用リスク・アセットの額を当該各号に定めのエクスポージャーの裏付けとなる資産等の信用リスク・アセットの総額を 第出するに当たっては、次の各号に掲げる当該裏付けとなる資産等 のエクスポージャーの信用リスク・アセットの総額を のエクスポージャーの信用リスク・アセットの総額を のエクスポージャーの信用リスク・アセットの総額を のエクスポージャーの信用リスク・アセットの総額を

読み替えるものとする。

| 内部格付手法採用最終指定親会社が第百二十四条第二項の規定

それぞれ当該各号に定める要件を満たさなければならない。することができる。ただし、次の各号に掲げる方法による場合は、セットの額を当該エクスポージャーの信用リスク・アセットの額とセットの額を当該エクスポージャーの信用リスク・アセットが大きくな、当該資産運用基準に基づき最も信用リスク・アセットが大きくなージャーの裏付けとなる資産の運用に関する基準が明らかなときは

| A Table | Table |

付と内部格付が紐付けされていること。格付」という。)が運用基準として用いられている場合、外部格機関等」という。)が付与する格付(以下この章において「外部外部信用評価機関又はそれに類する機関(以下「外部信用評価

におい る株式等エクスポージャー により株式等エクスポージャーに標準的手法を適用している場合 保有エクスポージャーの裏付けとなる資産等に含まれ 前条第三項第一号に掲げる手法

- 有エクスポージャーの裏付けとなる資産等に含まれる株式等エク スポージャー いて標準的手法を適用する旨を記載している事業単位における保 内部格付手法採用最終指定親会社が内部格付手法実施計画にお クスポージャーを除く。 (前条第 一項第二号に掲げる方式を適用する株式等 前号に定める手法
- 部格付準拠方式 含まれる証券化エクスポージャー 前号に規定する保有エクスポージャーの裏付けとなる資産等に 第二百三十四条に規定する外
- 6 5 額を算出しようとしたにもかかわらず、 信用リスク・アセットの総額を算出する場合にあっては、 該エクスポージャーに適用して当該総額を算出することができる。 ポージャーに関する情報が第三者により十分かつ頻繁に取得されて みを満たすことができず クスポージャーの裏付けとなる資産等の信用リスク・アセットの総 けとなる資産等のエクスポージャーの信用リスク・アセット いるときには、 次の各号に掲げる当該エクスポージャーの区分に応じて 前項の規定により保有エクスポージャーの裏付けとなる資産等の 内部格付手法採用最終指定親会社は、 当該第一 一者により判定されたリスク・ウェイトを当 かつ、 当該裏付けとなる資産等のエクス 同項第 第二項の規定により保有エ 一号に掲げる要件の 当該裏付

号に定めるところにより算出するものとする。

- ており、 保有するエクスポージャーの額が日次又は週次で時価評価され 当該評価額で解約又は第三者に売却できること。
- 二 保有するエクスポージャーが法第百九十三条の二第一項に規定 部監査を、年一回以上の頻度で受けていること。 する公認会計士又は監査法人による監査証明又はそれに準じる外
- 三 保有するエクスポージャーの裏付けとなる資産の運用に関する 業務を行う者が、主務官庁の監督を受けていること

5

- の信用リスク・アセットの額を直接に計算することができず、 内部格付手法採用最終指定親会社は、 保有するエクスポージャー 第
- 6 項及び第二項の規定によることができず、かつ、当該エクスポージ ポージャーの信用リスク・アセットの額とすることができる。 スポージャーの額に千二百五十パーセントを乗じた額を当該エクス ーの額に四百パーセントを乗じた額を、それ以外のときは当該エク 四百パーセントを下回る蓋然性が高いときは、当該エクスポージャ あって、裏付けとなる個々の資産のリスク・ウェイトの加重平均が スポージャー」と読み替えるものとする。 ャーの裏付けとなる資産の運用に関する基準が明らかでない場合で ・アセットの額を計算する場合について準用する。この場合におい 前条第二項の規定は、 前条第二項中「株式等エクスポージャー」とあるのは、 第一項又は第二項の規定により信用リスク ーエク

るのは して、 ものとする。 資産及び取引に適用するリスク・ウェイトに一・二を乗じる調整 する。この場合において、 ージャーを直接保有する内部格付手法採用最終指定親会社とみな 三条第三項第一号に掲げる手法に限る。)により」と読み替える を行うものとする。)」と、 「内部格付手法 株式等エクスポージャー 第百二十八条の規定 「第一号に掲げる額 (株式等エクスポージャーにあっては、 同条中「次に掲げる額の合計額」とあ (第一号に係る部分に限る。) を準用 (当該額の算出に当たっては、 前項の第三者を当該株式等エクスポ 「内部格付手法により」とあるのは 第百四十 個々の

する。 を行うものとする。 資産及び取引に適用するリスク・ウェイトに一・二を乗じる調整 るのは「第一号に掲げる額 えるものとする。 十四条に規定する外部格付準拠方式に限る。)により」と読み替 ージャーを直接保有する内部格付手法採用最終指定親会社とみな して、第百二十八条の規定 「内部格付手法(証券化エクスポージャーにあっては、 証券化エクスポージャー この場合において、 ر ح 同条中 (当該額の算出に当たっては、 (第一号に係る部分に限る。 前項の第三者を当該証券化エクスポ 「内部格付手法により」とあるのは 「次に掲げる額の合計額」とあ 第二百三 を準用 個々の

項の第三者を当該エクスポージャーを直接保有する標準的手法採

前二号に掲げるエクスポージャー以外のエクスポージャー

前

用最終指定親会社とみなして、

第十四条の規定を準用する。この

-11-

る資産等の信用リスク・ るときには、 満たすことができないときであって、 を実際に保有する事業体の総資産の づき最大となるように算出した保有エクスポージャーの裏付けとな 相当額 あるの 信相当額) 引以外の派生商品取引の与信相当額並びに長期決済期間取引の与 品取引の与信相当額に一・五を乗じて得た額及び当該派生商品取 場合にあっては、 げる者以外の者を取引相手方とする派生商品取引が含まれている たっては、 場合において、 トに一・二を乗じて得た値をリスク・ウェイトとして用いた上で 二号に掲げる額を除く。 ・二を乗じる調整を行うものとする」と、 と 「第三章第六節」 部格付手法採用最終指定親会社は、 同節」と、 は (当該派生商品取引に第二百四十八条の二第 第三節」 「第三章第四節」と、 保有エクスポージャーの額に、当該資産運用基準に基 」と読み替えるものとする。 個々の資産及び取引に適用するリスク・ウェイトに 同条第一号中 同条中 ٢ オフ・バランス取引の与信相当額、 とあるのは アセットの総額を当該裏付けとなる資産等 「額の合計額をいう」とあるのは 「同節」 の合計額とし、 第 第三章第三 とあるのは 二節 「与信相当額」 額で除して得た割合を乗じて得 資産運用基準が明示されてい とあるのは 第二項各号に掲げる要件を 節 当該合計額の算出に当 「当該リスク・ 「第六節」とあるのは とあるのは کر 「第三章第二節 当該派生商 項各号に掲 「第四節」 額 ウェイ 与信

7

することができる。

当該保有エクスポージャー

の信用リスク・アセットの額と

額を算出するに当たっては、 めるところにより算出するものとする。 ク・アセットの総額が最大となる裏付けとなる資産等の構成を想定 けとなる資産等のエクスポージャーの区分に応じて、 するものとし、 スポージャーの裏付けとなる資産等の信用リスク・アセットの総 スク・アセットの額を、当該構成における次の各号に掲げる裏付 当該裏付けとなる資産等のエクスポージャーの信用 同項の資産運用基準に基づき信用リス 当該各号に定

内部格付手法 のとする。 条第三項第一号に掲げる手法に限る。)により」と読み替えるも この場合において、 第百二十八条の規定 社を当該株式等エクスポージャーを直接保有する者とみなして、 「第一号に掲げる額」と、 株式等エクスポージャー (株式等エクスポージャーにあっては、 同条中 ( 第 一号に係る部分に限る。 「次に掲げる額の合計額」とあるのは 「内部格付手法により」とあるのは 当該内部格付手法採用最終指定親会 を準用する。 第百四十三

四条に規定する外部格付準拠方式に限る。 内部格付手法 この場合において、 第百二十八条の規定 社を当該証券化エクスポージャーを直接保有する者とみなして、 第一 証券化エクスポージャー 号に掲げる額」と、 (証券化エクスポージャーにあっては、 同条中 (第一号に係る部分に限る。 「次に掲げる額の合計額」 「内部格付手法により」とあるのは 当該内部格付手法採用最終指定親会 により」と読み替え )を準用する。 第二百三十 とあるのは

るものとする。

整を行った上で信用リスク・アセットの額を算出するものとする。 ときには、次の各号に掲げる割合に当該各号に定める値を乗じる調 より保有エクスポージャーの信用リスク・アセットの額を算出する のは を超える場合には、 与信相当額並びに長期決済期間取引の与信相当額)」と読み替え バランス取引の与信相当額、 引に第二百四十八条の二第 う」とあるのは 接保有する標準的手法採用最終指定親会社とみなして、 該内部格付手法採用最終指定親会社を当該エクスポージャーを直 るものとする。 手方とする派生商品取引が含まれている場合にあっては、 の規定を準用する。 内部格付手法採用最終指定親会社が、 と 前 五を乗じて得た額及び当該派生商品取引以外の派生商品取引の 第 「第三章第三節」と、 一項の割合 一号に掲げるエクスポージャー 当該調整の結果として得られる割合が千二百五十パーセン 節 「与信相当額」とあるのは 「第六節」とあるのは とあるのは 額 事業体の総資産の額を純資産の額で除して得た 当該割合は、 この場合において、 (第二号に掲げる額を除く。 第三章第一 「第四節」 当該派生商品取引の与信相当額に 項各号に掲げる者以外の者を取引相 「第三章第六節」 千二百五十パーセントとする。 「与信相当額 以外のエクスポージャー とあるのは 節 第二項又は第七項の規定に 同条中 ٢, (当該派生商品取 「額の合計額をい 「第三節」 ۲ 「第三章第四節 の合計額をい 同条第一号 オフ・ とある 当

9

値

て許容される最大のもの 常七項の割合 前号に定める値であって、資産運用基準におい

| 一に用いて信用リスク・アセットの額を算出することができる。| 満たすことができず、かつ、第七項の適用を受けることができない。次の各号に掲げる比率である蓋然性が高いことを疎明したときに、次の各号に掲げる比率である蓋然性が高いことを疎明したときには、当該各号に掲げるといって、保有エクスポージャーのリスク・ウェイトについては、当該各号に掲げる要件を

二 二百五十パーセントを超え四百パーセント以下 四百パーセン 二 二百五十パーセント以下 二百五十パーセント

11 内部格付手法採用最終指定親会社は、第二項各号に掲げる要件を あリスク・ウェイトを用いて信用リスク・アセットの額を算出する できないときには、保有エクスポージャーに千二百五十パーセント できないときには、保有エクスポージャーに千二百五十パーセント

(情報の利用)

第百六十三条 [略]

2 [略]

格付を付与し、又はエクスポージャーをプールに割り当てる際の主3.内部格付手法採用最終指定親会社は、エクスポージャーに対して

(情報の利用)

第百六十三条 [同上]

2 同上

3

格付を付与し、又はエクスポージャーをプールに割り当てる際の主、内部格付手法採用最終指定親会社は、エクスポージャーに対して

「外部格付」という。)を用いる場合は、それ以外の関連する情報与する格付(第百七十八条第二項第三号及び第百九十一条において一条第三項第三号において「外部信用評価機関等」という。)が付要な要素として外部信用評価機関又はそれに類する機関(第百九十

(株式等エクスポージャーに対する内部モデル手法の承認)

も考慮に入れるものとする。

融庁長官の承認を受けるものとする。
七項に規定する内部モデル手法を用いるときには、あらかじめ、金第二百十七条 内部格付手法採用最終指定親会社は、第百四十三条第

(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)

第

・アセットの額は、次の算式により算出した所要自己資本額(KCMi)二百四十八条の八 適格中央清算機関に係る清算基金の信用リスク

.一~四 略]

に十二・五を乗じて算出する。

の額の割合に応じた額とする。 立分ごとに算出する。この場合において、DFccpが当該区分ごとに が別管理されていないときは、当該区分ごとのDFccpは、とiEADi が別管理されている場合には、第一号の所要自己資本額は、当該 の額の割合に応じた額とする。

[六・七 略]

も考慮に入れなければならない。要な要素として外部格付を用いる場合は、それ以外の関連する情報

(株式等エクスポージャーに対する内部モデル手法の承認)

受けなければならない。

一受けなければならない。

一受けなければならない。

一で、第百四十四条第四項において準用する場合を含む。)に規定
第二百十七条 内部格付手法採用最終指定親会社は、第百四十三条第

(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)

第二百四十八条の八 [同上]

[一~四 同上]

[六・七 同上] 「六・七 同上] 「六・七 同上] 「六・七 同上] 「六・七 同上]

備考	2
表中の[ ]の記載及び対象規定の二重傍線を付した標記部分を除く全体に付した傍	[略]
	2 [同斗]