、次の各号に掲げ	
準行であり、かつ	
項は、自己が国内基は	
第七十九条第二 標準的手法採用行 標準的手法採用行	
る。	
げる字句は、同表の下欄に掲げる字句と読み替えるものとす	
用については、次の表の上欄に掲げる規定中同表の中欄に掲	
百六十五条第四項並びに第二百七十条の七第一項の規定の適	
。)第七十九条第二項及び第三項、第百五十七条第六項、第	
の基準(以下この条及び次条において「新銀行告示」という	
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	
条の二の規定に基づき、銀行がその保有する資産等に照らし	
第二条 当分の間、第一条の規定による改正後の銀行法第十四	[条を削る。]
当額の算出に係る経過措置)	
(銀行における派生商品取引及び長期決済期間取引の与信相	
(適用時期)	
附 則	附 則
改正前	改正後
る。に対応する改正後欄に掲げる規定の破線で囲んだ部分のよ三号)	め、改正前欄に掲げるその標記部分に二重傍線を付した条の表により、改正前欄に掲げる規定の破線で囲んだ部分をための基準等の一部を改正する件(平成三十年金融庁告示イミ等・2000年の共享に基づる。銀行大学の代刊で表
1等こ尺,つし自己資本の乞夷の犬兄が畜当であるかどうかを到折	〇一根亍去符卜囚条の二の見官こ甚づき、限亍がその呆勻計る貧蘣

第		条第四項中「前三	
日本		」と、第七十	
日本		部格付手法採	
 七十九条第三 標準的手法採用 一方本中の EAD において 一ジャーの EAD において 一ジャーの EAD にこの場合において 一ジャーの EAD にこの場合において 一ジャーの EAD にこの場合において 一ジャーの EAD にこの場合において 一ジャーの EAD にこの場合においた 一が中日の EAD において 一が中日の EAD にこの場合においた 一が中日の EAD において 一が中日の EAD に	もの	」とあるの	
 七十九条第三 標準的手法採用 一ジャーの EADに この場合において の規定は、事業法 ージャーの EADに この場合においるの力を発力に この場合においるの力を発力に この場合においるの力を発力に この場合においるの別を サークスポークスポークスポークスポークスポークスポークスポークスポークスポークスポ	行」と読み替	準的手法採	
 七十九条第三 標準的手法採用行 標準的手法採用行 標準的手法採用行 標準的手法採用行 内別定は、事業法 ージャーの EAD に この場合においる カ条の三の六まで 人等向けエクスポ ついて準用する クッ から第七十 の規定は、事業法 ージャーの EAD 人等向けエクスポ ついて準用する カージャーの EAD 人等向けエクスポ ついて準用する カージャーの EAD 人等向けエクスポ ついて準用するの四ま	部格付手法	れらの規定	
1	行」とあるの	の場合におい	
項 の規定は、事業法 ージャーの EADに この場合においる 可 人等向けエクスポ ついて準用する 人等向けエクスポ 一ジャーの EADに 人等向けエクスポ 一ジャーの EADに	「標準的手法	いて準用する	
 る銀行のいずれに も該当しない場合 にあっては 準行であり、かつ が前項各号に掲げ る銀行のいずれに において において において の規定は、事業法 ージャーの EAD 人等向けエクスポークスポープンであります 	の場合におい	ヤーの EAD	
項の規定は、事業法ージャーのEAD可の規定は、事業法ージャーのEAD可の規定は、事業法のの規定は、事業法のの規定は、事業法のの規定は、事業のの規定は、事業のの規定は、事業のの規定は、事業のの規定は、事業のの規定は、事業のの規定は、事業のの規定は、事業のの規定は、事業法のの規定は、事業法のの規定は、事業法ののの <td>いて準用する</td> <td>等向けエクス</td> <td></td>	いて準用する	等向けエクス	
項 大条角 一 大条の三の六まで 人等向けエクス 項及び第三項を除 七十九条の四ま 市五十七条第 第七十九条(第二 第七十九条の四ま 市五十七条第 第七十九条(第二 第七十九条の四ま 市五十七条第 第七十九条(第二 第七十九条の四ま 市五十七条第 第七十九条の四ま 第七十九条の四ま 市 1 1 市 1 1 市 1 1 市 1 1 市 1 1 市 1 1 市 1 1 市 1 1 市 1 1 市 1 1 市 1 1 市 1 1 市 1 1 市 1 1 市 1 1 市 1 1 市 1 1 日 1 1 日 1 1 日 1 1 日 1 1 日<	ヤーの EAD	規定は、事業	
項る銀行のいずれに日も該当しない場合おにあってはは、自己が国内基がおも該当しない場合においてにおいてにおいて第七十九条(第二 第七十九条の四までおいずれに第七十九条(第二 第七十九条から	等向けエクス	条の三の六ま	
項 項及び第三項を除 七十九条の四ま	規定は、事業	。)から第七	
百五十七条第 第七十九条第三 標準的手法採用行 標準的手法採用行 七十九条第三 標準的手法採用行 標準的手法採用行 は、自己が国内基 が る銀行のいずれに が において が において が において が	十九条の四ま	及び第三項を	
る銀行のいずれに も該当しない場合 にあっては が 準行であり、かつ 準行であり、かつ であり、かつ を該当しない場合 にあっては であり、かつ であり、かつ であり、かつ であり、かつ であり、かつ	七十九条から	七十九条(第	百五十七条
セ十九条第三 標準的手法採用であり、かつ は、自己が国内基 が 準行であり、かつ 準行であり、かつ が 1 標準的手法採用行 標準的手法採用 が 1 標準的手法採用 が 1 標準的手法採用 が 1 標準的手法採用 1 を該当しない場合 1 を 1 で 1 で 1 で 1 で 1 で 1 で 1 で 1 で 1 で		おい	
る銀行のいずれに 七十九条第三 標準的手法採用行 標準的手法採用 は、自己が国内基 が 準行であり、かつ 準行であり、かつ		該当しない場	
・ 前項各号に掲げ・ も該当しない場合・ は、自己が国内基が		銀行のいずれ	
準行であり、かつは、自己が国内基がは、自己が国内基がががががががのいずれに		項各号に掲	
七十九条第三 標準的手法採用行 標準的手法採用行 にあっては 標準的手法採用		行であり、か	
七十九条第三 標準的手法採用行 標準的手法採用 にあっては はあっては	が	、自己が国内	項
あってはい場のいずれ	準的手法採用	準的手法採用	七十九条
該当しない場		あって	
銀行のいずれ		該当しない場	
_		銀行のいずれ	

	中	
	を除く。)の規定	
	第二項及び第三項	七第一項
同章の規定中	同章(第七十九条	第二百七十条の
	るものとする。	
	一項」と読み替え	
	」とあるのは「第	
	第四項中「前三項	
	」と、第七十九条	
	部格付手法採用行	
ものとする。	」とあるのは「内	
行」と読み替える	標準的手法採用行	
内部格付手法採用	これらの規定中「	
行」とあるのは「	の場合において、	
「標準的手法採用	いて準用する。こ	
の場合において、	ジャーの EAD につ	
いて準用する。こ	ル向けエクスポー	
ジャーの EAD につ	の規定は、リテー	
ル向けエクスポー	九条の三の六まで	
の規定は、リテー	く。)から第七十	
七十九条の四まで	項及び第三項を除	四項
第七十九条から第	第七十九条(第二	第百六十五条第
	えるものとする。	
	第一項」と読み替	
	項」とあるのは「	

2 式 示 加 係 各 出 算 1 間 1項の規 が 者 る を 第 す 参 ジ 接 る場 Ł 用 七 できる。 に ヤ 加 清 部 対] +0) 11 者 算 格 するト 定に に て 九 合 に に 参 付 ٧١ 条の四に 対 限 に 係 加 手 パするト おい る清 より る。) るときは、 者 法 \mathcal{O}] 算出 て、 算 適 用 に ٠ ١ 規定するカレント 取 格 次の掛目を 当 該 次 で L 当 エ た ド ぎ 央 あ ークスポ 分の 等 清 EAD・エクスポ る EADを行 銀 算 間 機 行 乗じ ージ \mathcal{O} うことに 関 (当該エクスポ は 算 新 向 銀行 ヤ た額を当該 出] け 直 工 1 ジャー に当たって新 \vdash 接 0) 告示 クス ょ 清 レ ŋ 1 算 EAD第 ポ 参 \mathcal{O} 生 ド ージ 間 ージ 百 ず EAD加 とするこ 接 五. る 工 者 とし 清 ヤ ヤ 間 銀]] 算 七 行 を 接 ス に 条 方 告算 ポ て

 $\mathbb{H} = \sqrt{\text{(Tm/10)}}$

薙

Tm屈 同項中 ネ 艦 出したリスクのマージン期間をいう。こ は、新銀行告示第七十九条の三 及び「ネッティ ツティング・ 中日「ネッティング・ 前 項」 セット \sim グ・ あるのは「附則第二条第二項」 セット Ŧī. 営業 セ ット 日 第七項の + ·営業日」 二十営業 と読み替 の場合)規定 \sim Nr H 日 PH Ø \mathcal{O} 業 ださん 0) IJ Œ \cap \wedge \mathbb{H} 9 94 回 5

3

前

項

 \mathcal{O}

規

定

は、

手

法採用

行

であ

行

け

工

クス

参 ポ

]

丨格

0

て、

自

己

向が

接銀

清

参

加リ

者テ

清

加

のヤ部

適

格で付

中あ

央清

算

機

関

け直る

1

V

| 算が

ĸ

工

ク

接スしル

清ポて向

加ヤ

者 | 算

に

対 係

ける

F

エ

ク

ス

ポ

ジ

ヤ

0

FAD 電

ジ

に

る者ジ内

清

。 ド レ 取

次

ぎ等を行うことに

ょ

ŋ

生

ず

「する場

一合に

0

いて準

用

す

う る。

- 4 -

銀 行に お け る適 格 中 央 清 算 機 関に 係 る 経 過

う す 正 \mathcal{O} に うる資産 条 ょ 旧 カュ 前 意 る。 · を 判 の銀 銀 義 行 は 等に 告 断 行 分 する 同 法 \mathcal{O} 示 照 第 号 間 た 5 という。) + \mathcal{O} \otimes L 兀 規 新 自 条 定 銀 \mathcal{O} 基 己 \mathcal{O} に 行 準 資 カュ 告 第一条第七号の三に 本 \mathcal{O} か 示 次項 0 規 わ 第 6 充 定 条第七 ず、 及 実 に び \mathcal{O} 基づき、 附則第 状 第 号 一条 況 0 が 適当 三に + 銀 0 措 定めるとこ 規 行 置 条 で が 定 掲 に あ そ に げ お \mathcal{O} る ょ る か 保 11 る 用 7 Ŀ 有 改 語

2 ず、 規 1 定 \mathcal{O} によ 額 分 適 格 0) \mathcal{O} り 算 中 間 算 出 央 出 清 に当 新 するも 算 銀 「たって 機 行 告 関 0 示第二 に とす は 係 る る。 。 百 清 旧 銀 算 七 行 基 + 告示 金 条 \mathcal{O} 0) 第二百 信 八 0 用 IJ 規 七十 ス 定 ク に カュ 0 T か 八 セ わ \mathcal{O} ツ

 \mathcal{O} 与 銀 信 行 相 持 当 株 額 숲 \mathcal{O} 社 算 に 出 お に け 係 る る 派 経 生 過 商 措 品 置 取 引 及 び 長 期 決 済 期 間 取 引

[条を削る。]

句 条 + 以 \mathcal{O} 及 兀 下この 第四 は、 て 七 充 び 条の二 条 条第二 は、 実の その 項 同 当 並 状 子 +分 表 次 条 会 項 及 \mathcal{O} \mathcal{O} び 況 五 \mathcal{O} に 及び が 間 下 表 び 社 \mathcal{O} 第 適 規 0) 次 \mathcal{O} 第三 第二 上 条 当 保 に 定 「であ 百四四 掲 欄 有する資 に に 基 項、 げ に お 条 る字 掲 + る づ \mathcal{O} 71 げ 八 か き、 規 第百三十五条第六項、 て どうか 条の七 句 産 定 る 「新 等 と 規 銀 に による改 読 定 に 行 持 を判断 第 み 中 照らしそ 持株会社 株告 替 同 項 えるも 表 正 示 \mathcal{O} 0) す 後 っるため 中 規 れ が لح 0 欄 定 0) 銀 5 銀 V とする に掲 \mathcal{O} \mathcal{O} 第 行 行 . う。) 適 百 \mathcal{O} 自 持 法 1己資 用 兀 基 げ 株 第 十三 る 準 第 会 に 五. 五 本 社 十

`		つ	1		の	七	<	六項 項	第百三十五条第一第	な	い	る	`	準	項 は	第五十七条第三	は	な	₹\	る	`	準	項 は	第五十七条第二
これらの規定中	この場合において	いて準用する。	-ジャーの EAD に	八等向けエクスポ	規定は、事業法	1条の三の六まで	、。) から第五十	及び第三項を除	祝五十七条 (第二	い場合において	ずれにも該当し	。銀行持株会社の	前項各号に掲げ	千行であり、かつ	い自己が国内基	你準的手法採用行	10	い場合にあって	ずれにも該当し	。銀行持株会社の	次の各号に掲げ	千行であり、かつ	は、自己が国内基	你準的手法採用行
「内部格付手法採	用行」とあるのは	、「標準的手法採	この場合において	ついて準用する。	ージャーの EAD に	人等向けエクスポ	の規定は、事業法	五十七条の四まで	第五十七条から第						が	標準的手法採用行							は	標準的手法採用行

	一項」と読み替え	
	」とあるのは「第	
	第四項中「前三項	
	」と、第五十七条	
	部格付手法採用行	
ものとする。	」とあるのは「内	
行」と読み替える	標準的手法採用行	
内部格付手法採用	これらの規定中「	
行」とあるのは「	の場合において、	
「標準的手法採用	いて準用する。こ	
の場合において、	ジャーの EAD につ	
いて準用する。こ	ル向けエクスポー	
ジャーの EAD につ	の規定は、リテー	
ル向けエクスポー	七条の三の六まで	
の規定は、リテー	く。) から第五十	
五十七条の四まで	項及び第三項を除	四項
第五十七条から第	第五十七条(第二	第百四十三条第
	えるものとする。	
	第一項」と読み替	
	項」とあるのは「	
	条第四項中「前三	
	行」と、第五十七	
	内部格付手法採用	
るものとする。	行」とあるのは「	
用行」と読み替え	「標準的手法採用	

		することがで
スポージャーの EAD	するトレード・エク	接清算参加者に対
目を乗じた額を当該間	に限る。) に次の掛り	ジャーに係るもの
EAD(当該エクスポー	定により算出した E	三十五条各項の規
の間、新持株告示第百	ているときは、当分	ジャー方式を用い
カレント・エクスポー	条の四に規定する	新持株告示第五十七
EAD の算出に当たって	合において、当該	EAD を算出する場
・エクスポージャーの	に対するトレード・	る間接清算参加者
を行うことにより生ず	に係る清算取次ぎ等	エクスポージャー
算機関向けトレード・	参加者の適格中央清算	者として間接清算
会社は、直接清算参加	用行である銀行持株・	2 内部格付手法採
	中	
	を除く。)の規定	
	第二項及び第三項	の七第一項
同章の規定中	同章(第五十七条	第二百四十八条
	るものとする。	

掛目 = $\sqrt{\text{Tm} / 10}$

3

前項の規定は、

内

部格付手

法採用行である銀行持株会社が

0 生 F 参 ずる間接 加 IJ EAD を算出 テー 者とし エクスポ ル て 向 清算参 ージ 間 け する場合について準用する。 接 工 ヤーに 加 清 ク 者に対するト 算参 ス ポ 係る清算取 加 1 者 ジ \mathcal{O} ヤ 適 1 レー 格 で 次ぎ等を行うことに 中 あ -央清 ド って、 · 工 算 クスポ 機 自 関 己 向 が] け 直 接 ジ \vdash ょ ヤ 清] 算

断 L 会社が銀 正 \mathcal{O} 五. それ 意義 (銀行: 条 するため 前 の銀 条第 5 は 持 七 \mathcal{O} 行 行 分 株 自己資 号 持 同 0 会 0) 法 の三に 株 社 第 間 基 号 に 会社 準 五. 0) 十二条 本の充実 規 新 お 次 定に 及び 定めるところによる。 持 け 株 る 項に その 0) カコ 告 適 \mathcal{O} か 格 示 お 子会社 一十五の 状況 第 わ 中 į١ らず、 央清 て 一条第七号の三に掲 が 「旧持株告示」という。) 算 適当であるかどうかを 0 規定に基づ 保有 機 第二条の 関に する資 係 き、 規 る 産 定 経 等に 過 銀 に げ 行持 よる る 照 用 置 5 株 改 語

[条を削る。]

2 ツト 八 5 ず、 当 規定に 分の の額 適 間、 \mathcal{O} 格 より 算出 中 央清 新持 算出 に当 算機 株 たっ するもの 告示第二 関 て に は、 係 百四四 とする。 る清算 旧持 + -八条の 株告示第二百四 基 金の 信 八 0 用 規 IJ 定 ス + ク に カュ 条 ア か 0) セ わ

決 信 済期 用 金 間 庫 取 及 引 び 0 信 与 用 金庫 信 相 当 連 額 合 会に 0 算 出 お に け る派 係 る経 生 過 商 措 品 置 取 引 及 び 長

に 六 基づき、 + 条 -九条第 照 5 当 L 分 信 自 \mathcal{O} 項 己 用 間 資 に 金 第三 本 庫 お 0) 及 1 条 7 充 び 実 信 準 \mathcal{O} 0) 用 規 用 金 す 定 状 る 況 庫 に が 連 銀 よる改正 適 合会がその 行 法第 当であ + 後 るか 兀 \mathcal{O} 保 条 信 どう 有 \mathcal{O} 用 す 金 んる資 か \mathcal{O} 庫 を 規 法 丰川 産 定 第

			六項	第百五十六条						項	第七十三条第						項	第七十三条第
定は、事業法人等	五条の六までの規	く。)から第七十	項及び第三項を除	《第一第七十三条(第二	て	しない場合におい	のいずれにも該当	は信用金庫連合会	掲げる信用金庫又	庫は、前項各号に	第三 標準的手法採用金	ては	しない場合にあっ	のいずれにも該当	は信用金庫連合会	掲げる信用金庫又	庫は、次の各号に	然二 標準的手法採用金
ャーの EAD につい	向けエクスポージ	定は、事業法人等	七十六条までの規	第七十三条から第						庫が	標準的手法採用金						庫は	標準的手法採用金

るものとする。
の中欄に掲げる字句は、同表の下欄に掲げる字句と読み替えの規定の適用については、次の表の上欄に掲げる規定中同表の規定の適用については、次の表の上欄に掲げる規定中同表系」という。)第七十三条第二項及び第三項、第百五十六条断するための基準(以下この条及び次条において「新信金告

										四項	第百六十四条第													
とあるのは「内部	的手法採用金庫」	らの規定中「標準	合において、これ	準用する。この場	ーの EAD について	けエクスポージャ	定は、リテール向	五条の六までの規	く。) から第七十	項及び第三項を除	第七十三条(第二	えるものとする。	第一項」と読み替	項」とあるのは「	条第四項中「前三	庫」と、第七十三	部格付手法採用金	」とあるのは「内	準的手法採用金庫	れらの規定中「標	場合において、こ	て準用する。この	ヤーの EAD につい	向けエクスポージ
ものとする。	庫」と読み替える	部格付手法採用金	」とあるのは「内	準的手法採用金庫	合において、「標	準用する。この場	ーの EAD について	けエクスポージャ	定は、リテール向	七十六条までの規	第七十三条から第							るものとする。	金庫」と読み替え	内部格付手法採用	庫」とあるのは「	標準的手法採用金	場合において、「	て準用する。この

2 より算出 るときは、 六条に規定するカレ 合において、 に に 参 八 第 対 係 加 内 第 ド ハするト る清 者 Ш 部 に 百 _ | | | の適 格 項 次の 七 算取 した 付 当分の + エクスポー レ 格中央清算機 (Tm/10)手 掛 当該 条 1 次ぎ等を行うことにより生 法 EAD(当該 目を乗じた額を当該 ĸ 0) 採 間、 用 EAD第二 るも 金庫 中 ント を 同 エ クスポ 項」 章 لح ジ 新 除 ばく。)の規定一項及び第三項 のとする。 あ ヤー 信 0) 関 は、 (第七十 エクスポ لح 算出 金 エ 向 る 告示第 クスポ 0 1 読 け \mathcal{O} 直 -ジャー ŀ EADとすることができる。 に当 接 4 は 前 レ 清 替 間] 百五 条 第項条庫 たって新] 1 算 え ジ ージャー 接 0) F 参 ヤー 清 十六条各 一ずる間 加 同 EAD算 エ 者 章 - 方式を1 クス とし 参 に係るも 信 0 を算出 加 金告 接 規 者に ポ 項 清 7 定 用 \mathcal{O} 示 算 間 する 対 \mathcal{O} 規 第 接 11 ジ す 定 に て 七 加 ヤ 清 る 限 に 11 +算

第

兀

項

中 第 法

> 七 採

+ 用

格

付

手

金

Tm /t, -4 + 「 前 リスクのマージン期間をいう。 新信金告示第七十五 「ネッティング・ 項」 \cap Ħ るのは セ 「附則第 ット 条第七項の規定 二十営業日」 六条第二項」 (1 の場合において を準用 とあり \wedge Πĺ 4]項第 衅 耳 Œ

る 加 ヤ 清 ク 場 者] 算 ス 前 ツ i に 対 合に に係 参 ポ テ 項 加 0 イ つ す る 者 ジ 規 グ・ 1 る ヤ 清 \mathcal{O} 定 トレ 算 て準 1 適 は、 取 格 で セ 次ぎ等 用] ット 中 あ 内 する。 央清 K 0 部 て、 格 工 を 算 付 五. ク 行うことに 機 自 営 手 ス 業 関 己 法 日 ポ 向 が 採] 直 け 用 ジ \vdash 接 \sim 金 より 清算 読み ヤ レ 庫]] が、 0) 生 参 ド 替 一ずる間 加 IJ $\mathcal{N}_{\mathbf{r}}$ テ エ 者 Ŋ 50 B ク と] を 接 ス L ル 算出 清 ポ 7 向 間 一 か な な 算 1 け ジ 接

3

ィネ

ツ

テ

イ

グ

セ

ツ

1

+

営

業

日

 \cap

H

Ø

のは、

係 る 信 経 用 過 金 措 庫 置 及 び 信 用 金 庫 連 合会に お ける適 格 中 央 清 算 機 関 に

金 で が 第 正 \mathcal{O} 七 告 あ そ + 前 意 条 る 匹 義 \mathcal{O} 示」とい \mathcal{O} 信は 保 カュ 条 当 どう 有 \mathcal{O} 用 分 する資 <u>-</u> 同 金 \mathcal{O} v う。) かを 庫 号 間 規 法 \mathcal{O} 判 産 定 第 規 新 第 断す 等 に 八 定 信 基 +に に 金 条第七 るため 照 づ 九 か 告 き、 5 条 か 示 第 わ L 第 号 自 \mathcal{O} 5 信 \mathcal{O} 基 ず、 項 条 己 用 三に 第七 準 資 金 12 において 本の 第三条 庫及 次 号 定 めるところ 項 充 び 0) 三に 準 に 信 0 実 規 お \mathcal{O} 用 用 11 状 金 す 定 掲 る て 況 庫 に げ に が 連 銀 ょ る ょ 旧 適 合 行 る 用 る 信 当 슾 法 改 語

規 1 ず 定 \mathcal{O} 分 額 に 適 ょ 格 \mathcal{O} \mathcal{O} 間、 り 算 中 算 出 央 に当 清 Ш 新 す 算 信 る 「たって 機 金 関 告 ŧ 0) に 示 とする。 は 係 第 る 百 旧 清 信 算 七 金 基 + 告 条 金 示 \mathcal{O} \mathcal{O} 信 第 九 用 0 百 IJ 規 ス 七 定 + ク に 条 か \mathcal{O} T か 九 セ わ 0)

第 条状組法 表に項 る 八 引 合連合、 第二百 第十四 及び \mathcal{O} 及 況 金 条 の信 が 上 び 与 用 融 第 適 欄 次 事 信協 当 三項、 当である 条に 会が 業に に 兀 条 分 同 相 十六条 0 掲 0) 当 組 <u>ニ</u>の げ その 関 間、 合等 お 額 る 第 るかどうか V す \mathcal{O} 衆の六第一項の規定の現百三十二条第六項、 る法 規 て 保 規定に基づ 第 算 に 定中 有す 四 出 お 律 新信 条 に け る資 :第六 同 \mathcal{O} 係 る 表 を 規 る 派 組告示」という。) 産等に 条第 判断するため き、 定に \mathcal{O} 経 生 中 過 商 よる改 欄 措 信 品 照らし 用協同 項にお に 置 \mathcal{O} 取 掲げ 適用 第百四 引及 正 る字句 自 に \mathcal{O} 組 **\ 後 び 1己資 長期 合及 2 + 基 て \mathcal{O} 第 · 条 第 準 準 11 協 五 は、 て 以 本 び 用 同 決 +は 兀 の信 済 す 組 条 下こ 項 用 期 同 充 る 合 第 表 次 並 実 協 間 銀 に \mathcal{O} \mathcal{O} び \mathcal{O} \mathcal{O} 同行 ょ 取

下欄に掲げる字句と読	こ読み替えるものとする。	る。
第五十条第二項	標準的手法を採用	標準的手法を採用
	する信用協同組合	する信用協同組合
	等は、次の各号に	等は
	掲げる信用協同組	
	合等のいずれにも	
	該当しない場合に	
	あっては	
第五十条第三項	標準的手法を採用	標準的手法を採用
	する信用協同組合	する信用協同組合
	等は、前項各号に	等が
	掲げる信用協同組	
	合等のいずれにも	
	該当しない場合に	

	項	第百四十条第四																			項	百三十二条第六	
条の六までの規定。)から第五十二	及び第三項を除く	第五十条(第二項	ものとする。	項」と読み替える	とあるのは「第一	四項中「前三項」	」と、第五十条第	る信用協同組合等	格付手法を採用す	とあるのは「内部	信用協同組合等」	的手法を採用する	らの規定中「標準	合において、これ	準用する。この場	一の EAD について	けエクスポージャ	は、事業法人等向	条の六までの規定	。)から第五十二	及び第三項を除く	第五十条(第二項	おいて
エクスポージャーは、リテール向け	十三条までの規定	第五十条から第五							ものとする。	等」と読み替える	する信用協同組合	部格付手法を採用	」とあるのは「内	る信用協同組合等	準的手法を採用す	合において、「標	準用する。この場	ーの EAD について	けエクスポージャ	は、事業法人等向	十三条までの規定	第五十条から第五	

					2																			
新信組告示第五十一	EAD を算出する場合にお	る間接清算参加者	エクスポージャー	者として間接清算が	内部格付手法を採		の六第一項	第二百四十六条																
組告示第五十三条に規定するカレン	いて、当該	に対するトレード・	に係る清算取次ぎ等を行	参加者の適格中央清算	採用する信用協同組合	除く。)の規定中	二項及び第三項を	同章(第五十条第	のとする。	」と読み替えるも	あるのは「第一項	項中「前三項」と	と、第五十条第四	信用協同組合等」	付手法を採用する	あるのは「内部格	用協同組合等」と	手法を採用する信	の規定中「標準的	において、これら	用する。この場合	の EAD について準	エクスポージャー	は、リテール向け
ント・エクスポージャ	EAD の算出に当たって	エクスポージャーの	で行うことにより生ず	昇機関向けトレード・	口等は、直接清算参加			同章の規定中							のとする。	」と読み替えるも	る信用協同組合等	格付手法を採用す	とあるのは「内部	信用協同組合等」	的手法を採用する	において、「標準	用する。この場合	の EAD について準

- 16 -

「条を削る。」

ることができる。 算 1 方式 参 に 条 各 加 係 者 を る 項 ものに 用 に対するト \mathcal{O} 規 V てい 定 (限る。) に により るときは、 算出 に F 次 L 0 エ 当 た 掛 クスポ 分 EAD目を乗じ 0 間] **(当** ジ 新 た額 該 ヤ 信 工 組 クスポ 告 0) を当該間 示 EAD第 1 百三 لح 接 ジ す 清 ヤ

 $\blacksquare = \sqrt{\text{ (Tm/10)}}$

薙

Tm /t, 屈 ツ ティ 中华 -たリスク 「ネ 「 前 「ネッ ツ 新信組告示第五 グ・ 項」 テ のタージン製 イ テ \cap セ ット グ イ HB. ン るのは グ・ セ 五. + ツ 営業日」 間をいう。この場合において セ 「附則第八条第二項」と、 | | \vdash ツ 籴 1 徭 + \downarrow 営業日」 二十営業 と読み替えるものと 項の規定 \sim 日 14 34 ·準用 るのは、 rH 5 回 4 4 屈 禅 ネ 回 ¥ 艦 E

3 \mathcal{O} 生 K 参 ず 加 IJ 前 EAD を算出 の間接 者とし テ 項 クス Ì \mathcal{O} ル 規 (清算参 て間接 ポ 向 定 ージ け は、 する場合について準用する。 工 ヤーに 加 清 ク 内 算参 者に対す ス 部 ポ 格 係 加] 付 る清算取 者 ジ 手 るト \mathcal{O} ヤ 法 適] を 格 レ で 採] 中 あ 次ぎ等を 用 -央清 ĸ 0 する信 て、 工 算 クスポ 行うことに 機 自 用 己 が 関 協 同 向] 直 け 組 接 ジ 1 合 清 ヤ ょ 算 が

信 用 協 同 組 合等 に お け る 適 格 中 央清算機 関 に 係 る 経 過 措 置

正の 九 前 意 条 義 0) 協 は 同 分 同 組 \mathcal{O} 合に 号 間 \mathcal{O} による金 規 新 定 信 に 組 融 か 告 事 か 示 · 業 に わ 第 5 条 ず、 関 以する法 宗第七号 第四条 律 \mathcal{O} :第六 三に 0 規 条第 定 掲 に げ よる る 項 用 に 改 語 「条を削る。

2 5 七 8 L 同 お ツ ず、 1 当 号 自 組い \mathcal{O} 分 \mathcal{O} \mathcal{O} 基 7 己 合 三 額 資 準 適 \mathcal{O} 準 及 に \mathcal{O} 格 間 本 び 用 次 中 定 す 算 \mathcal{O} 信 \Diamond 出 央 新 充 る 項 用 るところ 清 に 信 実 協 に 当 算 組 \mathcal{O} 同 行 お た 機 告 状 組 VI 0 関 示 況 合 第 て に て 第 に が 連 + ょ は 係 適 合 兀 旧 る 当 会が る 百 条 信 で 旧 清 兀 \mathcal{O} 組 信 算 + あ そ 告 組 基 六 る \mathcal{O} \mathcal{O} 示 告 条 カュ 保 規 金 という。) どうかを判 示 \mathcal{O} \mathcal{O} 有 定 第 信 す に 七 基 る 用 \mathcal{O} 資 づ 百 IJ 規 き、 兀 ス 定 産 第 断 +ク に 等 す 六 • か に 信 条 照 条 T か る 用 \mathcal{O} セわ 第 た 5 協

引 最 \mathcal{O} 与 終 信 指 相 定 当 親 額 会 \mathcal{O} 社 算 に 出 お に け 係 る る 派 経 生 過 商 措 品 置 取 引 及 び 長 期 決 済 期 間 取

七

 \mathcal{O}

規

定

に

ょ

ŋ

算

出

す

る

Ł

 \mathcal{O}

لح

する

あ 定 会 ス \mathcal{U} 指 指 る 親 社 + 親 社 ポ 第 定 定 カュ 会 及 条 る \mathcal{O} どうか 二百 親 親 社 規 び 及 カコ ジ 숲 そ 社 \mathcal{U} 定 会 及 当 う そ 社 社 び \mathcal{O} 分 及 t に 兀 子 カュ び 1 か +告 を そ \mathcal{O} \mathcal{O} 告 判 \mathcal{O} 法 を そ 子 方 カュ 八 示 間 示 条 判 式 子 \mathcal{O} 法 わ 第 断 人 等 子 5 と 第 断 人 \mathcal{O} 百 す 法 (第 人等 等 る 法 ず 七 す 五 V \mathcal{O} る + 人等 保 \mathcal{O} 五. 第 た 条 う た 保 条 最 兀 \otimes \mathcal{O} 有 \mathcal{O} \otimes 有 項 \mathcal{O} \mathcal{O} 終 条 \mathcal{O} 自 す 規 第 規 指 に 基 己 る 自 第 定 0 す 几 進 基 己 る 定 定 お 六 資 資 に + 項 準 資 資 に 親 V を 本 産 ょ 六 産 ょ 숲 7 定 \mathcal{O} る を 本 等 等 る社は用 条 定 改 0 第 \Diamond 充 に 第 める 充 照 に る 実 百 正 件 実 照 正 す 兀 \mathcal{O} 5 後 一十二条 項 件 \mathcal{O} 5 る 状 前 力 L \mathcal{O} (以 場 本 当 状 \mathcal{O} V 況 最 。 以 L 当 最 合 文 該 況 ン 下 が 終 \vdash 終 下 が 該 を 第 適 最 指 新 最 指 含 新 当 適 兀 終 定 終 最 最 旧 当 定 工 む項 で 指 親 に最 で 指 親 ク 及 終 終 あ 定 会

終

指

定

親

숲

社

告

示

لح

V

う。)

第

兀

+

七

条に

定

 \Diamond

る

لح

ろ

て、 る \mathcal{O} に 由 当 基 R 終 与 承 届 に 額 準 を 指 信 ŋ 前 与 ょ を算 用 認 け 日 項 定 相 先 ŋ を受け 親 出 に \mathcal{O} 当 1 渡 信 そ 出 お 規 て 会 額 たとき又は 相 定に 0 V 与 社 し を ス 当 算出 使 て て S 信 は、 たときを除 ワ 額 用 V か 相 を算 ツ 当 を る カュ 全 す プ Α 一ての 新 継 場 わ 額を算出 ることが 及 出 4.6 最 合 続 С び する方式をい ず、 き、 終 することが に C 派 オ 指 は R 生 プ これを継続して用い 最終指 ショ することが 定 を 商 できる。 親 用 あ 品 ンその 会社告示第四 5 V 取 引に で て 定親会社 カュ . う。 この場 きな 派 じ しめ、 できな つい 生 他 以 商 V \mathcal{O} 下同 が、、 て、 合に 派生 B 品 旨 +を む 取 じ るも 九 金 S お を 引 直 商 条第 融 得 71 品 \mathcal{O} 近 A て、 を 0 庁 与 な \mathcal{O} 取 ځ 引 長 算 用 1 信 \mathbf{C} 項官 す 理 相 出 С 最の

2

3 き 引と長期 用 に する。 規 前二 %定する 項 この 決 \mathcal{O} 長 規 済 場合 期決 定 期 間 は、 に 済 取 お 引 期 新 間 に 1 最 て、 終指 取 0 V 引 て異 最 \mathcal{O} 定 終 与 親 会社 指信 なる方式 定親会社 相 当額 告示第四 を 用 \mathcal{O} は、 算 十六 出 ること 派 に 条 生 0 第 V 商 が 品 7 で 取 準 項

ŋ \mathcal{O} 金 て、 一融資産 算 間 先渡、 出 力 条 する V 旧 最 担 ン 最 ŧ 終 保 1 終 ス 指 を用 \mathcal{O} 指 ワ とす 定 工 ツ 定 親 V ク プ 親 会社 رِّ م ると 会社 ス 及 び ポ 告 き 才 が \mathcal{O} ジ ブ 包 示 シ 第 括 t エ ク 彐 的 章 ス ン 手 方 · 第 六 ポ 式 等 法 を適 を \mathcal{O} 節 使 派 ジ 第三款 ヤ 用 生 用 する場 1 し、 商 \mathcal{O} 品 額か \mathcal{O} 取 は、 引に 規 つ、 合 で 定 当 適 あ に 0 分 格

指

定

親

会社

が簡便

手

法

を

適

用

す

んる場

合

に

お

1

て、

先

渡

「条を削る。

ン

1

工 ツ

ク

ス

ポ

ジ ブ

ヤ

方

式

を

使 派

用 生

L 商

か

つ、

適 0

格

金

融

資 力

産

ス

ワ

プ

及

び

オ

彐

等

 \mathcal{O}

品

取

引

に

V

て、

2 該 親 \mathcal{O} 条 7 与 清 下 ポ接 先 央 に と + き 숲 担 エ 信 会 額 \mathcal{O} 1 信 算 清 物 清 規 L 1 は 社 保 工 <u>-</u> 社 とみ 算 告 る場 清 取 算機 定 ク 7 条 を用 用 相 ジ 1 部 参 ス を 間 告 当 加 参 引 す 当 IJ 算 t 示 ス な 規 額 者 取 1 加 法 関 る ポ 接 適 分 第 示 合 標 7) なすこと 第二条 定 12 用 九 ク 第 に 次ぎ 12 者 に 有 清 準 \mathcal{O} \mathcal{O} 1 るとき + 十二条 すること 係 ジ 算 間 に は 算 対 \mathcal{O} 対 価 的 る取 ア 兀 等」 適 ょ 出 す す 証 ヤ 参 手 第二十 が セ 条 ŋ 当 る 格 る] に 券 加 法 同 **米第三号** 第 でき とい 中央 等 条第 ツ 算 分 力 次ぎ又は \vdash 1 に 者 採 が \vdash 係 当 出 \mathcal{O} レ V V 清 \mathcal{O} 用 る。 できる。 \mathcal{O} 号 間 1 · う。) 清 項] 算 る 適 該 L ン 最 一号 及 額 0) た \vdash 算 に 取 金 及 適 K K 格 終 この ے を 合 機 規 び 格 額 次 融 中 指 旧 を 用 れ 関 ぎ 第 計 を 最 工 エ 定 工 商 央 定 び 金 行うことによ 場 当 5 V 額 終 ク ク に す ク 品 清 親 第 兀 融 る 合 ス ス に る ス 算 会 匹 号 \mathcal{O} 該 指 対 間 取 資 に類する する 引法 社 一号に ŧ ポ ポ 商 ポ 機 に 算 に 信 定 接 産 掲 親 \mathcal{O} 関 出 お 用 清]] 品] は 担 とす 会社 げ IJ ジ ジ \vdash 清 ジ 算 第 定 保 に 11 に て、 当 ス 海 ヤ ヤ 参 対 \otimes る が ヤ V 算 直 うる。 た ŋ 条 ク るリ 告] 1 外 1 取] 加 す 接 ŧ 旧 生 0 新 方 に \mathcal{O} F 引 に 者 第 る 清 \mathcal{O} 最 示 ず て ア 第 取 終 最 式 0 係 \mathcal{O} 算 ス で 1 終 セ を る 引 + ク あ は 百 1 工 0) る 適 参 指 指 用 て 間 ク る ツ + 以 他 商 格 七 1 加 定 \vdash ゥ 五. 接 ス 間 中項 親

清 格 算 付 手 加 法 採 者 用 \mathcal{O} 最 適 格 終 中 指 央 定 清 親 算 会 機 社 関 は 向 直 け 接 1 清 レ 算参 F 加 エ 者 ク ス 当定

て

間

品

ド者

い

算 ク 掛 た 新 1 清 ポ スポージャーの EAD とすることができる 目を乗じた額を当該間接清算参加者に対するト EAD最 出する場 算] 松終指 参加 エクスポ ジ ヤ (当該 定 者] 一合にお 親 12 に 会社告示第百三十四条 ージャー方式を用いているときは、 係 対するト エクスポ る ** \ 清算取 て、 レ ージャー 当該 1 次ぎ等を行うことにより生 ド EADエクスポ に係るもの の 各項の規定により算出 算出 ージ に当たってカ に限る。) ヤ] 当 \mathcal{O} レ] 分の ずる間 EADに次 ĸ 間 0 接

 $\mathbf{H} = \sqrt{\mathbf{Tm}/10}$

薙

B \mathcal{O} ω ないて、 \mathbb{H} Ĩ, , ものとする OM、「ネッティン \subset H て算出したリスクのマ 耳 , 2 新最終指定親会社告示第四十九条第七項の規 同項中 頃第一 号 中「ネッティ 及び「ネッティング・ 前 項」 グ・ $rac{1}{2}$ セット あるのは [ジン期間をいう。 ン グ・ セ ット 五. 「附則第-セ 営業日」 ット 十営業日」 十二条第二 <u>二</u> 十 この場 \sim 影み 営 定 業 替 \wedge $\Box \triangleright$ H, ХV 日 項 (Y

3 EAD を算出する場合につい 間 ク として間 1 ス ル 前項の規定は、 向け ポ 清 算 ジ 接 工 参 (清算参 クスポ ヤ 加 ーに係る清 者 に対するト 加] 内 - 部格 者 ジ \mathcal{O} ヤ 算 適] 付 取 格 で 手 て準用する。 次ぎ等 中 あ 法 -央清 って、 採 用 K 算機関 最終指 を行 自 工 己 が うことに ク 向 定親会 ス 直 け ポ 接 \vdash] より 清 レ 社 ジ 算 が ヤ 生ず 参 K 加 IJ る 0) 工 者

十三条 を 用いる場 最 %合にお 終指 定親会社 1 て、 新最 が 力 終指 レ ント 定 親会社告 工 クスポ 示第二 ージ 百 ヤ 兀] + 方 八 式

とする。 取 法 け IJ 条 スク相 引相 を適用し るEAD の三第一 手 方iに係るネッティン 項に規 額 た後のエクスポー 包括的手法を使用 を算出するときは、 定する標準 -ジャー 的 グ・ す IJ っる場合 ス 当 セットごとに算出 ク測定 分 0 額 \mathcal{O} の信 間 0) 方式 割 引現 用 同 パリスク によ 項 在 る C V 価 値 削 L た 減 に を 手 額 お

(世刊は大年年)-(甲草は米蕗)<(1.〒VP)(22)のとする。2.前項の割引現在価値は、次に掲げる算式により算出する2.

(割引現在価値) = (与信相当額) imes (1-EXP (-0.05 imes

 $(0.05 \times M_i)$

M; は、新最終指定親会社告示第二百四十八条の三第一項 規定する M;

3 することが 次 に 1 接 の三第一項 レー ヤ より生ずる間接清算参 清算参 第 掛 ーに係るEAD®を算出するときは、 一項の K 目 加 を乗じた額を エ 0 できる。 者として間接 規定に 算式 クスポージ におけ より 新 ヤー 当 加 清算参加 るEADIMを算出する場合に 最 者 該 終指定親会社告示第二百 に対するトレ に係る清算取 ネッティ 者 の適格中央清算機 第 グ 項 次ぎ等を行うこと . ب に セ 規定す ット お 工 クスポ 11 兀 の EADious と んる額に 関 + 向 八 け 直条

 $\blacksquare = \sqrt{\text{ (Tm/10)}}$

Tm は、新最終指定親会社告示第四十九条第七項の規定 田 して算出したリスクのマージン期間をいう。 回 項第 同項中 一号中 前 項」 「ネッテ \sim H るのは イ ン グ 附 セ ゼット 二十営業日啊則第十三条第三項

	備考 表中の[]の記載は注記である。
」と読み替えるものとする。	
第二百七十条の八中「銀行」とあるのは、「最終指定親会社	
3 前二項の場合において、旧銀行告示第一条第七号の三及び	
社告示第二百四十八条の八の規定は、適用しない。	
の八の規定を準用する。この場合において、新最終指定親会	
・アセットの額の算出については、旧銀行告示第二百七十条	
2 当分の間、適格中央清算機関に係る清算基金の信用リスク	
告示第一条第七号の三の規定は、適用しない。	
三の規定を準用する。この場合において、新最終指定親会社	
に掲げる用語の意義については、旧銀行告示第一条第七号の	
第十四条 当分の間、新最終指定親会社告示第一条第七号の三	[条を削る。]
(最終指定親会社における適格中央清算機関に係る経過措置	
るものとする。	
るのは、「ネッティング・セット 五営業日」と読み構み	
」であり、及び「ネッティング・セット 十営業日」であ	