

○金融庁告示第 号

金融商品取引業者の市場リスク相当額、取引先リスク相当額及び基礎的リスク相当額の算出の基準等を定める件（平成十九年金融庁告示第五十九号）第一条第二十号、第二十一号及び第七十号、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（平成二十二年金融庁告示第二百二十八号）第一条第二十三号、第二十四号及び第七十三号並びに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三百三十号）第一条第十四号及び第十五号の規定に基づき、金融庁長官が別に定める適格格付業者及び適格格付機関並びに適格格付並びに適格格付業者の格付に対応する区分及び適格格付機関の格付に対応する区分を定める件（平成二十三年金融庁告示第十三号）の一部を次のように改正する。

令和五年 月 日

金融庁長官 中島 淳一

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る。

| 改正後   | 改正前  |
|---|--|
| <p>(適格格付業者及び適格格付機関)</p> <p>第一条 金融商品取引業者の市場リスク相当額、取引先リスク相当額及び基礎的リスク相当額の算出の基準等を定める件(次条において「単体告示」という。)<u>第一条第二十号</u>、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(次条において「川下連結告示」という。)<u>第一条第二十三号</u>及び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どうかを判断するための基準を定める件(次条において「川上連結告示」という。)<u>第一条第十四号</u>の規定に基づき、適格格付業者及び適格格付機関として金融庁長官が別に指定する者は、銀行法第十四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等に規定する金融庁長官が別に定める格付機関及び適格格付機関の格付に対応するものとして別に定める区分(平成十九年金融庁告示第二十八号。次条において「銀行格付告示」という。)<u>第二条</u>各号に掲げる者とする。</p> <p>(適格格付並びに適格格付業者の格付に対応する区分及び適格格付機関の格付に対応する区分)</p> | <p>(適格格付業者及び適格格付機関)</p> <p>第一条 金融商品取引業者の市場リスク相当額、取引先リスク相当額及び基礎的リスク相当額の算出の基準等を定める件(次条において「単体告示」という。)<u>第一条第十八号</u>、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(次条において「川下連結告示」という。)<u>第一条第二十一号</u>及び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どうかを判断するための基準を定める件(次条において「川上連結告示」という。)<u>第一条第十四号</u>の規定に基づき、適格格付業者及び適格格付機関として金融庁長官が別に指定する者は、銀行法第十四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等に<u>基づき</u>、金融庁長官が別に定める格付機関及び適格格付機関の格付に対応するものとして別に定める区分(平成十九年三月金融庁告示第二十八号。次条において「銀行格付告示」という。)<u>第二条</u>各号に掲げる者とする。</p> <p>(適格格付並びに適格格付業者の格付に対応する区分及び適格格付機関の格付に対応する区分)</p> |

第二条 単体告示第一条第二十一号及び川下連結告示第一条第二十四号の規定に基づき、適格格付として金融庁長官が別に定める格付は、銀行格付告示第三条第一号の表の信用リスク区分1―1、1―2及び1―3並びに同条第七号の表の信用リスク区分5―1、5―2及び5―3に定める格付とする。

2 単体告示第一条第七十号、川下連結告示第一条第七十三号及び川上連結告示第一条第十五号の規定に基づき、適格格付業者の格付に対応するもの及び適格格付機関の格付に対応するものとして金融庁長官が別に定める区分は、銀行格付告示第三条各号に掲げる事項について、当該各号の表に定めるものとする。

第二条 単体告示第一条第十九号及び川下連結告示第一条第二十二号の規定に基づき、適格格付として金融庁長官が別に定める格付は、銀行格付告示第三条第一号の表の信用リスク区分1―1、1―2及び1―3並びに同条第五号の表の信用リスク区分5―1、5―2及び5―3に定める格付とする。

2 単体告示第一条第六十七号、川下連結告示第一条第七十号及び川上連結告示第一条第十五号の規定に基づき、適格格付業者の格付に対応するもの及び適格格付機関の格付に対応するものとして金融庁長官が別に定める区分は、銀行格付告示第三条各号に掲げる事項について、当該各号の表に定めるものとする。

## 附 則

### (適用時期)

1 この告示は、令和五年三月三十一日から適用する。

### (経過措置)

2 次に掲げる場合については、なお従前の例による。

一 金融商品取引業者が令和六年三月三十日までの間における市場リスク相当額及び取引先リスク相当額の算出を行う場合

二 金融商品取引業者の市場リスク相当額、取引先リスク相当額及び基礎的リスク相当額の算出の基準等を定める件の一部を改正する件（令和五年金融庁告示第 号）附則第二項の規定によりなお従前の例により市場リスク相当額及び取引先リスク相当額の算出を行う場合

三 特別金融商品取引業者が令和六年三月三十日までの間における連結自己資本規制比率の算出を行う場合

四 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の一部を改正する件（令和五年金融庁告示第 号）附則第二項の規定によりなお従前の例により連結自己資本規制比率の算出を行う場合

五 最終指定親会社が令和六年三月三十日までの間における連結自己資本規制比率の算出を行う場合

六 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どうかを判断するための基準を定める件の一部を改正する件（令和五年金融庁告示第 号）附則第二條第一項の規定によりなお従前の例により連結自己資本規制比率の算出を行う場合