○国家公安委員会告示第二十二号

道路交通法施行規則（昭和三十五年総理府令第六十号）第二十九条の四第三項において準用する同令第二十九条の二第五項の規定により平成二十二年六月十一日付けをもって次のとおり型式認定番号を指定したので、原動機を用いる歩行補助車等の型式認定の手続等に関する規則（平成四年国家公安委員会規則第十九号）第十条の規定に基づき、告示する。

平成二十二年六月三十日

国家公安委員会委員長　中井　洽

型式認定番号	原動機を用いる車いすの名称及び型式	認定を受けた者の氏名及び住所
交　K10—18	電動車いす自操用標準形ＥＭＣ—240・ＥＭＣ—250 ＥＭＣ—２Ｂ	株式会社今仙技術研究所 愛知県犬山市大字犬山字東古券419番地

○金融庁告示第七十三号

銀行法（昭和五十六年法律第五十九号）第十四条の二等の規定に基づき、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（平成十八年金融庁告示第十九号）等の一部を次のように改正し、公布の日から適用する。

平成二十二年六月三十日

金融庁長官事務代理

金融庁総務企画局長　内藤　純一

（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の一部改正）

第一　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の一部を次のように改正する。

目次中「第七十九条の四」を「第七十九条の四の六」に改める。

第七十九条第一項中「から第七十九条の四まで」を「から第七十九条の四の六まで」に改め、同条第三項中「第七十九条の四」の下に「から第七十九条の四の六まで」を加え、「場合」を「場合には」に改め、同条第四項中「から第七十九条の四まで」を「から第七十九条の四の六まで」に改める。

第七十九条の四第二項を次のように改める。

2　標準的手法採用行が期待エクスポージャー方式を用いる場合には、ネッティング・セット（当該ネッティング・セットに含まれる担保については適格金融資産担保に限る。以下この条、第七十九条の四の三第十一号及び第百五十八条第七項において同じ。）ごとに、与信相当額は第一号に掲げる算式により、同号に掲げる算式の算出に要する実効EPEは第二号に掲げる算式により、同号に掲げる実効EE_{t_k}は第三号に掲げる算式により算出される額とする。ただし、当該ネッティング・セットを構成するすべての取引における最も長い満期が一年未満である場合には、第二号に定める実効EPEの算出に当たって、当該満期までの間に同号のΔt_kで加重平均した実効EPEを用いるものとする。

一　与信相当額＝α×実効EPE

αは、1.4（ただし、取引相手方の信用リスクに関する固有の特徴がある場合には、当該特徴に応じたより保守的なαを用いることとする。）

二　実効EPE＝$\sum_{k=1}^{n}$実効$EE_{t_k}\times\Delta t_k$

nは、t_nが一年となるようなn

Δt_kは、t_k-t_{k-1}

三　実効EE_{t_k}＝max（実効$EE_{t_{k-1}}$，EE_{t_k}）

EE_{t_k}は、将来の時点t_kにおける、内部モデルにより推計されたエクスポージャーの額の平均（以下「期待エクスポージャー」という。）。ただし、実効EE_{t_0}は、カレント・エクスポージャー（期待エクスポージャーの算出の対象となるネッティング・セットに含まれる取引の時価に基づき算出される、当該ネッティング・セットに係る取引相手方のデフォルトによって発生する損失額と零のいずれか大きい額をいう。第百五十八条第六項において同じ。）とする。

第七十九条の四に次の三項を加える。

3　標準的手法採用行は、前項第一号に規定するαについて、次に掲げる要件を満たしている場合には、独自に推計することができる。ただし、推計したαが一・二を下回るときは、αは一・二とする。

一　αが、すべての取引相手方に対するエクスポージャーに係る経済資本（リスク管理、資本配賦、業績評価その他の内部管理において利用されている資本をいう。以下この項において同じ。）の額をEPEを融資残高とみなした場合の経済資本の額で除した値として推計されていること。この場合において、EPEは次の算式により算出される値とする。ただし、ネッティング・セットを構成するすべての取引における最も長い満期が一年未満である場合には、EPEの算出に当たって、当該満期までの間にこの号のΔt_kで加重平均したEPEを用いるものとする。

EPE＝$\sum_{k=1}^{n}EE_{t_k}\times\Delta t_k$

nは、t_nが一年となるようなn

Δt_kは、t_k-t_{k-1}

二　すべての取引相手方に係る取引又は取引のポートフォリオのエクスポージャーの額の推計において主要な要因を把握していること。

三　経済資本の額の計算に係るモデルの使用の方法、パラメーターの特定及びポートフォリオの構成に合理性及び一貫性があること。

四　経済資本の額の計算方法についての文書が作成されていること。

4　標準的手法採用行は、ネッティング・セットに係る取引相手方に対するマージン・アグリーメント（当該取引相手方に係るエクスポージャーの額が指定された額を超えたときに、当該相手方に対して担保の提供を求めることができる旨の契約をいう。次項において同じ。）に基づき、期待エクスポージャー計測モデル（期待エクスポージャーを計測するモデルをいう。以下同じ。）において当該担保による効果を反映している場合には、第二項第三号に規定する実効EE_{t_k}に代えて、EE_{t_k}を用いることにより同項第二号に規定する実効EPEを計測する方法を使用することができる。

5　標準的手法採用行は、前項に規定する方法に代えて、次に掲げる額のうち、いずれか小さい額を第二項第二号に掲げる実効EPEとする方法を使用することができる。

一　閾値（マージン・アグリーメントにおいて取引相手方に対して担保の提供の請求権が発生する当該取引相手方に対するエクスポージャーの額をいう。）に次の算式により算出されたアドオンを加えた額

アドオン＝$EE_{t_{mp}}-EE_{t_0}$

$EE_{t_{mp}}$は、リスクのマージン期間（マージン・アグリーメントに基づき取引相手方から担保の提供を受けた時点から当該取引相手方のデフォルトに伴い発生した当該担保のマーケット・リスクに対するヘッジが完了する時点までの期間をいう。ただし、当該期間は、日々の値洗いにより担保の額が調整されているレポ形式の取引のみから構成されるネッティング・セットについては五営業日、それ以外のすべてのネッティング・セットについては十営業日を下回らないものとする。）内における最後の時点の期待エクスポージャー

EE_{t_0}は、マージン・アグリーメントに基づき取引相手方から担保の提供を受けた時点の期待エクスポージャー

二　マージン・アグリーメントの影響がないと仮定した場合の実効EPE