五　第三号の場合において、第五十七条の二第三項第一号に規定するグロスのアドオンの計算に当たり、オプションについては、第五十七条の三第一項第二号イ及びロに規定するリスク・ポジションの額とする。

六　第二号の場合において、第七十八条第二項第一号ニ（第八十五条第五項において適用する場合を含む。）の定めにかかわらず、算出基準日を含む四半期の一期前の四半期内のいずれかの時点で取引件数が五千件を超えたネッティング・セットに係る最低保有期間を二十営業日とすることを要しない。

七　当該適格中央清算機関において、清算基金が一定の区分ごとに分別管理されている場合は、第一号の所要自己資本額は当該区分ごとに算出することを要する。この場合において、DF_{CCP}が当該区分ごとに分別管理されていない場合は、当該区分ごとのDF_{CCP}は$\sum_i A_{Ntd,i}$の額の割合に応じた額とする。

八　第一号において、各直接清算参加者が拠出した清算基金の額の合計額（DF_{CM}）が零を上回らない場合は、次の算式を用いて所要自己資本額（K_{CM}）を算出することを要する。

$$K_{CM}=\left(1+\frac{A_{Ntd,1}+A_{Ntd,2}}{\sum_i A_{Ntd,i}}\cdot\frac{N}{N-2}\right)\cdot\frac{DF^*}{\sum_i DF^*_i}\cdot K^*_{CM}$$

DF^*は、当該適格中央清算機関に対する銀行持株会社の未拠出の清算基金の額

DF^*_iは、直接清算参加者ｉの未拠出の清算基金の額

九　前号において、各直接清算参加者の未拠出の清算基金の額の合計額が零を上回らない場合は、次の算式を用いて所要自己資本額（K_{CM}）を計算することを要する。

$$K_{CM}=\left(1+\frac{A_{Ntd,1}+A_{Ntd,2}}{\sum_i A_{Ntd,i}}\cdot\frac{N}{N-2}\right)\cdot\frac{IM}{\sum_i IM_i}\cdot K^*_{CM}$$

IMは、当該適格中央清算機関に銀行持株会社が拠出した当初証拠金の額

3　第一項第二号に掲げる「簡便的手法」とは、次の算式により信用リスク・アセットの額を算出する手法をいう。この場合において、当該適格中央清算機関に対するトレード・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ことを要しない。

$$Min\left\{(2\%\cdot TE+1250\%\cdot DF),\ 20\%\cdot TE\right\}$$

TEは、当該適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャーの額

DFは、当該適格中央清算機関に銀行持株会社が拠出した清算基金の額

（適格中央清算機関以外の中央清算機関に係る清算基金の信用リスク・アセット）

第二百四十八条の九　適格中央清算機関以外の中央清算機関に係る清算基金の信用リスク・アセットの額は、当該中央清算機関に拠出した清算基金の額に千二百五十パーセントを乗じた額とする。

附　則

（適用時期）

第一条　この告示は、平成二十五年三月三十一日から適用する。

（国内基準行に係る経過措置）

第二条　国内基準行（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第一条第十号の三又は銀行法第五十二条の二十五の規定に基づき、銀行持株会社が銀行持株会社及びその子会社の保有する資産等に照らしそれら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第一条第十号の三に規定する国内基準行をいう。）である銀行又は銀行持株会社については、当分の間、この告示による改正後の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（次条において「新銀行告示」という。）又は銀行法第五十二条の二十五の規定に基づき、銀行持株会社及びその子会社の保有する資産等に照らしそれら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（次条において「新持株告示」という。）の規定にかかわらず、なお従前の例による。

（直接清算参加者に対するトレード・エクスポージャーの信用リスク・アセットの額の算出に当たって簡便的手法を用いる場合に係る経過措置）

第三条　この告示の適用の日から平成二十五年六月二十九日までの間、新銀行告示第二百七十条の八第二項第四号又は新持株告示第二百四十八条の八第二項第四号の規定にかかわらず、ネットのアドオンの算出に当たっては、次の算式を用いることができる。

ネットのアドオン＝0.15×グロスのアドオン＋0.85×0.30×グロスのアドオン

○金融庁告示第八十二号

金融商品取引法（昭和二十三年法律第二十五号）第五十七条の十七第一項の規定に基づき、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百三十号）の一部を次のように改正する。

平成二十四年十二月七日

金融庁長官　畑中龍太郎

目次中「第四章　信用リスクの内部格付手法」を「第七節　間接清算参加者に対するトレード・エクスポージャーの信用リスク・アセットの額の算出方法の特例（第百十五条の二）」に、「第六章　マーケット・リスク」を「第五章の三　中央清算機関関連エクスポージャーの取扱い（第二百四十八条の六―第二百四十八条の九）」に改める。

第一条第七号の次に次の二号を加える。

七の二　中央清算機関　法第二条第二十八項に規定する金融商品債務引受業を営む者及び商品先物取引法（昭和二十五年法律第二百二十九号）第二条第十七項に規定する商品取引債務引受業を営む者並びに外国の法令に準拠して設立された法人で外国において金融商品債務引受業又は商品取引債務引受業と同種類の業務を行う者をいう。

七の三　適格中央清算機関　最終指定親会社が第二百四十八条の八第二項に定める手法により信用リスク・アセットの額を算出するに当たって必要な情報を最終指定親会社に提供している者であって、次に掲げる者をいう。

イ　法第二条第二十九項に規定する金融商品取引清算機関

ロ　商品先物取引法第二条第十八項に規定する商品取引清算機関

ハ　外国の中央清算機関のうち当該中央清算機関が設立された国において適切な規制及び監督の枠組みが構築されており、かつ、当該規制及び監督を受けている者

第一条第三十七号の二の次に次の四号を加える。

三十七の三　トレード・エクスポージャー　派生商品取引及びレポ形式の取引並びにこれらに関する担保の差入れにより生ずるエクスポージャーをいう。

三十七の四　直接清算参加者　トレード・エクスポージャーに係る債務を、引受け、更改その他の方法により負担させる契約を中央清算機関との間で直接締結する者をいう。

三十七の五　間接清算参加者　直接清算参加者を通じて中央清算機関に対するトレード・エクスポージャーを有する者をいう。

三十七の六　清算基金　自ら及び他の直接清算参加者が中央清算機関に対し債務不履行又は支払不能により損失を与えた場合における当該損失を補塡するために、直接清算参加者が中央清算機関に預託する金銭その他の財産をいう。

第十条第一項中「第十四条」を「第十四条第一項」に改め、同条第三項中「清算機関等（法第二条第二十九項に規定する金融商品取引清算機関又は商品取引清算機関（商品先物取引法第二条第十八項に規定する商品取引清算機関をいう。以下同じ。）その他これらに類する者をいう。以下同じ。）、金融商品取引所（法第二条第十六項に規定する金融商品取引所及び外国におけるこれに相当するものをいう。以下同じ。）又は商品取引所に対するエクスポージャーのうち、次」を「次の各号」に改め、同項各号を次のように改める。

一　中央清算機関に対するエクスポージャー又は間接清算参加者の直接清算参加者に対するエクスポージャーのうち、信用取引その他これに類する海外の取引及び現物・直物取引により生ずるもの