信用リスク区分が１－４又は２－３の場合	全ての期間	十五	—	—

㈠　特定の発行体とは、中央政府等（中央政府、中央銀行、国際決済銀行、国際通貨基金、欧州中央銀行、欧州共同体及び零パーセントのリスク・ウェイトが適用される国際開発銀行をいう。以下この節において同じ。）、我が国の地方公共団体、地方公共団体金融機構及び我が国の政府関係機関をいう。

第八十四条第１項中「すべて」を「全て」に改め、同項第１号中「（取引相手が現金若しくは証券を引き渡す義務又は追加担保を提供する義務その他の義務を履行しないこと及び債務超過、破産手続開始の決定、再生手続開始の決定、更生手続開始の決定、特別清算開始の命令その他これらに類する事由の発生を含む。）」を削る。

第四章に次の１節を加える。

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

（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）

第百二十条の二　標準的手法を採用した場合の商工組合中央金庫が直接清算参加者として間接清算参加者の適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャーに係る清算取次ぎ等を行うことにより生ずる間接清算参加者に対するトレード・エクスポージャーについて、与信相当額の算出に第五十九条に定める期待エクスポージャー方式を用いていない場合には、当該トレード・エクスポージャーに係る信用リスク・アセットの額は、次の算式により算出した額を当該信用リスク・アセットの額とみなすことができる。

RWA*＝RWA×√（Tm／10）

RWA*は、この条の規定の適用後の信用リスク・アセットの額

RWAは、第一節から前節までの規定により算出した当該トレード・エクスポージャーに係る信用リスク・アセットの額

Tmは、第五十九条第七項の定めに従い算出したリスクのマージン期間。この場合において、同項第一号の規定にかかわらず、日々の値洗いにより担保額が調整されるネッティング・セットに係るリスクのマージン期間は五営業日とすることができる。

第百二十七条第１項中「すべて」を「全て」に、「ついて内部格付手法」を「ついて、内部格付手法」に改める。

第百三十三条第１号中「第二十五条」を「第二十五条第一項」に改め、同条に次の１号を加える。

四　第六章の三に定めるところにより算出した第二十五条第一項第三号に規定する中央清算機関関連エクスポージャーに係る信用リスク・アセットの額

第百三十九条に次の１項を加える。

6　内部格付手法を採用した場合の商工組合中央金庫が直接清算参加者として間接清算参加者の適格中央清算機関向けトレード・エクスポージャーに係る清算取次ぎ等を行うことにより生ずる間接清算参加者に対するトレード・エクスポージャーのEADを算出する場合であって、当該EADの算出に当たって第五十九条に定める期待エクスポージャー方式を用いていないときには、前各項の規定により算出したEAD（当該エクスポージャーに係るものに限る。）に次の掛け目を乗じた額を当該間接清算参加者に対するトレード・エクスポージャーのEADとすることができる。

掛け目＝√（Tm／10）

Tmは、第五十九条第七項の規定を準用して算出したリスクのマージン期間。この場合において、同項第一号中「ネッティング・セット　二十営業日」とあり、及び「ネッティング・セット　十営業日」とあるのは、「ネッティング・セット　五営業日」と読み替えるものとする。

第百四十七条に次の１項を加える。

6　第百三十九条第六項の規定は、リテール向けエクスポージャーであって、内部格付手法を採用した場合の商工組合中央金庫が直接清算参加者として間接清算参加者の適格中央清算機関向けトレード・エクスポージャーに係る清算取次ぎ等を行うことにより生ずる間接清算参加者に対するトレード・エクスポージャーのEADを算出する場合について準用する。

第二百五十三条の二第１項中「清算機関等」を「次の各号に掲げる者」に改め、同項に次の各号を加える。

一　中央清算機関

二　商工組合中央金庫が適格中央清算機関の間接清算参加者である場合であって、次に掲げる要件の全てを満たす取引に係る直接清算参加者

イ　間接清算参加者のトレード・エクスポージャーについて、次に掲げる場合における間接清算参加者の損失の発生を防ぐための方策を適格中央清算機関又は直接清算参加者が講じていること。

⑴　直接清算参加者が債務不履行又は支払不能となった場合

⑵　他の間接清算参加者が債務不履行又は支払不能となった場合

ロ　間接清算参加者がその適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャーに係る清算取次ぎ等を委託している直接清算参加者が債務不履行又は支払不能により適格中央清算機関の清算参加者としての資格を失った場合においても、間接清算参加者が追加的な負担をすることなく他の直接清算参加者又は適格中央清算機関と当該トレード・エクスポージャーに関する契約を継続又は承継するための枠組みが存在していること。

三　資金清算機関等

第二百五十三条の二第２項中「清算機関等」を「次の各号に掲げる者」に改め、同項に次の各号を加える。

一　中央清算機関

二　商工組合中央金庫が中央清算機関の間接清算参加者である場合であって、前項第二号に掲げる要件の全てを満たす取引に係る直接清算参加者

三　資金清算機関等

第二百五十三条の三に次の１項を加える。

7　第四項第一号又は第二号に掲げる場合において、第一項のEAD$_i^{total}$（直接清算参加者として間接清算参加者の適格中央清算機関向けトレード・エクスポージャーに係る清算取次ぎ等を行うことにより生ずる間接清算参加者に対するトレード・エクスポージャーに係るものに限る。）を算出する場合には、第四項第一号又は第二号に定める額に次の掛け目を乗じた額を、当該ネッティング・セットのEAD$_i^{total}$とすることができる。

掛け目＝√（Tm／10）

Tmは、第五十九条第七項の規定を準用して算出したリスクのマージン期間。この場合において、同項第一号中「ネッティング・セット　二十営業日」とあり、及び「ネッティング・セット　十営業日」とあるのは、「ネッティング・セット　五営業日」と読み替えるものとする。

第六章の二の次に次の１章を加える。

第六章の三　中央清算機関関連エクスポージャーの取扱い

（中央清算機関関連エクスポージャーの信用リスク・アセット）

第二百五十三条の六　第四章及び第五章の規定にかかわらず、次の各号に掲げるエクスポージャーの信用リスク・アセットの計算は、この章の定めるところによる。

一　中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー

二　中央清算機関に係る清算基金

三　商工組合中央金庫が間接清算参加者である場合の直接清算参加者に対するトレード・エクスポージャーであって、第二百五十三条の二第一項第二号に掲げる要件の全てを満たすもの（次条において「直接清算参加者向けトレード・エクスポージャー」という。）