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商工組合中央金庫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）

第二百五十三条の九　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。

（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）

第二条　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、この告示による改正後の株式会社商工組合中央金庫法第二十三条第一項の規定に基づき、株式会社商工組合中央金庫がその経営の健全性を判断するための基準第二百五十三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

○金融庁農林水産省告示第十七号

農林中央金庫法（平成十三年法律第九十三号）第五十六条の規定に基づき、農林中央金庫がその経営の健全性を判断するための基準（平成十八年金融庁農林水産省告示第四号）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

農林水産大臣　郡司　彰

目次中「第五章　信用リスクの内部格付手法」を「第六節　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（第百十六条の二）」に、「第五章　信用リスクの内部格付手法」を「第七章　マーケット・リスク」に、「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（第二百四十七条の六―第二百四十七条の九）」を「第七章　マーケット・リスク（第二百四十七条の九）」に改める。

第一条第六号の次に次の二号を加える。

六の二　中央清算機関　金融商品取引法（昭和二十三年法律第二十五号）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二百三十九号）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。

六の三　適格中央清算機関　農林中央金庫が第二百四十七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農林中央金庫に提供している者であって、次に掲げる者をいう。

イ　金融商品取引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

第一条第十三号イ中「（昭和二十三年法律第二十五号）」を削り、同条第三十一号の二の次に次の四号を加える。

三十一の三　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。

三十一の四　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。

三十一の五　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。

三十一の六　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「第二十五条」を「第二十五条第一項」に改め、同条第三項中「清算機関等（信託業法（平成十六年法律第百五十四号）第三十一条に規定する清算機関その他これに類する者をいう。以下同じ。）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

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

二　直接清算参加者の適格中央清算機関への担保の差入れ又は間接清算参加者の直接清算参加者を通じた適格中央清算機関への担保の差入れにより生ずるエクスポージャーのうち、適格中央清算機関以外の第三者において分別管理されており、かつ、適格中央清算機関に係る倒産手続又は外国における倒産手続と同種類の手続に伴う当該担保に対する損失の発生を防ぐために必要な方策が講ぜられているもの

三　資金清算機関等（資金決済に関する法律（平成二十一年法律第五十九号）第二条第六項に規定する資金清算機関その他これに類する者をいう。以下同じ。）に対するエクスポージャーのうち、資金清算機関等への預託金又は担保の差入れにより生ずるもの

第二十一条第一項中「第二十五条」を「第二十五条第一項」に改め、同条第三項中「清算機関等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

二　直接清算参加者の適格中央清算機関への担保の差入れ又は間接清算参加者の直接清算参加者を通じた適格中央清算機関への担保の差入れにより生ずるエクスポージャーのうち、適格中央清算機関以外の第三者において分別管理されており、かつ、適格中央清算機関に係る倒産手続又は外国における倒産手続と同種類の手続に伴う当該担保に対する損失の発生を防ぐために必要な方策が講ぜられているもの

三　資金清算機関等に対するエクスポージャーのうち、資金清算機関等への預託金又は担保の差入れにより生ずるもの