$A_{Net,i}$は、直接清算参加者ｉに対する$EBRM_i$の額（第八号及び第九号において同じ。）

$A_{Net,1}$は、当該適格中央清算機関が有する各直接清算参加者に対するエクスポージャーの額のうち最大の額（第八号及び第九号において同じ。）

$A_{Net,2}$は、当該適格中央清算機関が有する各直接清算参加者に対するエクスポージャーの額のうち二番目に大きい額（第八号及び第九号において同じ。）

$\sum_i A_{Net,i}$は、当該適格中央清算機関が有する各直接清算参加者に対するエクスポージャーの額の合計額（第八号及び第九号において同じ。）

第二百五十三条の八第二項第四号を次のように改める。

四　前号の場合において、第五十七条第三項第二号のネットのアドオンについては、次の算式を用いる。

ネットのアドオン＝0.15×グロスのアドオン＋0.85×$\frac{\text{ネット再構築コスト}}{\text{グロス再構築コスト}}$×グロスのアドオン

第二百五十三条の八第二項第七号中「いない場合は」を「いないときは」に改め、同項第八号及び第九号を次のように改める。

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。

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

DF^*は、当該適格中央清算機関に対する商工組合中央金庫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。

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

IMは、当該適格中央清算機関に商工組合中央金庫が拠出した当初証拠金の額

第二百五十三条の八第三項を次のように改める。

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。

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

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

第七章に次の一節を加える。

第七節　特定項目のうち調整項目に算入されない部分に係る特例

（特定項目のうち調整項目に算入されない部分に係る特例）

第二百八十五条の十四　第百六十一条の三の規定は、マーケット・リスク相当額を算出する場合について準用する。この場合において、同条中「内部格付手法を採用した場合の商工組合中央金庫にあっては、第百三十四条から前条までの規定にかかわらず」とあるのは「前六節の規定にかかわらず」と、「に係るエクスポージャーの信用リスク・アセットの額」とあるのは「のマーケット・リスク相当額」と、「当該エクスポージャーの額（EADをいう。）」とあるのは「当該部分の額」と、「二百五十パーセント」とあるのは「二十パーセント」と読み替えるものとする。

（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の一部を改正する件の一部改正）

第二条　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の一部を改正する件（平成二十四年金融庁・経済産業省告示第三号）の一部を次のように改正する。

附則に次の一条を加える。

（適用日前における経済産業大臣、財務大臣及び金融庁長官の承認に係る経過措置）

第九条　新告示第八条第十二項又は第二十条第九項に規定する経済産業大臣、財務大臣及び金融庁長官の承認については、適用日前においても行うことができる。この場合において、その承認の効力は、適用日から生ずるものとする。

附　則

この告示は、平成二十六年三月三十一日から適用する。ただし、第一条中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二十五条第一項第二号、第百三十三条第三号、第二百五十三条の三第一項及び第二百五十三条の四第一項の改正規定並びに第二条中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の一部を改正する件附則に二条を加える改正規定は、平成二十五年三月三十一日から適用する。

○金融庁・厚生労働省告示第一号

労働金庫法（昭和二十八年法律第二百二十七号）第九十四条第一項において準用する銀行法（昭和五十六年法律第五十九号）第十四条の二の規定に基づき、労働金庫法第九十四条第一項において準用する銀行法第十四条の二の規定に基づき、労働金庫及び労働金庫連合会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・厚生労働省告示第七号）の一部を次のように改正する。

平成二十五年三月八日

金融庁長官　畑中龍太郎

厚生労働大臣　田村　憲久

目次中「第五章　信用リスクの内部格付手法」を「第五章　信用リスクの内部格付手法　第七節　信用リスク削減手法　第八節　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・アセットの額の算出方法の特例（第百十三条の二）」に、「第百五十四条」を「第百五十四条の五」に、「第七章　オペレーショナル・リスク（第二百四十七条―第二百六十四条）」を

「第六章の二　CVAリスク
第六章第一節　標準的方式（第二百四十六条）
第二節　簡便的算出方法（第二百四十六条の二）
第三節　内部モデル方式（第二百四十六条の三）
第七章　オペレーショナル・リスク（第二百四十七条―第二百六十四条）」

に改める。

第二百四十六条の八」を

「第二百四十六条の五」に改める。