六　第二号の場合において、第七十五条第二項第一号ニ（第八十二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ときは、当該区分ごとのDF_{CCP}は$\sum_i A_{Net,i}$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。

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

DF^*は、当該適格中央清算機関に対する組合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。

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

IMは、当該適格中央清算機関に組合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。

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

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組合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）

第二百四十六条の八　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のリスク・ウェイトを乗じた額とする。

第二百五十九条第一項中「、第三項第十号」を「、同号」に改め、同条第三項第五号ロ及びヘ中「すべて」を「全て」に改め、同項第十号を次のように改める。

十　先進的計測手法を用いるために十分と認められる自己資本比率を維持していること。

附則第七条第一項及び第二項中「四パーセント」を「八パーセント」に改める。

附則第十一条第一項第一号中「場合（」の下に「農業協同組合等がその経営の健全性を判断するための基準等の一部を改正する件（平成二十五年金融庁農林水産省告示第一号）第一条の規定による改正前の」を加え、同項第二号中「すべて」を「全て」に改める。

（漁業協同組合等がその経営の健全性を判断するための基準の一部改正）

第二条　漁業協同組合等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三号）の一部を次のように改正する。

目次中「第五章　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（第百十三条の二）」に、「第百五十四条」を「第百五十四条―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「第七章　オペレーショナル・リスク（第二百四十七条の五―第二百四十六条の八）」に改める。

第一節　ＣＶＡリスク（第二百四十六条の二）

第二節　標準的リスク測定方式（第二百四十六条の三）

第三節　簡便的リスク測定方式（第二百四十六条の四）

第六章の三　中央清算機関連エクスポージャーの取扱い（第二百四十六条の五―第二百四十六条の八）

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）

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（第百十三条の二）

第七節を第八節とし、第六節の次に次の一節を加える。

第七節　中央清算機関連エクスポージャーの取扱い

（中央清算機関連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）

第二百四十六条の五　中央清算機関連エクスポージャーの信用リスク・アセットの額は、次に掲げる取引の区分に応じ、それぞれ次に定める額とする。

一　適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー　第二百四十六条の七第二項に定める手法により算出した信用リスク・アセットの額

二　適格中央清算機関以外の中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー　第二百四十六条の八第二項に定める手法により算出した信用リスク・アセットの額

（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）

第二百四十六条の六　第二百四十六条の五第一号に掲げる取引に係る信用リスク・アセットの額は、次の各号に掲げる取引の区分に応じ、当該各号に定める額とする。

一　デリバティブ取引　次に掲げる額の合計額

イ　第二百四十六条の二第一項第一号に定める方法により算出した信用リスク・アセットの額

ロ　第二百四十六条の二第一項第二号に定める方法により算出した信用リスク・アセットの額

二　有価証券取引　第二百四十六条の二第一項第一号に定める方法により算出した信用リスク・アセットの額

三　長期決済期間取引　第二百四十六条の二第一項第一号に定める方法により算出した信用リスク・アセットの額

四　外国為替取引　第二百四十六条の二第一項第一号に定める方法により算出した信用リスク・アセットの額

五　デリバティブ取引、有価証券取引、長期決済期間取引及び外国為替取引以外の取引　第二百四十六条の二第一項第一号に定める方法により算出した信用リスク・アセットの額

（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）

第二百四十六条の七　第二百四十六条の五第一号に掲げる取引に係る信用リスク・アセットの額は、次の各号に掲げる取引の区分に応じ、当該各号に定める額とする。

一　デリバティブ取引　次に掲げる額の合計額

イ　第二百四十六条の二第一項第一号に定める方法により算出した信用リスク・アセットの額

ロ　第二百四十六条の二第一項第二号に定める方法により算出した信用リスク・アセットの額

二　有価証券取引　第二百四十六条の二第一項第一号に定める方法により算出した信用リスク・アセットの額

三　長期決済期間取引　第二百四十六条の二第一項第一号に定める方法により算出した信用リスク・アセットの額

四　外国為替取引　第二百四十六条の二第一項第一号に定める方法により算出した信用リスク・アセットの額

五　デリバティブ取引、有価証券取引、長期決済期間取引及び外国為替取引以外の取引　第二百四十六条の二第一項第一号に定める方法により算出した信用リスク・アセットの額

2　前項第二号の場合において、第七十五条第二項第一号ニ（第八十二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。

3　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ときは、当該区分ごとのDF_{CCP}は$\sum_i A_{Net,i}$の額の割合に応じた額とする。

4　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組合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

5　前項において、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。

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

IMは、当該適格中央清算機関に組合が拠出した当初証拠金の額

6