（簡便法による時価変動時所要追加担保額）

第三十七条　前条第二項第一号に掲げる「簡便法による時価変動時所要追加担保額」とは、デリバティブ取引等において、基準日以前二十四月以内のうち、取引の別に担保又は受入資産の受取額から担保又は差入資産の受渡額を差し引いた額の絶対値の合計額が最大となる三十日間における当該合計額をいう（次項において同じ。）。

2　［略］

（シナリオ法による時価変動時所要追加担保額）

第三十八条　［略］

2　第三十六条第二項第二号及び前項の「シナリオ法による時価変動時所要追加担保額」とは、デリバティブ取引等において、ストレスシナリオの選定基準により選定されたストレスシナリオ（デリバティブ取引等の時価の変動を説明する金融指標（金融商品取引法第二条第二十五項に規定する金融指標をいう。次項第二号及び第三号において同じ。）その他の指標の変動を表すシナリオをいう。第四項において同じ。）に基づき計算した担保又は差入資産の受渡額の合計額から担保又は受入資産の受入額の合計額を差し引いた額（当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。）をいう（次項及び第五項並びに次条において同じ。）。

3　前二項の「ストレスシナリオの選定基準」とは、次に掲げるものをいう。

一　［略］

二　過去の市場流動性ストレス期のうち、基準日のデリバティブ取引等に係るシナリオ法による時価変動時所要追加担保額が最大となる三十日間の金融指標その他指標に基づくものであること。

三　デリバティブ取引等の時価の変動を反映するために十分な金融指標その他指標が含まれていること。

（簡便法による時価変動時所要追加担保額）

第三十七条　前条第二項第一号に掲げる「簡便法による時価変動時所要追加担保額」とは、デリバティブ取引等及びレポ形式の取引等において、基準日以前二十四月以内のうち、取引の別に担保又は受入資産の受取額から担保又は差入資産の受渡額を差し引いた額の絶対値の合計額が最大となる三十日間における当該合計額をいう（次項において同じ。）。

2　［同上］

（シナリオ法による時価変動時所要追加担保額）

第三十八条　［同上］

2　第三十六条第二項第二号及び前項の「シナリオ法による時価変動時所要追加担保額」とは、デリバティブ取引等及びレポ形式の取引等において、ストレスシナリオの選定基準により選定されたストレスシナリオ（デリバティブ取引等及びレポ形式の取引等の時価の変動を説明する金融指標（金融商品取引法第二条第二十五項に規定する金融指標をいう。次項第二号及び第三号において同じ。）その他の指標の変動を表すシナリオをいう。第四項において同じ。）に基づき計算した担保又は差入資産の受渡額の合計額から担保又は受入資産の受入額の合計額を差し引いた額（当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。）をいう（次項及び第五項並びに次条において同じ。）。

3　［同上］

一　［同上］

二　過去の市場流動性ストレス期のうち、基準日のデリバティブ取引等及びレポ形式の取引等に係るシナリオ法による時価変動時所要追加担保額が最大となる三十日間の金融指標その他指標に基づくものであること。

三　デリバティブ取引等及びレポ形式の取引等の時価の変動を反映するために十分な金融指標その他指標が含まれていること。

4　第一項の「定量的基準」とは、次に掲げるものをいう。

一　ストレスシナリオに基づくデリバティブ取引等の時価の変動を十分に反映していること。

二　ストレスシナリオに基づく時価の変動を十分に反映していないデリバティブ取引等に対しては、保守的な方法により計算が行われていること。

5　［略］

（格下げ等に伴う資金流出額）

第四十条　［略］

2　前項の「格下げ時資金流出額」とは、ダウングレード・トリガー条項（格付機関が信用金庫連合会又は連結子法人等の債務者信用力格付その他の基準を引き下げた場合又はそれに準ずる事象が発生した場合に、取引相手方に対する追加担保の差入れその他を行う義務を定めた条項をいう。以下この項において同じ。）が契約に付されたデリバティブ取引等について、債務者信用力格付の三段階の格下げその他のダウングレード・トリガー条項に定める基準の変動があった場合に、信用金庫連合会又は連結子法人等が取引相手方に対して支払わなければならない金銭その他これに準ずるものの額（当該契約に基づき、追加担保の差入れが求められる場合又は受入担保に対する信用金庫連合会又は連結子法人等の再担保権（担保として受け入れた資産を第三者に担保として差し入れる権利をいう。）が制限される場合における当該担保の額を含む。）の合計額をいう。

4　［同上］

一　ストレスシナリオに基づくデリバティブ取引等及びレポ形式の取引等の時価の変動を十分に反映していること。

二　ストレスシナリオに基づく時価の変動を十分に反映していないデリバティブ取引等及びレポ形式の取引等に対しては、保守的な方法により計算が行われていること。

5　［同上］

（格下げ等に伴う資金流出額）

第四十条　［同上］

2　前項の「格下げ時資金流出額」とは、ダウングレード・トリガー条項（格付機関が信用金庫連合会又は連結子法人等の債務者信用力格付その他の基準を引き下げた場合又はそれに準ずる事象が発生した場合に、取引相手方に対する追加担保の差入れその他を行う義務を定めた条項をいう。以下この項において同じ。）が契約に付されたデリバティブ取引等及びレポ形式の取引等その他の取引について、債務者信用力格付の三段階の格下げその他のダウングレード・トリガー条項に定める基準の変動があった場合に、信用金庫連合会又は連結子法人等が取引相手方に対して支払わなければならない金銭その他これに準ずるものの額（当該契約に基づき、追加担保の差入れが求められる場合又は受入担保に対する信用金庫連合会又は連結子法人等の再担保権（担保として受け入れた資産を第三者に担保として差し入れる権利をいう。）が制限される場合における当該担保の額を含む。）の合計額をいう。