2　前条及び前項の規定にかかわらず、次の各号に掲げる額の合計額（以下この項において単に「合計額」という。）と、適格中央清算機関が適格中央清算機関以外の中央清算機関となったと仮定した場合における次の各号に掲げる額の合計額（以下この項において「仮定した合計額」という。）を比較し、合計額が仮定した合計額を上回る場合には、当該仮定した合計額を当該適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー及び当該適格中央清算機関に係る清算基金の信用リスク・アセットの額の合計額とする。

一　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

二　当該適格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

五　第三号の場合において、第五十一条第三項第一号に規定するグロスのアドオンの計算に当たり、オプションについては、第五十二条第一項第二号イ及びロに規定するリスク・ポジションの額とする。

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信用協同組合等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信用協同組合等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％・TE+1250％・DF)，20％・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信用協同組合等が拠出した清算基金の額

備考　表中の［　］の記載及び対象規定の二重傍線を付した部分を除く全体に付した傍線は注記である。

（最終指定親会社及びその子法人等の保有する資産等に照らし当該最終指定親会社及びその子法人等の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を定める件の一部改正）

第五条　最終指定親会社及びその子法人等の保有する資産等に照らし当該最終指定親会社及びその子法人等の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を定める件（平成二十二年金融庁告示第百三十号）の一部を次のように改正する。

次の表により、改正前欄に掲げる規定の傍線を付し又は破線で囲んだ部分をこれに順次対応する改正後欄に掲げる規定の傍線を付し又は破線で囲んだ部分のように改め、改正前欄及び改正後欄に対応して掲げる対象規定は、その標記部分が同一のものは当該対象規定を改正後欄に掲げるもののように改め、その標記部分が異なるものは改正前欄に掲げる対象規定を改正後欄に掲げる対象規定として移動し、改正前欄に掲げる対象規定で改正後欄にこれに対応するものを掲げていないものは、これを削り、改正後欄に掲げる対象規定で改正前欄にこれに対応するものを掲げていないものは、これを加える。