第五条　商工組合中央金庫がカレント・エクスポージャー方式を用いる場合において、新告示第二百五十三条の三第一項に規定する標準的リスク測定方式によるＣＶＡリスク相当額を算出するときは、当分の間、同項の算式におけるEAD^{total}は、包括的手法を使用する場合の信用リスク削減手法を適用した後のエクスポージャーの額の割引現在価値を、取引相手方に係るネッティング・セットごとに算出した額とする。

2　前項の割引現在価値は、次に掲げる算式により算出するものとする。

（割引現在価値）＝（与信相当額）×（1－EXP（－0.05×M_t））／（0.05×M_t）

M_tは、新告示第二百五十三条の三第一項に規定するM_t

3　第一項の規定により新告示第二百五十三条の三第一項の算式におけるEAD^{total}を算出する場合において、直接清算参加者として間接清算参加者の適格中央清算機関向けトレード・エクスポージャーに係る清算取次ぎ等を行うことにより生ずる間接清算参加者に対するトレード・エクスポージャーに係るEAD^{total}を算出するときは、第一項に規定する額に次の掛目を乗じた額を、当該ネッティング・セットのEAD^{total}とすることができる。

掛目＝$\sqrt{}$（Tm／10）

Tmは、新告示第五十九条第七項の規定を準用して算出したリスクのマージン期間をいう。この場合において、同項中「前項」とあるのは「附則第五条第三項」と、同項第一号中「ネッティング・セット　二十営業日」とあり、及び「ネッティング・セット　十営業日」とあるのは「ネッティング・セット　五営業日」と読み替えるものとする。

（適格中央清算機関に係る経過措置）

第六条　当分の間、新告示第一条第六号の三に掲げる用語の意義は、同号の規定にかかわらず、旧告示第一条第六号の三に定めるところによる。

2　当分の間、新告示第二百五十三条の八の規定にかかわらず、適格中央清算機関に係る清算基金の信用リスク・アセットの額の算出に当たっては、旧告示第二百五十三条の八の規定により算出するものとする。

○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）、労働金庫法施行令（昭和五十七年政令第四十六号）及び労働金庫法施行規則（昭和五十七年大蔵省労働省令第一号）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）及び労働金庫法施行令第五条第十二項第四号並びに労働金庫法施行規則第九十五条の五第二項、第九十六条第二項及び第四項、第九十七条第一項並びに第九十九条第一号及び第二号の規定に基づき、合算関連法人等から除かれる者として金融庁長官及び厚生労働大臣が定める者等を定める件（平成二十六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。

平成三十年三月二十三日

金融庁長官　森　信親
厚生労働大臣　加藤　勝信

（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の一部改正）

第一条　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た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た部分のように改め、改正前欄及び改正後欄に対応して掲げるその標記部分に二重傍線を付した規定（以下「対象規定」という。）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、これを加える。

改正後	改正前
目次 ［第一章～第三章　略］ 第四章　信用リスクの標準的手法 ［第一節～第三節　略］ 第四節　派生商品取引及び長期決済期間取引（第五十条―第五十三条） ［第五節～第七節　略］ ［第五章～第七章　略］ 附則	目次 ［第一章～第三章　同上］ 第四章　信用リスクの標準的手法 ［第一節～第三節　同上］ 第四節　派生商品取引及び長期決済期間取引（第五十条―第五十三条の六） ［第五節～第七節　同上］ ［第五章～第七章　同上］ 附則