六　第二号の規定にかかわらず、直接清算参加者が自己の勘定と間接清算参加者ごとの勘定（複数の間接清算参加者の勘定を一括して管理している場合にあっては、一括して管理しているそれぞれの勘定をいう。以下この号及び次号において同じ。）を分別管理している場合には、当該自己の勘定のトレード・エクスポージャーの額及び当該間接清算参加者ごとの勘定のトレード・エクスポージャーの額の合計額をE_{AD}とする。

七　前号の場合において、直接清算参加者が拠出した清算基金が、当該直接清算参加者の自己の勘定と間接清算参加者ごとの勘定の別に分けられていないときには、当該自己の勘定に係る当初証拠金の額と当該間接清算参加者ごとの勘定に係る当初証拠金との額の割合に応じて、当該清算基金を配分することとする。

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

二　前号におけるエクスポージャーの額は、第七十九条及び第八十八条の信用リスク削減手法適用後エクスポージャー額とする。

三　前号の場合において、派生商品取引に係る信用リスク削減手法適用後エクスポージャー額の計算については、第五十一条のカレント・エクスポージャー方式を用いる。

四　前号の場合において、第五十一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。

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

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の合計額が零を上回らない場合

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金庫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金庫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。

（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の一部改正）

第二条　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の一部を次のように改正する。