（一般市場リスクを算出するリスク計測モデルの承認の基準）

第二百五十一条　［略］

2　前項の「定性的基準」とは、次に掲げるものをいう。

［一～四　略］

五　マーケット・リスクの管理を担当する理事等がマーケット・リスクの管理手続に積極的に関与していること。

［六～八　略］

3　［略］

（シナリオ法の承認の基準）

第二百七十六条　農林水産大臣及び金融庁長官は、シナリオ法の使用に関する承認をしようとするときは、農林中央金庫の業務内容に照らし必要な範囲で次に掲げる基準に適合しているかどうかを審査しなければならない。

［一・二　略］

三　マーケット・リスクを担当する理事等がマーケット・リスクの管理手続に積極的に関与していること。

［四～六　略］

（承認の基準）

第二百八十五条　農林水産大臣及び金融庁長官は、粗利益配分手法の使用について第二百八十三条第一項の承認をしようとするときは、次に掲げる基準に適合するかどうかを審査しなければならない。

一　オペレーショナル・リスクを管理するための体制（以下この章において「管理体制」という。）の整備について、理事会等及び担当理事等（オペレーショナル・リスクの管理について業務執行権限を授権された理事等をいう。以下この条及び別表第一の注において同じ。）の責任が明確化されていること。

［二～五　略］

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農林中央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

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農林中央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。

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

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農林中央金庫が拠出した清算基金の額

（一般市場リスクを算出するリスク計測モデルの承認の基準）

第二百五十一条　［同上］

2　［同上］

［一～四　同上］

五　マーケット・リスクの管理を担当する理事がマーケット・リスクの管理手続に積極的に関与していること。

［六～八　同上］

3　［同上］

（シナリオ法の承認の基準）

第二百七十六条　［同上］

［一・二　同上］

三　マーケット・リスクを担当する理事がマーケット・リスクの管理手続に積極的に関与していること。

［四～六　同上］

（承認の基準）

第二百八十五条　［同上］

一　オペレーショナル・リスクを管理するための体制（以下この章において「管理体制」という。）の整備について、理事会等及び担当理事（オペレーショナル・リスクの管理について業務執行権限を授権されたものをいう。以下この条及び別表第一の注において同じ。）の責任が明確化されていること。

［二～五　同上］