

附 則

(適用時期)

第一条 この告示は、平成三十年三月三十一日から適用する。

(派生商品取引及び長期決済期間取引の与信相当額の算出に係る経過措置)

第二条 当分の間、第一条の規定による改正後の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（以下「新告示」という。）第五十条第二項及び第三項、第三百三十二条第五項、第四百十条第五項、第二百三十六條第二項並びに第二百四十六條の六第一項の規定の適用については、次の表の上欄に掲げる規定中同表の中欄に掲げる字句は、同表の下欄に掲げる字句と読み替えるものとする。

第五十条第二項	標準的手法採用金庫は、次の各号に掲げる金庫のいずれにも該当しない場合にあ	標準的手法採用金庫は
---------	--------------------------------------	------------

	<p>第五十条第三項</p> <p>標準的手法採用金庫は、前項各号に掲げる金庫のいずれにも該当しない場合において</p>	<p>標準的手法採用金庫が</p>
<p>第三百三十二条第五項</p>	<p>第五十条（第二項及び第三項を除く。）から第五十二条の六までの規定は、事業法人等向けエクスポージャーのEADについて準用する。この場合において、これらの規定中「標準的手法採用金庫」とあるのは「内部格付手法採用金庫」と、第五十条第四項中「前三項」とあるのは「</p>	<p>第五十条から第五十三条までの規定は、事業法人等向けエクスポージャーのEADについて準用する。この場合において、「標準的手法採用金庫」とあるのは「内部格付手法採用金庫」と読み替えるものとする。</p>

<p>項 第二百三十六條第二</p>	<p>第四百四十條第五項</p>	<p>第五十條（第二項及び第三項を除く。） から第五十二條の六までの規定を準用す</p>	<p>第一項」と読み替えるものとする。 第五十條（第二項及び第三項を除く。） から第五十二條の六までの規定は、リテ ール向けエクスポージャーのEADについ て準用する。この場合において、これら の規定中「標準的手法採用金庫」とある のは「内部格付手法採用金庫」と、第五 十條第四項中「前三項」とあるのは「第 一項」と読み替えるものとする。</p>	<p>第五十條から第五十三條までの規定を準 用する。この場合において、「標準的手</p>	<p>第五十條から第五十三條までの規定は、 リテール向けエクスポージャーのEADに ついて準用する。この場合において、「 標準的手法採用金庫」とあるのは「内部 格付手法採用金庫」と読み替えるものと する。</p>
------------------------	------------------	--	--	--	--

	<p>る。この場合において、これらの規定中「標準的手法採用金庫」とあるのは「内部格付手法採用金庫」と、第五十条第四項中「前三項」とあるのは「第一項」と読み替えるものとする。</p>	<p>法採用金庫」とあるのは「内部格付手法採用金庫」と読み替えるものとする。</p>
<p>第二百四十六条の六 第一項</p>	<p>同章（第五十条第二項及び第三項を除く。）の規定中</p>	<p>同章の規定中</p>

2 内部格付手法採用金庫は、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

クスポート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・エクスポート

ジャーのEADを算出する場合において、当該EADの算出に当たって新告示第五十三条に規定するカレント

・エクスポートジャー方式を用いているときは、当分の間、新告示第百三十二条各項の規定により算出した

EAD（当該エクスポージャーに係るものに限る。）に次の掛目を乗じた額を当該間接清算参加者に対する
トレード・エクスポージャーのEADとすることが出来る。

$$\text{掛目} = \sqrt{T_m/10}$$

T_m は、新告示第五十二条第七項の規定を準用して算出したリスクのマージンを期間をいう。この場合において、回線中「前項」とあるのは「附則第二条第二項」と、回線外「回線中」及び「ネットイング・セット 二十営業日」とあり、及び「ネットイング・セット 十営業日」とあるのは、「ネットイング・セット 五営業日」と読み替えるものとする。

- 3 前項の規定は、内部格付手法採用金庫が、リテール向けエクスポージャーであつて、自己が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・エクスポージャーのEADを算出する場合について準用する。

（適格中央清算機関に係る経過措置）

第三条 当分の間、新告示第一条第七号の三に掲げる用語の意義は、同号の規定にかかわらず、第一条の規

定による改正前の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（次項において「旧告示」という。）第一条第七号の三に定めるところによる。

2 当分の間、新告示第二百四十六条の七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、旧告示第二百四十六条の七の規定により算出するものとする。