

件名

金融庁長官が別に定める適格格付業者及び適格格付機関並びに適格格付及び適格格付機関の格付に対応する区分を定める件

○金融庁告示第十三号

金融商品取引業者の市場リスク相当額、取引先リスク相当額及び基礎的リスク相当額の算出の基準等を定める件（平成十九年八月金融庁告示第五十九号）第一条第十八号及び第十九号、特別金融商品取引業者及びその子法人等の保有する資産等に照らし当該特別金融商品取引業者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（平成二十二年十二月金融庁告示第二百二十八号）第一条第二十一号及び第二十二号並びに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（平成二十二年十二月金融庁告示第三百三十号）第一条第十四号及び第十五号の規定に基づき、金融庁長官が別に定める適格格付業者及び適格格付機関並びに適格格付及び適格格付機関の格付に対応するものとして金融庁長官が別に定める区分を次のように定める。

平成二十三年二月二十五日

金融庁長官 三國谷勝範

(適格格付業者及び適格格付機関)

第一条 金融商品取引業者の市場リスク相当額、取引先リスク相当額及び基礎的リスク相当額の算出の基準等を定める件(次条において「単体告示」という。)(第一条第十八号、特別金融商品取引業者及びその子法人等の保有する資産等に照らし当該特別金融商品取引業者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(次条において「川下連結告示」という。)(第一条第二十一号及び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(次条において「川上連結告示」という。)(第一条第十四号の規定に基づき、適格格付業者及び適格格付機関として金融庁長官が別に指定する者は、銀行法第十四条の二の規定に基づき、銀行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等に基づき、金融庁長官が別に定める格付機関及び適格格付機関の格付に対応するものとして別に定める区分(平成十九年三月金融庁告示第二十八号。次条において「銀行格付告示」という。)(第二条各号に掲げる者とする。

(適格格付及び適格格付機関の格付に対応する区分)

第二条 単体告示第一条第十九号及び川下連結告示第一条第二十二号の規定に基づき、適格格付として金融庁長官が別に定める格付は、銀行格付告示第三条第一号の表の信用リスク区分1―1、1―2及び1―3並びに同条第五号の表の信用リスク区分5―1、5―2及び5―3に定める格付とする。

2 川上連結告示第一条第十五号の規定に基づき、適格格付機関の格付に対応するものとして金融庁長官が別に定める区分は、銀行格付告示第三条各号に掲げる事項について、当該各号の表に定めるものとする。

附 則

(適用日)

1 この告示は、平成二十三年四月一日から適用する。

(金融商品取引業者の市場リスク相当額、取引先リスク相当額及び基礎的リスク相当額の算出の基準等に基づき、適格格付業者及び適格格付を定める件の廃止)

2 金融商品取引業者の市場リスク相当額、取引先リスク相当額及び基礎的リスク相当額の算出の基準等に基づき、適格格付業者及び適格格付を定める件(平成二十二年十二月金融庁告示第百二十七号)は、廃止する。