

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。

(銀行におけ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（以下この条及び次条において「新銀行告示」という。）第七十九条第二項及び第三項、第一百五十七条第五項、第一百六十五条第五項、第二百六十条第二項並びに第二百七十条の七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。

第七十九条第二項	標準的手法採用行は、自己が国内基準行であり、かつ、次の各号に掲げる銀行のいずれにも該当しない場合にあつては	標準的手法採用行は

<p>第七十九条第三項</p>	<p>標準的手法採用行は、自己が国内基準行であり、かつ、前項各号に掲げる銀行のいずれにも該当しない場合において</p>	<p>標準的手法採用行が</p>
<p>第一百五十七条第五項</p>	<p>第七十九条（第二項及び第三項を除く。）から第七十九条の三の六までの規定は、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「標準的手法採用行」とあるのは「内部格付手法採用行」と、第七十九条第四項中「前三項」とあるのは「第一項」と読み替えるものとする。</p>	<p>第七十九条から第七十九条の四までの規定は、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、「標準的手法採用行」とあるのは「内部格付手法採用行」と読み替えるものとする。</p>

<p>第百六十五条第五項</p>	<p>第七十九条（第二項及び第三項を除く。 ）から第七十九条の三の六までの規定は、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「標準的手法採用行」とあるのは「内部格付手法採用行」と、第七十九条第四項中「前三項」とあるのは「第一項」と読み替えるものとする。</p>	<p>第七十九条から第七十九条の四までの規定は、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、「標準的手法採用行」とあるのは「内部格付手法採用行」と読み替えるものとする。</p>
<p>第二百六十条第二項</p>	<p>第七十九条（第二項及び第三項を除く。 ）から第七十九条の三の六までの規定を準用する。この場合において、これらの</p>	<p>第七十九条から第七十九条の四までの規定を準用する。この場合において、「標準的手法採用行」とあるのは「内部格付</p>

<p>第二百七十条の七第一項</p>	<p>同章（第七十九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>	<p>規定中「標準的手法採用行」とあるのは「内部格付手法採用行」と、第七十九条第四項中「前三項」とあるのは「第一項」と読み替えるものとする。</p> <p>手法採用行」と読み替えるものとする。</p>
--------------------	----------------------------------	---------------	--

2 内部格付手法採用行である銀行は、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を算出する場合において、当該EADの算出に当たって新銀行告示第七十九条の四に規定するカレント・エクスポージャー方式を用いているときは、当分の間、新銀行告示第百五十七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とすることができる。

$$\text{EAD} = \sqrt{(T_m/10)}$$

T_m は、新銀行告示第七十九条の三第七項の規定を準用して算出したリスクのマージンをいう。この場合において、「回算中」「前項」とあるのは「附則第二条第二項」と、「回算済」は「ネットテイング・セット」「二十営業日」とあり、及び「ネットテイング・セット」「十営業日」とあるのは、「ネットテイング・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、内部格付手法採用行である銀行が、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。

(銀行における適格中央清算機関に係る経過措置)

第三条 当分の間、新銀行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（次項及び附則第十四条において「旧銀行告示」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、新銀行告示第二百七十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、旧銀行告示第二百七十条の八の規定により算出するものとする。

（銀行持株会社におけ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）

第四条 当分の間、第二条の規定による改正後の銀行法第五十二条の二十五の規定に基づき、銀行持株会社が銀行持株会社及びその子会社の保有する資産等に照らしそれら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（以下この条及び次条において「新持株告示」という。）第五十七条第二項及び第三項、第三百三十五条第五項、第四百四十三条第五項、第二百三十八条第二項並びに第二百四十八条の七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。

<p>第五十七条第二項</p>	<p>標準的手法採用行は、自己が国内基準行であり、かつ、次の各号に掲げる銀行持株会社のいずれにも該当しない場合にあつては</p>	<p>標準的手法採用行は</p>
<p>第五十七条第三項</p>	<p>標準的手法採用行は、自己が国内基準行であり、かつ、前項各号に掲げる銀行持株会社のいずれにも該当しない場合において</p>	<p>標準的手法採用行が</p>
<p>第三百二十五条第五項</p>	<p>第五十七条（第二項及び第三項を除く。）から第五十七条の三の六までの規定は、事業法人等向けエクスポージャーのEA</p>	<p>第五十七条から第五十七条の四までの規定は、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</p>

	<p>Ｄについて準用する。この場合において、これらの規定中「標準的手法採用行」とあるのは「内部格付手法採用行」と、第五十七条第四項中「前三項」とあるのは「第一項」と読み替えるものとする。</p>	<p>いて、「標準的手法採用行」とあるのは「内部格付手法採用行」と読み替えるものとする。</p>
<p>第四百四十三条第五項</p>	<p>第五十七条（第二項及び第三項を除く。）から第五十七条の三の六までの規定は、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「標準的手法採用行」とあるのは「内部格付手法採用行」と、第五十七条第四項中「前三項」とあるのは</p>	<p>第五十七条から第五十七条の四までの規定は、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、「標準的手法採用行」とあるのは「内部格付手法採用行」と読み替えるものとする。</p>

<p>第二百四十八条の七 第一項</p>		<p>同章（第五十七条第二項及び第三項を除く。）の規定中</p>	<p>「第一項」と読み替えるものとする。</p> <p>「内部格付手法採用行」と、第五十七条第四項中「前三項」とあるのは「第一項」と読み替えるものとする。</p>
<p>同章の規定中</p>	<p>「第一項」と読み替えるものとする。</p> <p>「内部格付手法採用行」と読み替えるものとする。</p>		

2 内部格付手法採用行である銀行持株会社は、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を算出する場合において、当該EADの算出に当たって新持株告示第五十七条の四に規定するカレント・エクスポージャー方式を用いているときは、当分の間、新持株告示第三百三十五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とすることができ。

$$\text{掛目} = \sqrt{T_m/10}$$

T_m は、新持株告示第五十七条の三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、回算中「前項」とあるのは「附則第四条第二項」と、回算中「中」は「ネットテイング・セット 二十営業日」とあり、及び「ネットテイング・セット 十営業日」とあるのは、「ネットテイング・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、内部格付手法採用行である銀行持株会社が、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。

（銀行持株会社における適格中央清算機関に係る経過措置）

第五条 当分の間、新持株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、第二条の規定による改正前の銀行法第五十二条の二十五の規定に基づき、銀行持株会社が銀行持株会社及びその子会社の保有する資産等に照らしそれら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（次項において「旧持株告示」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、新持株告示第二百四十八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、旧持株告示第二百四十八条の八の規定により算出するものとする。

（信用金庫及び信用金庫連合会におけ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）

第六条 当分の間、第三条の規定による改正後の信用金庫法第八十九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、信用金庫及び信用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（以下この条及び次条において「新信金告示」という。）

）第七十三条第二項及び第三項、第五百五十六条第五項、第六百六十四条第五項、第二百六十条第二項並びに第二百七十条の八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。

第七十三条第二項	標準的手法採用金庫は、次の各号に掲げる信用金庫又は信用金庫連合会のいずれにも該当しない場合にあつては	標準的手法採用金庫は
第七十三条第三項	標準的手法採用金庫は、前項各号に掲げる信用金庫又は信用金庫連合会のいずれにも該当しない場合において	標準的手法採用金庫が

<p>第百五十六条第五項</p>	<p>第七十三条（第二項及び第三項を除く。）から第七十五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、第七十三条第四項中「前三項」とあるのは「第一項」と読み替えるものとする。</p>	<p>第七十三条から第七十六条までの規定は、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>第百六十四条第五項</p>	<p>第七十三条（第二項及び第三項を除く。）から第七十五条の六までの規定は、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、</p>	<p>第七十三条から第七十六条までの規定は、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、</p>

	<p>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、第七十三条第四項中「前三項」とあるのは「第一項」と読み替えるものとする。</p>
<p>第二百六十条第二項</p>	<p>第七十三条（第二項及び第三項を除く。）から第七十五条の六までの規定を準用する。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、第七十三条第四項中「前三項」とあるのは「第一項」と読み替えるものとする。</p>
	<p>第七十三条から第七十六条までの規定を準用する。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>第二百七十条の八第一項</p>	<p>同章（第七十三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を算出する場合において、当該EADの算出に当たって新信金告示第七十六条に規定するカレンダー・エクスポージャー方式を用いているときは、当分の間、新信金告示第五十六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とすることができる。

$$\text{掛田} = \sqrt{\text{Tm}/10}$$

Tmは、新信金告示第七十五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いう。この場合において、回場中「前項」とあるのは「附則第六条第二項」と、回場中「中」は「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。

(信用金庫及び信用金庫連合会における適格中央清算機関に係る経過措置)

第七条 当分の間、新信金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、第三条の規定による改正前の信用金庫法第八十九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、信用金庫及び信用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「旧信金告示」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、新信金告示第二百七十条の九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、旧信金告示第二百七十条の九の規定により算出するものとする。

(信用協同組合等におけ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)

第八条 当分の間、第四条の規定による改正後の協同組合による金融事業に関する法律第六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、信用協同組合及び信用協同組合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（以下この条及び次条において「新信組告示」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、第四百四十条第五項、第二百三十六条第二項並びに第二百四十六条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	標準的手法を採用する信用協同組合等は、次の各号に掲げる信用協同組合等のいずれにも該当しない場合にあつては	標準的手法を採用する信用協同組合等は
---------	--	--------------------

<p>第五十条第三項</p>	<p>標準的手法を採用する信用協同組合等は、前項各号に掲げる信用協同組合等のいずれにも該当しない場合において</p>	<p>標準的手法を採用する信用協同組合等が</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「標準的手法を採用する信用協同組合等」とあるのは「内部格付手法を採用する信用協同組合等」と、第五十条第四項中「前三項」とあるのは「第一</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、「標準的手法を採用する信用協同組合等」とあるのは「内部格付手法を採用する信用協同組合等」と読み替えるものとする。</p>

<p>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。）</p>	<p>項」と読み替えるものとする。</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「標準的手法を採用する信用協同組合等」とあるのは「内部格付手法を採用する信用協同組合等」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</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、「標準的手法を採用する信用協同組合等」とあるのは「内部格付手法を採用する信用協同組合等」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>	<p>項 から第五十二条の六までの規定を準用する。この場合において、「標準的手法」を採用する信用協同組合等とあるのは「内部格付手法を採用する信用協同組合等」と読み替えるものとする。</p> <p>用する。この場合において、「標準的手法を採用する信用協同組合等」とあるのは「内部格付手法を採用する信用協同組合等」と読み替えるものとする。</p>
--------------------------	--------------------------------------	---------------	---

2 内部格付手法を採用する信用協同組合等は、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を算出する場合において、当該EADの算出に当たって新信組告示第五十三条に規定するカレント・エクスポージャー方式を用いているときは、当分の間、新信組告示第三百三十二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とすることができ。

$$\text{EAD} = \sqrt{\text{TM}/10}$$

TMは、新信組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期間をいう。この場合において、「回過中」「前項」とあるのは「附則第八条第二項」と、「回過中」は「ネットテイグ・セット二十営業日」とあり、及び「ネットテイグ・セット 十営業日」とあるのは、「ネットテイグ・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、内部格付手法を採用する信用協同組合等が、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。

(信用協同組合等における適格中央清算機関に係る経過措置)

第九条 当分の間、新信組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、第四条の規定による改正前の協同組合による金融事業に関する法律第六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、信用協同組合及び信用協同組合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「旧信組告示」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、新信組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、旧信組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。

(最終指定親会社におけ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)

第十条 当分の間、第五条の規定による改正後の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（以下「新最終指定親会社告示」という。）第四十六条第一項本文（新最終指定親会社告

示第百三十四条第五項、第百四十二条第五項、第二百三十八条第二項及び第二百四十八条の七第一項において準用する場合を含む。）の規定にかかわらず、最終指定親会社は、カレント・エクスポージャー方式（第五条の規定による改正前の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（以下「旧最終指定親会社告示」という。）第四十七条に定めるところにより与信相当額を算出する方式をいう。以下同じ。）を用いて、先渡、スワップ及びオプションその他の派生商品取引の与信相当額を算出することができる。この場合において、最終指定親会社は、全ての派生商品取引について、S A I C C Rを用いて与信相当額を算出することができない。

2 前項の規定にかかわらず、最終指定親会社が、直近の算出基準日においてS A I C C Rを用いて派生商品取引の与信相当額を算出している場合には、あらかじめ、やむを得ない理由によりその使用を継続することができない旨を金融庁長官に届け出たとき又は新最終指定親会社告示第四十九条第一項の承認を受けたときを除き、これを継続して用いるものとする。

3 前二項の規定は、新最終指定親会社告示第四十六条第二項に規定する長期決済期間取引の与信相当額の

算出について準用する。この場合において、最終指定親会社は、派生商品取引と長期決済期間取引について異なる方式を用いることができる。

第十一条 最終指定親会社が包括的手法を適用する場合であつて、先渡、スワップ及びオプション等の派生商品取引について、カレント・エクスポージャー方式を使用し、かつ、適格金融資産担保を用いるときのエクスポージャーの額は、当分の間、旧最終指定親会社告示第三章第六節第三款の規定により算出するものとする。

2 最終指定親会社が簡便手法を適用する場合において、先渡、スワップ及びオプション等の派生商品取引について、カレント・エクスポージャー方式を使用し、かつ、適格金融資産担保を用いるときに、当該適格金融資産担保が旧最終指定親会社告示第九十二条第三号及び第四号に掲げるものであるときは、当分の間、同条第三号及び第四号に定めるリスク・ウェイトを適用することができる。

第十二条 標準的手法採用最終指定親会社は、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に對するトレード・エクスポージャーに係る金融商品取引法第二条第二十七項に規定する有価証券等清算取次ぎ、間接清算参加者の適格中央清算機関に對するトレード・エクスポージャーに係る商品先物取引法第

二条第二十項に規定する商品清算取引その他間接清算参加者の適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャーに係る取次ぎ又はこれらに類する海外の取引（以下「清算取次ぎ等」という。）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ついて、与信相当額の算出にカレント・エクスポージャー方式を用いている場合には、当分の間、旧最終指定親会社告示第百十五条の二の規定により算出した額を当該信用リスク・アセットの額とみなすことができる。この場合において、新最終指定親会社告示第十四条第一号の合計額の算出に当たっては、当該信用リスク・アセットの額を用いるものとする。

- 2 内部格付手法採用最終指定親会社は、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を算出する場合において、当該EADの算出に当たってカレント・エクスポージャー方式を用いているときは、当分の間、新最終指定親会社告示第百三十四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とすることができる。

$T_m = \sqrt{(T_m/10)}$

T_m は、新最終指定親会社告示第四十九条第七項の規定を適用して算出したリスクのマージンをいう。

この場合において、回場中「前項」とあるのは「附則第十二条第二項」と、回場中「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、内部格付手法採用最終指定親会社が、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。

第十三条 最終指定親会社がカレント・エクスポージャー方式を用いる場合において、新最終指定親会社告示第二百四十八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、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トイング・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。

$$\text{(割引現在価値)} = (\text{与信相当額}) \times (1 - \text{EXP}(-0.05 \times M_i)) / (0.05 \times M_i)$$

M_i は、新最終指定親会社告示第二四四十八条の三第一項に規定する M_i

3 第一項の規定により新最終指定親会社告示第二四四十八条の三第一項の算式における $EAD_{i \text{ total}}$ 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 $EAD_{i \text{ total}}$ 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、当該ネットティング・セットの $EAD_{i \text{ total}}$ とすることができる。

$$\text{掛田} = \sqrt{(T_m/10)}$$

T_m は、新最終指定親会社告示第四十九条第七項の規定を準用して算出したリスクのマージンをいう。

この場合において、回項中「前項」とあるのは「附則第十三条第三項」と、回項中「ネットティング・セット」とあり、及び「ネットティング・セット」とあり、及び「ネットティング・セット」とあるのは、「ネットティ

ング・セット 五営業日」と読み替えるものとする。

(最終指定親会社における適格中央清算機関に係る経過措置)

第十四条 当分の間、新最終指定親会社告示第一条第七号の三に掲げる用語の意義については、旧銀行告示第一条第七号の三の規定を準用する。この場合において、新最終指定親会社告示第一条第七号の三の規定は、適用しない。

2 当分の間、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ついては、旧銀行告示第二百七十条の八の規定を準用する。この場合において、新最終指定親会社告示第二百四十八条の八の規定は、適用しない。

3 前二項の場合において、旧銀行告示第一条第七号の三及び第二百七十条の八中「銀行」とあるのは、「最終指定親会社」と読み替えるものとする。