

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並びに適格格付業者の格付に対応する区分及び適格格付機関の格付に対応する区分を定める件

(平成二十三年二月二十五日)
(金融庁告示第十三号)

(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。)第一条第二十号、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。)第一条第二十三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規定する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。

(適格格付並びに適格格付業者の格付に対応する区分及び適格格付機関の格付に対応する区分)

第二条 単体告示第一条第二十一号及び川下連結告示第一条第二十四号の規定に基づき、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並びに同条第七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 単体告示第一条第七十号、川下連結告示第一条第七十三号及び川上連結告示第一条第十五号の規定に基づき、適格格付業者の格付に対応するもの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二百二十七号)は、廃止する。

附 則 [平成二三年一月二二日金融庁告示第一一九号]

(適用日)

1 この告示は、平成二十四年三月三十一日から適用する。

(最終指定親会社の子法人等である金融商品取引業者等に対する特例)

2 前項の規定にかかわらず、最終指定親会社(金融商品取引法(昭和二十三年法律第二

十五号。以下「法」という。) 第五十七条の十二第三項に規定する最終指定親会社をいう。) の子法人等 (法第五十七条の二第九項に規定する子法人等をいう。) である金融商品取引業者 (法第二条第九項に規定する金融商品取引業者をいい、法第二十八条第一項に規定する第一種金融商品取引業を行う者に限る。以下同じ。) 及び銀行持株会社の子法人等 (銀行法 (昭和五十六年法律第五十九号) 第五十二条の三十一第二項に規定する銀行持株会社の子法人等をいう。) 又は銀行の子法人等 (銀行法第二十四条第二項に規定する銀行の子法人等をいう。) である金融商品取引業者については、平成二十三年十二月三十一日から適用することができる。

附 則 [令和五年三月二八日金融庁告示第三一号]
(適用時期)

1 この告示は、令和五年三月三十一日から適用する。

(経過措置)

2 次に掲げる場合については、なお従前の例による。

- 一 金融商品取引業者が令和六年三月三十日までの間における市場リスク相当額及び取引先リスク相当額の算出を行う場合
- 二 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の一部を改正する件 (令和五年金融庁告示第三十六号) 附則第二項の規定によりなお従前の例により市場リスク相当額及び取引先リスク相当額の算出を行う場合
- 三 特別金融商品取引業者が令和六年三月三十日までの間における連結自己資本規制比率の算出を行う場合
- 四 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の一部を改正する件 (令和五年金融庁告示第三十五号) 附則第二項の規定によりなお従前の例により連結自己資本規制比率の算出を行う場合
- 五 最終指定親会社が令和六年三月三十日までの間における連結自己資本規制比率の算出を行う場合
- 六 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の一部を改正する件 (令和五年金融庁告示第二十五号) 附則第二条第一項の規定によりなお従前の例により連結自己資本規制比率の算出を行う場合