第一条第三十二号中「その他の特定順位参照型クレジット・デリバティブ」を「特定順位参照型クレジット・デリバティブ」に改め、「（ファースト・トゥ・デフォルト型クレジット・デリバティブ及びセカンド・トゥ・デフォルト型クレジット・デリバティブを除く。）」を削り、同条第三十六号ト中「及び欧州評議会開発銀行協議会向けエクスポージャー」を「、予防接種のための国際金融ファシリティ及び欧州評議会開発銀行向けエクスポージャー」に改め、同条中第七十四号を削り、同条第七十五号中「第七十八号」を「第七十七号」に改め、同号を同条第七十四号とし、同条中第七十六号を第七十五号とし、第七十七号から第八十号までを一号ずつ繰り上げ、同条第七十九号の次に次の三号を加える。

八十　追加的リスク　デフォルト・リスク及び格付遷移リスク（格付が変動した場合に資産の価格の変動を引き起こすリスクをいう。第八十二号及び第九章において同じ。）をいう。

八十一　コリレーション・トレーディング　裏付資産又は参照資産等（第三十二号において指定している複数の法人又は資産をいう。以下この号、第三百二条の六及び第三百二条の七において同じ。）について売買双方の流動性のある市場を有する証券化取引（再証券化取引を除く。）又は特定順位参照型クレジット・デリバティブ（証券化エクスポージャーを参照するデリバティブを除く。）であって、全ての裏付資産又は参照資産等が単一の債務者に係る債権であるポジション（単一の債務者に係るクレジット・デリバティブを含む。）及び当該ポジションに対してヘッジ効果を発揮するポジションをいう。

八十二　包括的リスク　デフォルト・リスク、格付遷移リスクその他コリレーション・トレーディングに係る資産の価格の変動を引き起こすリスクをいう。

第四条第一号中「すべて」を「全て」に改め、同号イ中「特定取引勘定の資産」の下に「（証券化取引を目的として保有している資産を除く。以下同じ。）」を加え、同条第二号中「すべて」を「全て」に改める。

第八条第一項第六号を次のように改める。

六　第二百四十七条（第百二十七条、第百三十六条第一項及び第三百二条の五第二項において準用する場合を含む。）に規定する控除項目の額の合計額

第十条第二項第二号中「に係る資産」の下に「（証券化取引を目的として保有している資産を除く。以下同じ。）」を加える。

第二十条第一項第五号を次のように改める。

五　第二百四十七条（第百二十七条、第百三十六条第一項及び第三百二条の五第二項において準用する場合を含む。）に規定する控除項目の額の合計額

第三十一条第一項第六号を次のように改める。

六　第二百四十七条（第百二十七条、第百三十六条第一項及び第三百二条の五第二項において準用する場合を含む。）に規定する控除項目の額の合計額

第四十三条第一項第五号を次のように改める。

五　第二百四十七条（第百二十七条、第百三十六条第一項及び第三百二条の五第二項において準用する場合を含む。）に規定する控除項目の額の合計額

第六十条第二項中「イスラム開発銀行」の下に「、予防接種のための国際金融ファシリティ」を加える。

第百三十九条を次のように改める。

（特定順位参照型クレジット・デリバティブの扱い）

第百三十九条　前二条の規定は、特定順位参照型クレジット・デリバティブ（ファースト・トゥ・デフォルト型クレジット・デリバティブ及びセカンド・トゥ・デフォルト型クレジット・デリバティブを除く。）について準用する。

第百五十四条の二第一項第三号を次のように改める。

三　特定順位参照型クレジット・デリバティブ（前号に掲げるものを除く。）

第二百四十九条第一項を次のように改める。

標準的手法採用行が証券化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場合には、適格格付機関の付与する格付に対応する信用リスク区分に応じ、次に定めるリスク・ウェイトを当該証券化エクスポージャーの額に乗じて得た額を信用リスク・アセットの額とする。

一　長期格付の場合のリスク・ウェイトは、次のイ又はロの表に定めるところによる。

イ　オリジネーターのとき。

信用リスク区分	証券化エクスポージャー（再証券化エクスポージャーを除く。）の場合（パーセント）	再証券化エクスポージャーの場合（パーセント）
6―1	二十	四十
6―2	五十	百
6―3	百	二百二十五
6―4	自己資本控除	
6―5		

ロ　イ以外のとき。

信用リスク区分	証券化エクスポージャー（再証券化エクスポージャーを除く。）の場合（パーセント）	再証券化エクスポージャーの場合（パーセント）
6―1	二十	四十
6―2	五十	百
6―3	百	二百二十五
6―4	三百五十	六百五十
6―5	自己資本控除	

二　短期格付の場合のリスク・ウェイトは、次の表に定めるところによる。

信用リスク区分	証券化エクスポージャー（再証券化エクスポージャーを除く。）の場合（パーセント）	再証券化エクスポージャーの場合（パーセント）
7―1	二十	四十
7―2	五十	百
7―3	百	二百二十五
7―4	自己資本控除	

第二百四十九条第三項中「次の各号に」を「次に」に改め、同項に次の一号を加える。

四　銀行が保有する証券化エクスポージャーに対して付与された格付が、当該銀行による流動性補完、信用補完その他の事前の資金の払込みを伴わない方法による信用供与（第六項において「流動性補完等」という。）に基づき付与されたものではないこと。