第二百二十七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	

第二百二十七条第三項中「次の各号に」を「次に」に改め、同項に次の一号を加える。

四　銀行持株会社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、当該銀行持株会社による流動性補完、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。

第二百二十七条第四項中「次の各号に」を「次に」に改め、同項に次の五号を加える。

三　銀行持株会社の保有する証券化エクスポージャーについて、包括的なリスク特性に係る情報を継続的に把握するために必要な体制が整備されていること。

四　銀行持株会社の保有する証券化エクスポージャーの裏付資産について、包括的なリスク特性及びパフォーマンスに係る情報を適時に把握するために必要な体制が整備されていること。

五　銀行持株会社の保有する証券化エクスポージャーについて、当該証券化エクスポージャーに係る証券化取引についての構造上の特性を把握するために必要な体制が整備されていること。

六　銀行持株会社が、第一条第二号の二イ又はロの規定により再証券化取引から除かれる証券化取引に係るエクスポージャーを保有している場合には、当該証券化取引の裏付資産の一部又は全部となっている証券化エクスポージャーに係る裏付資産について、包括的なリスク特性及びパフォーマンスに係る情報を適時に把握するために必要な体制が整備されていること。

七　第三号から前号までに掲げる基準を満たすための管理規程等を作成していること。

第二百二十七条第八項中「同項各号に該当する適格流動性補完」を「無格付の適格流動性補完」に、「当該適格流動性補完」を「とする」を「とすることができる」に改め、同項を同条第九項とし、同条中第七項を第八項とし、同条第六項中「すべて」を「全て」に改め、「無格付」の下に「（同項各号に該当する場合を含む。以下この条、次条及び第二百三十二条において同じ。）」を加え、同項第一号を次のように改める。

一　当該証券化エクスポージャーが最優先証券化エクスポージャー（証券化エクスポージャーの裏付資産の全額に対して、金利スワップ、為替スワップのカウンターパーティの請求権その他の重要でない請求権を除いて、第一順位の担保権を有しているもの又は裏付資産の全額が第一順位の権利により裏付けられているもの（再証券化エクスポージャーである場合には、裏付資産の全部又は一部に再証券化エクスポージャーが含まれているものを除く。）をいう。以下同じ。）であること。

第二百二十七条第六項を同条第七項とし、同条第五項の次に次の一項を加える。

6　銀行持株会社が保有する証券化エクスポージャーに対して当該銀行持株会社により流動性補完等が提供されている場合であって、当該流動性補完等が当該銀行持株会社が保有する証券化エクスポージャーの一部又は全部に対して行われていることが明らかであるときは、当該流動性補完等が行われていることが明らかである部分については、当該証券化エクスポージャー及び当該流動性補完等に係る信用リスク・アセットの額の合計額に代えて、当該証券化エクスポージャー又は当該流動性補完等に係る信用リスク・アセットの額のうち最大の額のみを自己資本比率の計算に用いることができる。

第二百二十八条第一項各号を次のように改める。

一　適格格付機関による格付に応じたリスク・ウェイトを用いて信用リスク・アセットの額が算出される適格流動性補完　百パーセント

二　無格付の適格流動性補完　五十パーセント

三　適格なサービサー・キャッシュ・アドバンスの信用供与枠のうち未実行部分　零パーセント

四　前三号に掲げる証券化エクスポージャー以外のもの　百パーセント

第二百二十八条第二項中「場合は」を「ことが明らかであるときは、当該重複して設定していることが明らかである部分について」に改める。

第二百三十一条に次の一項を加える。

4　第二百二十七条第六項の規定は、この款の規定により信用リスク・アセットを計算する場合に準用する。