2　内部モデル方式を用いて算出する追加的リスクに係るマーケット・リスク相当額は、次の各号に掲げる額のうちいずれか大きい額とする。ただし、追加的リスク計測モデルにより算出される追加的リスクの額は、一週間に一回以上の頻度で計測するものとする。

一　算出基準日の追加的リスクの額

二　算出基準日を含む直近十二週間の追加的リスクの額の平均値

（乗数）

第二百五十五条　内部モデル方式における乗数は、次の表の上欄に掲げる超過回数（内部モデルを用いる部分について、算出基準日を含む直近二百五十営業日の日ごとの損益（実際に発生した損益又はポートフォリオを固定した場合において発生したと想定される損益をいう。）のうち、その日ごとの損失の額が、保有期間を一日としてリスク計測モデル（追加的リスク計測モデル及び第二百八十条の十第三項第三号に規定する包括的リスク計測モデルを除く。）を使用して算出した日ごとのバリュー・アット・リスクを上回る回数をいう。以下この条において同じ。）に応じ、同表の下欄に定める値とする。

超過回数	乗数
零	三・〇〇
一	三・〇〇
二	三・〇〇
三	三・〇〇
四	三・〇〇
五	三・四〇
六	三・五〇
七	三・六五
八	三・七五
九	三・八五
十以上	四・〇〇

2　前項の規定にかかわらず、超過回数が五回以上十回未満であって、超過が市場の特殊要因等に起因すると認められる場合には、当該超過回数以下の超過回数に係る乗数とすることができる。

3　内部モデル方式を用いている銀行持株会社は、超過回数が五回以上となったときは、その都度、直ちに、その旨を記載した届出書に超過回数が五回以上となった原因を記載した書類を添付して金融庁長官に提出しなければならない。

第二百五十六条第一項第三号中「前条」を「第二百五十三条」に改める。

第二百五十七条第一号中「第二百五十四条第一項」を「第二百五十五条第一項」に改め、同条第二号中「第二百五十四条第三項」を「第二百五十五条第三項」に改める。

第二百五十九条に次の一項を加える。

2　前項の規定にかかわらず、銀行持株会社は債券等のショート・ポジションの個別リスクの額に代えて、当該ショート・ポジションにおいて発生し得る最大の損失額を当該ショート・ポジションの個別リスクの額とすることができる。

第二百六十一条の見出し中「相殺等」を「相殺」に改め、同条第二項を削る。

第二百六十二条第二項を削る。

第二百六十七条第一項中「すべて」を「全て」に改め、「（ポートフォリオの流動性が高く、かつ、分散されている場合は四パーセント）」を削る。

第七章に次の三節を加える。

第四節　証券化エクスポージャーに係る特例

（標準的手法採用行における証券化エクスポージャーの個別リスク）

第二百八十条の二　前三節の規定にかかわらず、標準的手法採用行が証券化エクスポージャーの個別リスク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・ウェイトを第二百六十条又は第二百六十一条に定める要領に基づき証券化エクスポージャーの銘柄ごとに相殺した後のネット・ポジションの額に乗じて得た額を個別リスクの額とする。

一　長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）
6—1	一・六	三・二
6—2	四	八
6—3	八	十八
6—4	二十八	五十二
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	一・六	三・二
7—2	四	八
7—3	八	十八
7—4	自己資本控除	

（内部格付手法採用行における証券化エクスポージャーの個別リスク）

第二百八十条の三　前三節の規定にかかわらず、内部格付手法採用行が証券化エクスポージャーの個別リスク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・ウェイトを第二百六十条又は第二百六十一条に定める要領に基づき証券化エクスポージャーの銘柄ごとに相殺した後のネット・ポジションの額に乗じて得た額を個別リスクの額とする。

一　長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）	
	Zが六以上であり、かつ、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（内部評価方式による場合を含む。）である場合	Zが六以上の場合	当該再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（内部評価方式による場合を含む。）である場合	Zが六未満の場合
8—1	〇・五六	〇・九六	一・六〇	一・六〇
8—2	〇・六四	一・二〇	二・〇〇	二・〇〇
			二・四〇	三・二〇