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信用金庫連合会は、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。

第二百七十八条第一項第三号中「前条」を「第二百七十五条」に改める。

第二百七十九条第一号中「第二百七十六条第一項」を「第二百七十七条第一項」に改め、同条第二号中「第二百七十六条第三項」を「第二百七十七条第三項」に改める。

第二百八十一条に次の一項を加える。

2　前項の規定にかかわらず、信用金庫連合会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。

第二百八十三条の見出し中「相殺等」を「相殺」に改め、同条第二項を削る。

第二百八十四条第二項を削る。

第二百八十九条第一項中「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。

第九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

（標準的手法採用金庫における証券化エクスポージャーの個別リスク）

第三百二条の二　前三節の規定にかかわらず、標準的手法採用金庫（信用金庫連合会に限る。）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・ウェイトを第二百八十二条又は第二百八十三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	

（内部格付手法採用金庫における証券化エクスポージャーの個別リスク）

第三百二条の三　前三節の規定にかかわらず、内部格付手法採用金庫（信用金庫連合会に限る。）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・ウェイトを第二百八十二条又は第二百八十三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		再証券化エクスポージャーの場合	
	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（パーセント）	Zが六以上の場合（パーセント）	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（パーセント）	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。）でない場合（パーセント）
8—1	〇・五六	〇・九六	一・六〇	二・四〇
8—2	〇・六四	一・二〇	二・〇〇	三・二〇
8—3	〇・八〇	一・四四	二・八〇	四・〇〇
8—4	〇・九六	一・六〇	三・二〇	五・二〇
8—5	一・六〇	二・八〇	四・八〇	八・〇〇
8—6	二・八〇	四・〇〇	八・〇〇	十二・〇〇
8—7	四・八〇	六・〇〇	十二・〇〇	十八・〇〇
8—8	八・〇〇		十六・〇〇	二十八・〇〇
8—9	二十・〇〇		二十四・〇〇	四十・〇〇
8—10	三十四・〇〇		四十・〇〇	五十二・〇〇
8—11	五十二・〇〇		六十・〇〇	六十八・〇〇
8—12	自己資本控除			