| | | |
|---|---|---|
| 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 | |

第二百二十五条第三項中「次の各号に」を「次に」に改め、同項に次の一号を加える。

四　組合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、当該組合による流動性補完、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。

第二百二十五条第四項中「次の各号に」を「次に」に改め、同項に次の五号を加える。

三　組合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　組合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　組合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　組合が、第一条第一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。

第二百二十五条第八項中「同項各号に該当する」を「無格付の」に、「当該流動性補完」を「当該適格流動性補完」に、「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、同条第七項中「すべて」を「全て」に改め、同項を同条第八項とし、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（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。

第二百二十五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　組合が保有する証券化エクスポージャーに対して当該組合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組合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。

第二百二十六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

第二百二十六条第二項中「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。

第二百二十九条に次の一項を加える。

4　第二百二十五条第六項の規定は、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。

第二百三十二条第一項中「次の各号に」を「次に」に改め、同項第一号中「掲げる」を「定める」に改め、同号の表（同表の（注）を除く。）を次のように改める。

| 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 | |
|---|---|---|---|---|
| | N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） | N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 | 七 | 十二 | 二十 | 三十 |
| 8—2 | 八 | 十五 | 二十五 | 四十 |
| 8—3 | 十 | 十八 | 三十五 | 五十 |
| 8—4 | 十二 | 二十 | 四十 | 六十五 |
| 8—5 | 二十 | 三十五 | 六十 | 百 |
| 8—6 | 三十五 | 五十 | 百 | 百五十 |
| 8—7 | 六十 | 七十五 | 百五十 | 二百二十五 |