$RWA^{*}=RWA\times\sqrt{(Tm/10)}$

RWA^{*}は、この条の規定の適用後の信用リスク・アセットの額

RWAは、第一節から前節までの規定により算出した当該トレード・エクスポージャーに係る信用リスク・アセットの額

Tmは、第五十六条の四第七項の定めに従い算出したリスクのマージン期間。この場合において、同項第一号の規定にかかわらず、日々の値洗いにより担保額が調整されるネッティング・セットに係るリスクのマージン期間は五営業日とすることができる。

第百二十三条第一項中「すべて」を「全て」に、「ついて内部格付手法」を「ついて、内部格付手法」に改める。

第百二十九条第二号中「第二十五条」を「第二十五条第一項」に改め、同条に次の一号を加える。

四　第六章の三に定めるところにより算出した第二十五条第一項第三号に規定する中央清算機関連エクスポージャーに係る信用リスク・アセットの額

第百三十四条に次の一項を加える。

6　農林中央金庫が内部格付手法を採用した場合に直接清算参加者として間接清算参加者の適格中央清算機関向けトレード・エクスポージャーに係る清算取次ぎ等を行うことにより生ずる間接清算参加者に対するトレード・エクスポージャーのEADを算出する場合であって、当該EADの算出に当たって第五十六条の四に定める期待エクスポージャー方式を用いていないときには、前各項の規定により算出したEAD（当該エクスポージャーに係るものに限る。）に次の掛け目を乗じた額を当該間接清算参加者に対するトレード・エクスポージャーのEADとすることができる。

掛け目＝$\sqrt{(Tm/10)}$

Tmは、第五十六条の四第七項の規定を準用して算出したリスクのマージン期間。この場合において、同項第一号中「ネッティング・セット　二十営業日」とあり、及び「ネッティング・セット　十営業日」とあるのは「ネッティング・セット　五営業日」と読み替えるものとする。

第百四十二条に次の一項を加える。

6　第百三十四条第六項の規定は、リテール向けエクスポージャーであって、農林中央金庫が内部格付手法を採用した場合に直接清算参加者として間接清算参加者の適格中央清算機関向けトレード・エクスポージャーに係る清算取次ぎ等を行うことにより生ずる間接清算参加者に対するトレード・エクスポージャーのEADを算出する場合について準用する。

第二百四十七条の二第一項中「清算機関等」を「次の各号に掲げる者」に改め、同項に次の各号を加える。

一　中央清算機関

二　農林中央金庫が適格中央清算機関の間接清算参加者である場合であって、次に掲げる要件の全てを満たす取引に係る直接清算参加者

イ　間接清算参加者のトレード・エクスポージャーについて、次に掲げる場合における間接清算参加者の損失の発生を防ぐための方策を適格中央清算機関又は直接清算参加者が講じていること。

(1)　直接清算参加者が債務不履行又は支払不能となった場合

(2)　他の間接清算参加者が債務不履行又は支払不能となった場合

ロ　間接清算参加者がその適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャーに係る清算取次ぎ等を委託している直接清算参加者が債務不履行又は支払不能により適格中央清算機関の清算参加者としての資格を失った場合においても、間接清算参加者が追加的な負担をすることなく他の直接清算参加者又は適格中央清算機関と当該トレード・エクスポージャーに関する契約を継続又は承継するための枠組みが存在していること。

三　資金清算機関等

第二百四十七条の二第二項中「清算機関等」を「次の各号に掲げる者」に改め、同項に次の各号を加える。

一　中央清算機関

二　農林中央金庫が中央清算機関の間接清算参加者である場合であって、前項第二号に掲げる要件の全てを満たす取引に係る直接清算参加者

三　資金清算機関等

第二百四十七条の三に次の一項を加える。

7　第四項第一号又は第二号に掲げる場合において、第一項のEAD^{gross}（直接清算参加者として間接清算参加者の適格中央清算機関向けトレード・エクスポージャーに係る清算取次ぎ等を行うことにより生ずる間接清算参加者に対するトレード・エクスポージャーに係るものに限る。）を算出する場合には、同項第一号又は第二号に定める額に次の掛け目を乗じた額を、当該ネッティング・セットのEAD^{gross}とすることができる。

掛け目＝$\sqrt{(Tm/10)}$

Tmは、第五十六条の四第七項の規定を準用して算出したリスクのマージン期間。この場合において、同項第一号中「ネッティング・セット　二十営業日」とあり、及び「ネッティング・セット　十営業日」とあるのは「ネッティング・セット　五営業日」と読み替えるものとする。

第六章の二の次に次の一章を加える。

第六章の三　中央清算機関関連エクスポージャーの取扱い

（中央清算機関関連エクスポージャーの信用リスク・アセット）

第二百四十七条の六　第四章及び第五章の規定にかかわらず、次の各号に掲げるエクスポージャーの信用リスク・アセットの計算は、この章の定めるところによる。

一　中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー

二　中央清算機関に係る清算基金

三　農林中央金庫が間接清算参加者である場合の直接清算参加者に対するトレード・エクスポージャーであって、第二百四十七条の二第一項第二号に掲げる要件の全てを満たすもの（次条において「直接清算参加者向けトレード・エクスポージャー」という。）

（中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー及び直接清算参加者向けトレード・エクスポージャーの信用リスク・アセット）

第二百四十七条の七　第四章の規定は、中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー及び直接清算参加者向けトレード・エクスポージャーの信用リスク・アセットの額の算出について準用する。この場合において、「農林中央金庫が標準的手法を採用した場合」とあるのは「農林中央金庫が標準的手法又は内部格付手法を採用した場合」と、第五十六条の四の四、第五十六条の四の五及び第五十六条の四の六第一項中「標準的手法を採用した農林中央金庫」とあるのは「農林中央金庫」と、第五十六条の四の六第二項中「標準的手法を採用し、期待エクスポージャー方式の承認を受けた農林中央金庫」とあるのは「期待エクスポージャー方式の承認を受けた農林中央金庫」と読み替えるものとする。

2　前項の規定にかかわらず、次の各号に掲げるトレード・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、当該トレード・エクスポージャーのリスク・ウェイトは、二パーセントとする。また、次の各号に掲げるトレード・エクスポージャーの信用リスク・アセットの額の算出について前項の規定に基づき第四章の規定を準用する場合において、第五十六条の四第七項第一号中「イからニまで」とあるのは「イ、ロ又はニ」と、同号イ中「ロ又はハ」とあるのは「ロ」と、同号ニ中「イからハまで」とあるのは「イ又はロ」と、第七十七条第二項第一号ニ中「流動性の低い担保又は再構築の困難な派生商品取引を含むネッティング・セット及び算出基準日を含む四半期の一期前の四半期内のいずれかの時点で取引件数が五千件を超えたネッティング・セット」とあるのは「流動性の低い担保又は再構築の困難な派生商品取引を含むネッティング・セット」と読み替えるものとする。

一　適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー

二　直接清算参加者向けトレード・エクスポージャー

3　第一項の規定にかかわらず、直接清算参加者向けトレード・エクスポージャー（農林中央金庫が間接清算参加者である場合において、直接清算参加者及び他の間接清算参加者が共に債務不履行又は支払不能となった場合に、農林中央金庫への損失の発生を防ぐための方策を適格中央清算機関又は直接清算参加者が講じていない場合に限る。）の信用リスク・アセットの額を算出する場合、当該直接清算参加者向けトレード・エクスポージャーのリスク・ウェイトは、四パーセントとする。