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$_i^{total}$（直接清算参加者としてi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i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、第四項第一号又は第二号に定める額に次の掛目を乗じた額を、当該ネッティング・セットのEAD$_i^{total}$とすることができる。

掛目＝$\sqrt{\ }$（Tm/10）

Tmは、第五十七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。

第二百四十八条の四第一項中「に十二・五を乗じて得た額」を削る。

第八章の二に次の一節を加える。

第四節　簡便的リスク測定方式

（簡便的リスク測定方式によるCVAリスク相当額）

第二百四十八条の五の二　簡便的リスク測定方式を用いて算出するCVAリスク相当額は、第二百四十八条の二第一項各号に掲げる者以外の者を取引相手方とする派生商品取引の信用リスク・アセットの額に十二パーセントを乗じて得た額とする。

第二百四十八条の八第二項第一号を次のように改める。

一　所要自己資本額（K$_{CM}$）は次の算式を用いて算出する。

$$K_{CM}=\left(1+\frac{A_{Net,1}+A_{Net,2}}{\sum_i A_{Net,i}}\cdot\frac{N}{N-2}\right)\cdot\frac{DF}{DF_{CM}}\cdot K^*_{CM}$$

$$K^*_{CM}=\begin{cases}100\%\cdot 1.2\cdot(K_{CCP}-DF')+100\%\cdot DF'_{CM} & if\quad DF'<K_{CCP} \quad (i)\\ 100\%\cdot(K_{CCP}-DF_{CCP})+c_1\cdot(DF'-K_{CCP}) & if\ DF_{CCP}<K_{CCP}\leqq DF' \quad (ii)\\ c_1\cdot DF'_{CM} & if\quad K_{CCP}\leqq DF_{CCP} \quad (iii)\end{cases}$$

$$K_{CCP}=\sum_i max\left(EBRM_i-IM_i-DF_i,\ 0\right)\cdot 20\%\cdot 8\%$$

$$DF_{CM}=\sum_i DF_i$$

$$DF'_{CM}=DF_{CM}-2\cdot DF_{CM}/N$$

$$DF'=DF_{CCP}+DF'_{CM}$$

$$c_1=Max\left\{\frac{1.6\%}{(DF'/K_{CCP})^{0.3}};\ 0.16\%\right\}$$

K$^*_{CM}$は、当該適格中央清算機関に係るみなし所要自己資本額（第八号及び第九号において同じ。）

Nは、当該適格中央清算機関に係る直接清算参加者の数（第八号及び第九号において同じ。）

DFは、当該適格中央清算機関に銀行持株会社が拠出した清算基金の額

DF$_{CCP}$は、当該適格中央清算機関が有する資本その他これに類するものであって、直接清算参加者の債務不履行により中央清算機関に生ずる損失を清算基金（債務不履行参加者の清算基金を除く。）に先立ち負担するものの額

EBRM$_i$は、当該適格中央清算機関が有するi直接清算参加者に対するエクスポージャーの額に当該i直接清算参加者が拠出した当初証拠金の額を加えた額

IM$_i$は、i直接清算参加者が拠出したi当初証拠金（第九号において同じ。）

DF$_i$は、i直接清算参加者が拠出したi清算基金

A$_{Net,i}$は、i直接清算参加者に対するエクスポージャーの額の合計額（第八号及び第九号において同じ。）

A$_{Net,1}$は、当該適格中央清算機関が有するi直接清算参加者に対するエクスポージャーの額のうち最大の額（第八号及び第九号において同じ。）

A$_{Net,2}$は、当該適格中央清算機関が有するi直接清算参加者に対するエクスポージャーの額のうち二番目に大きい額（第八号及び第九号において同じ。）

$\sum_i A_{Net,i}$は、当該適格中央清算機関が有するi直接清算参加者に対するエクスポージャーの額の合計額（第八号及び第九号において同じ。）

第二百四十八条の八第二項第四号を次のように改める。

四　前号の場合において、第五十七条の二第三項第二号のネットのアドオンについては、次の算式を用いる。

$$\text{ネットのアドオン}=0.15\times\text{グロスのアドオン}+0.85\times\frac{\text{ネット再構築コスト}}{\text{グロス再構築コスト}}\times\text{グロスのアドオン}$$

第二百四十八条の八第二項第七号中「いない場合は」を「いないときは」に改め、同項第八号及び第九号を次のように改める。

八　第一号において、各i直接清算参加者が拠出した清算基金の額の合計額（DF$_{CM}$）が零を上回らない場合は、次の算式を用いて所要自己資本額（K$_{CM}$）を算出することを要する。

$$K_{CM}=\left(1+\frac{A_{Net,1}+A_{Net,2}}{\sum_i A_{Net,i}}\cdot\frac{N}{N-2}\right)\cdot\frac{DF^*}{\sum_i DF^*_i}\cdot K^*_{CM}$$

DF*は、当該適格中央清算機関に対する銀行持株会社の未拠出の清算基金の額

DF$^*_i$は、i直接清算参加者iの未拠出の清算基金の額

九　前号において、各i直接清算参加者の未拠出の清算基金の額の合計額が零を上回らない場合は、次の算式を用いて所要自己資本額（K$_{CM}$）を算出することを要する。

$$K_{CM}=\left(1+\frac{A_{Net,1}+A_{Net,2}}{\sum_i A_{Net,i}}\cdot\frac{N}{N-2}\right)\cdot\frac{IM}{\sum_i IM_i}\cdot K^*_{CM}$$

IMは、当該適格中央清算機関に銀行持株会社が拠出した当初証拠金の額

第二百四十八条の八第二項を次のように改める。

3　第一項第二号に掲げる「簡便的手法」とは、次の算式により信用リスク・アセットの額を算出する手法をいう。この場合において、当該適格中央清算機関に対するトレード・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ことを要しない。

$$Min\{(2\%\cdot TE+1250\%\cdot DF),\ 20\%\cdot TE\}$$

TEは、当該適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャーの額

DFは、当該適格中央清算機関に銀行持株会社が拠出した清算基金の額

第二百五十二条第三項第十号を次のように改める。

十　内部モデル方式を採用しようとする銀行持株会社について、次のイ又はロに掲げる銀行持株会社の区分に応じ、当該イ又はロに定める要件を満たすこと。

イ　国際統一基準行　第二条第三号の算式により得られる比率が八パーセント以上であること。

ロ　国内基準行　当該銀行持株会社を国際統一基準行であるとみなして第二条第一号の算式により得られる比率が四・五パーセント以上であること。

第七章に次の一節を加える。

第七節　特定項目のうち調整項目に算入されない部分等に係る特例

（特定項目のうち調整項目に算入されない部分等に係る特例）

第二百八十条の十四　第百五十六条の二の三から第百五十六条の四までの規定は、マーケット・リスク相当額を算出する場合について準用する。この場合において、これらの規定中「内部格付手法採用行」とあるのは「銀行持株会社」と、「第百三十一条から前条までの規定にかかわらず」とあるのは「前六節の規定にかかわらず」と、「に係るエクスポージャーの信用リスク・アセットの額」とあるのは「のマーケット・リスク相当額」と、「当該エクスポージャーの額（EADをいう。）」とあるのは「当該部分の額」と、「一百五十パーセント」とあるのは「二十パーセント」と読み替えるものとする。