第六十九条第一項中「（エクスポージャーと担保の価格変動に伴う信用供与額の変化を担保額によって調整する仕組みをいう。以下同じ。）」を削り、同項第一号を次のように改める。

一　適格金融資産担保が債券である場合　適格格付機関が債券に付与した格付その他の条件、債券の残存期間及び発行体に応じて、次の表に定めるボラティリティ調整率

適格格付機関の格付に対応する信用リスク区分等	残存期間	ボラティリティ調整率		
		特定の発行体の場合（パーセント）	特定の発行体以外の発行体であって証券化エクスポージャーの場合（パーセント）	証券化エクスポージャー以外の場合（パーセント）
信用リスク区分が1―1、2―1、4―1、5―1、6―1若しくは7―1の場合又は第六十四条第三号に該当する場合	一年以下	〇・五	一	二
	一年超五年以下	二	四	八
	五年超	四	八	十六
信用リスク区分が1―2、1―3、2―2、4―2、4―3、5―2、5―3、6―2、6―3、7―2若しくは7―3の場合又は第六十四条第五号の条件を満たす場合	一年以下	一	二	四
	一年超五年以下	三	六	十二
	五年超	六	十二	二十四
信用リスク区分が1―4又は2―3の場合	全ての期間	十五	一	一

（注）　特定の発行体とは、中央政府等（中央政府、中央銀行、国際決済銀行、国際通貨基金、欧州中央銀行、欧州共同体及び零パーセントのリスク・ウェイトが適用される国際開発銀行をいう。以下この節において同じ。）、我が国の地方公共団体、地方公共団体金融機構及び我が国の政府関係機関をいう。

第七十五条第二項中「保有期間が、第一号イからハまで」を「保有期間及び第一号イからニまで」に、「上回る場合」を「上回る場合には」に改め、同項第一号を次のように改める。

一　最低保有期間は、次のイからニまでに掲げる取引の区分に応じ、当該イからニまでに定める期間とする。

イ　レポ形式の取引のうち担保額調整に服しているもの（ニに該当するものを除く。）　五営業日

ロ　その他資本市場取引（適格金融資産担保付派生商品取引及び信用取引その他これに類する海外の取引をいう。以下同じ。）のうち担保額調整に服しているもの（ニに該当するものを除く。）　十営業日

ハ　イ及びロに該当しない適格金融資産担保付取引　二十営業日

ニ　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　二十営業日

第七十五条第二項第一号の次に次の一号を加える。

一の二　前号の規定にかかわらず、算出基準日を含む四半期の前の直近の連続する二の四半期の間に、同号イからニまでに掲げるいずれかの取引について、担保額調整に係る係争により、同号の最低保有期間を超える清算期間を要する場合が三回以上生じたときは、次の連続する二の四半期の間は、当該取引については、最低保有期間の少なくとも二倍以上の期間を最低保有期間とみなす。

第七十八条中「すべて」を「全て」に改め、同条第一号中「（取引相手が現金若しくは証券を引き渡す義務又は追加担保を提供する義務その他の義務を履行しないこと及び債務超過、破産手続開始の決定、再生手続開始の決定、更生手続開始の決定、特別清算開始の命令その他これらに類する事由の発生を含む。）」を削る。

第八十二条に次の一項を加える。

5　標準的手法を採用する信用協同組合等は、前項の規定にかかわらず、第七十五条第二項第一号ニ及び第一号の二の規定により算出する最低保有期間を適用する取引については、第三項第二号に定める保有期間には当該最低保有期間を適用しなければならない。

第九十七条第二号中「4―2以上の信用リスク区分に対応する」を削る。

第九十九条中「を自己資本から控除」を「について第六章の規定を準用することにより定められるリスク・ウェイトを適用」に改める。

第百一条中「して取り扱わ」を「することにより定められるリスク・ウェイトを適用し」に改める。

第百十条第二項中「二千五百パーセント」を「千二百五十パーセント」に改める。

第四章に次の一節を加える。

第七節　間接清算参加者に対するトレード・エクスポージャーの信用リスク・アセットの額の算出方法の特例

（間接清算参加者に対するトレード・エクスポージャーの信用リスク・アセットの額の算出方法の特例）

第百十三条の二　標準的手法を採用する信用協同組合等が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ついて、与信相当額の算出に第五十三条に定める期待エクスポージャー方式を用いていない場合には、当該トレード・エクスポージャーに係る信用リスク・アセットの額は、次の算式により算出した額を当該信用リスク・アセットの額とみなすことができる。

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

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、第五十三条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。

第百二十二条第一項中「次の各号に」を「次に」に改め、同項第一号及び第二号中「信用リスク・アセットの額の合計額に」を「第百二十六条第一号及び第二号に掲げる額の合計額に」に改め、同条第二項中「基本的項目の額と補完的項目の額の合計額の十パーセント」を「、自己資本の額に十パーセントを乗じて得た額」に、「基本的項目の額と補完的項目の額の合計額の五パーセント」を「自己資本の額に五パーセントを乗じて得た額」に改める。

第百二十三条中「第百二十七条第三項及び第五項に基づき」を「第百二十七条第四項及び第六項の規定により」に改める。

第百二十四条第一項中「第百二十七条第三項及び第五項」を「第百二十七条第四項及び第六項の規定」に改め、同条第二項中「第百二十七条第三項」を「第百二十七条第四項」に改め、同条第三項中「第百二十七条第五項」を「第百二十七条第六項」に改め、同条第四項中「二千五百パーセント」を「千二百五十パーセント」に改める。