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　標準的手法採用組合は、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　標準的手法採用組合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、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。

第百二十六条第一号中「含む。）」の下に「、第百四十一条第一項第二号に掲げるPD/LGD方式の適用対象となる株式等エクスポージャーの期待損失額に千二百五十パーセントのリスク・ウェイトを乗じて得た額及び第百五十四条の二から第百五十四条の四までの規定により算出される信用リスク・アセットの額の合計額」を加え、同条第二号中「第十九条」を「第十九条第一項（第一号に係る部分に限る。）」に改め、「おいて、」の下に「同項中」を加え、同条に次の二号を加える。

三　第六章の二に定めるところにより算出したＣＶＡリスク相当額を八パーセントで除して得た額

四　第六章の三に定めるところにより算出した第十九条第一項第三号に規定する中央清算機関関連エクスポージャーに係る信用リスク・アセットの額

第百二十七条第二項中「前項第三号」を「前項の規定にかかわらず、同項第三号」に改め、同条第七項中「おいて、」の下に「同条中」を加え、「第百二十七条第六項により読み替え後の第百十条」を「第百二十七条第七項において読み替えて準用する第百十条」に改め、同項を同条第八項とし、同条第六項中「おいて、」の下に「同条中」を加え、「第三項」を「第四項」に、「二千五百パーセント」を「千二百五十パーセント」に改め、同項を同条第七項とし、同条第五項中「EAD）に」を「EADをいう。）に当該」に改め、同項を同条第六項とし、同条第四項を同条第五項とし、同条第三項中「EAD」を「EADをいう。」に改め、同項を同条第四項とし、同条第二項の次に次の一項を加える。

3　内部格付手法採用組合は、大規模規制金融機関等向けエクスポージャー（中堅中小企業向けエクスポージャーに該当するものを含む。）の信用リスク・アセットの額を算出する場合は、前二項の規定にかかわらず、第一項第三号又は前項に定める相関係数に代えて、これらの規定に定める相関係数に一・二五を乗じて得た値を、それぞれ相関係数として用いるものとする。

第百二十八条第一項中「（基礎的内部格付手法採用組合の場合は、第九十七条各号に掲げるもの又は4－2以上の信用リスク区分に対応するPDに相当するPDが割り当てられた内部格付を付与されたものが提供するものに限る。）」を削る。

第百二十九条第二項第三号中「（保険業法（平成七年法律第百五号）第二条第二項に規定する保険会社をいう。以下同じ。）」を削り、「同条第六項」を「保険業法第二条第六項」に、「すべて」を「全て」に改め、同号イ中「（金融商品取引業等に関する内閣府令を含む。）」を削り、同条第三項第四号中「第百二十七条第一項第三号、同条第二項又は第四項に規定する」を「第百二十七条に定める」に改める。

第百三十二条に次の一項を加える。

6　内部格付手法採用組合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。

$$掛目=\sqrt{(Tm/10)}$$

Tmは、第五十三条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。