二　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

三　第六章の三に定めるところにより算出した第二百四十六条の五各号に掲げるエクスポージャー（以下「中央清算機関関連エクスポージャー」という。）に係る信用リスク・アセットの額

2　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金融商品取引法第二条第二十七項に規定する有価証券等清算取次ぎ、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商品先物取引法第二条第二十項に規定する商品清算取引その他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取次ぎ又はこれらに類する海外の取引（以下「清算取次ぎ等」という。）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信用リスク・アセットの額について、第百十三条の二の規定により算出する場合には、前項第一号の合計額の算出に当たって、当該トレード・エクスポージャーに係る信用リスク・アセットの額として、同条の規定により算出された信用リスク・アセットの額を用いるものとする。

第三十五条中「当該」を「その」に改め、「（金融商品取引業等に関する内閣府令（平成十九年内閣府令第五十二号）を含む。）」を削る。

第三十六条第二項ただし書中「当該」を「その」に改める。

第四十七条の次に次の三条を加える。

（重要な出資のエクスポージャー）

第四十七条の二　第二十七条から前条までの規定にかかわらず、総株主等の議決権の百分の十を超える議決権を保有している法人等（営利を目的とする者に限り、その他金融機関等（単体自己資本比率（第二条に規定する単体自己資本比率をいう。以下この条及び次条において同じ。）を算出する場合にあっては第五条第五項第一号に規定するその他金融機関等をいい、連結自己資本比率（第十条に規定する連結自己資本比率をいう。以下この条及び次条において同じ。）を算出する場合にあっては第十三条第六項第一号に規定するその他金融機関等をいう。）を除く。）に係る出資（令第十条第五項第三号に規定する出資をいう。）（次項及び第百五十四条の二において「対象出資」という。）のうち重要な出資に係る十五パーセント基準額（単体自己資本比率を算出する場合にあっては第二条の算式における自己資本の額（以下この条及び第百五十四条の二の規定の適用がないものとして算出した額とする。次項において同じ。）に十五パーセントを乗じて得た額をいう。次項において同じ。）を上回る部分に係るエクスポージャーのリスク・ウェイトは、千二百五十パーセントとする。

2　前項の場合において、対象出資のうち同項の規定により千二百五十パーセントのリスク・ウェイトが適用される額に対応する部分以外の部分の額の合計額が重要な出資に係る六十パーセント基準額（単体自己資本比率を算出する場合にあっては第二条の算式における自己資本の額に六十パーセントを乗じて得た額をいい、連結自己資本比率を算出する場合にあっては第十条の算式における自己資本の額に六十パーセントを乗じて得た額をいう。第百五十四条の二第二項において同じ。）を上回るときは、その上回る部分に係るエクスポージャーのリスク・ウェイトは、千二百五十パーセントとする。

（他の金融機関等の対象資本調達手段に係るエクスポージャー）

第四十七条の三　第二十七条から前条までの規定にかかわらず、他の金融機関等（単体自己資本比率を算出する場合にあっては第五条第三項に規定する他の金融機関等（連結自己資本比率を算出する場合にあっては、連結の範囲に含まれる者を除く。）をいい、連結自己資本比率を算出する場合にあっては第十三条第四項に規定する他の金融機関等をいう。次項及び第百五十四条の三において同じ。）の対象資本調達手段（単体自己資本比率を算出する場合にあっては第五条第三項に規定する対象資本調達手段をいい、連結自己資本比率を算出する場合にあっては第十三条第四項に規定する対象資本調達手段をいう。次項及び第百五十四条の三において同じ。）のうち、対象普通出資等（単体自己資本比率を算出する場合にあっては第五条第四項に規定する対象普通出資等をいい、連結自己資本比率を算出する場合にあっては第十三条第五項に規定する対象普通出資等をいう。第百五十四条の三第一項において同じ。）に該当するもの以外のものに係るエクスポージャーのリスク・ウェイトは、二百五十パーセントとする。

2　第二十七条から前条まで及び前項の規定にかかわらず、他の金融機関等の対象資本調達手段のうち第五条第三項各号に掲げる対象資本調達手段又は第十三条第四項各号に掲げる対象資本調達手段に係るエクスポージャーのリスク・ウェイトは、二百五十パーセントとする。

（特定項目のうち調整項目に算入されない部分に係るエクスポージャー）

第四十七条の四　第二十七条から前条までの規定にかかわらず、特定項目（第五条第六項第一号又は第十三条第七項第一号に規定する特定項目をいう。第百五十四条の四において同じ。）のうち第二条又は第十条の算式におけるコア資本に係る調整項目の額に算入されなかった部分に係るエクスポージャーのリスク・ウェイトは、二百五十パーセントとする。

第四十九条第二項中「四パーセント」を「八パーセント」に改める。

第五十条第四項第一号中「（マーケット・リスク相当額の算出対象であるものを除く。）」を削り、同条に次の二項を加える。

5　標準的手法採用組合は、この節における与信相当額の算出に当たっては、ＣＶＡの影響を勘案してはならない。

6　前項の規定にかかわらず、標準的手法採用組合は、信用リスク・アセットの額の算出において、与信相当額についてＣＶＡの影響を勘案することができる。

第五十三条第二項中「この条、第五十三条の三第十一号及び第百三十三条第七項において」を削り、「すべて」を「全て」に改め、同条第五項を次のように改め、同項を同条第六項とする。

5　標準的手法採用組合は、前項に規定する方法に代えて、次に掲げる額のうち、いずれか小さい額を第二項第二号に規定する実効EPEとする方法を使用することができる。

一　ネッティング・セットに係る取引相手方に対するマージン・アグリーメントに基づく担保による効果を反映しない場合の実効EPEに当該取引相手方に提供される全ての担保（日々の値洗いによりその額が調整されるものを除く。）の額を加えた額

二　次のイの算式により算出されたアドオンにロ又はハに掲げる額のうちいずれか大きい額を加えた額

イ　アドオン＝E［max（ΔMtM, 0）］

E［　］は、［　］内の期待値

ΔMtMは、リスクのマージン期間（マージン・アグリーメントに基づき取引相手方から担保の提供を受けた時点から当該取引相手方のデフォルトに伴い発生した当該取引相手方との取引に係るマーケット・リスクに対するヘッジが完了する時点までの期間をいう。）内における取引相手方との取引の時価の変化額。ただし、マージン・アグリーメントに基づく担保による効果を勘案してはならない。

ロ　マージン・アグリーメントに基づき提供をし、又は提供を受けた担保（コールされたもの及び係争中のものを除く。）による効果を反映した場合のネッティング・セットの現時点のエクスポージャーの額

ハ　マージン・アグリーメントに基づき提供をし、又は提供を受ける担保による効果を反映した場合のネッティング・セットにおいて生じ得る最大のエクスポージャーの額