（期待エクスポージャー方式）

第七十九条の三　［略］

2　［略］

3　標準的手法採用行は、前項第一号に掲げる与信相当額の算出に当たっては、ポートフォリオごとに、現在の市場データを用いて算出した実効EPE又は適切なストレス期間を含むデータを用いて算出した実効EPEのうち、所要自己資本が大きくなるものを用いるものとする。

4　［略］

3　リスク・ポジションは、次の各号に定める方法に従いヘッジ・セットに区分するものとする。

一　株式（株式指数を含む。）、金、貴金属又はその他のコモディティを原資産とする取引については、支払部分のリスク・ポジションを金利リスクに関するヘッジ・セットに区分し、それ以外のリスク・ポジションを原資産に関するヘッジ・セットに区分する。

二　負債性商品を原資産とする取引については、当該負債性商品と支払部分のそれぞれのリスク・ポジションを、金利リスクに関するヘッジ・セットに区分する。

三　支払同士を交換する取引（為替先渡取引を含む。）については、各支払部分のリスク・ポジションを金利リスクに関するヘッジ・セットに区分する。

四　負債性商品又は支払部分が外国通貨建ての場合、リスク・ポジションを当該通貨の外国為替に関するヘッジ・セットにも区分する。

4　CCFは、次の各号に定めるものとする。

一　負債性商品以外のものを原資産とする場合、CCFは、その原資産の種類に応じ、それぞれ左欄に掲げる掛目とする。

原資産	金	株式	貴金属（金を除く。）	電力	コモディティ（貴金属及び電力を除く。）
掛目（パーセント）	五	七	八・五	四	十

二　負債性商品を原資産とする場合、CCFは、その原資産の種類に応じ、それぞれ左欄に掲げる掛目とする。

原資産	個別リスクの高い負債性商品	個別リスクの低い負債性商品（クレジット・デフォルト・スワップに係るリスク・ポジションに限る。）	その他
掛目（パーセント）	〇・六	〇・三	〇・二

三　外国為替に関するCCFは、二・五パーセントとする。

四　前三号に該当しないものの場合、CCFは十パーセントとする。

（期待エクスポージャー方式）

第七十九条の四　［同上］

2　［同上］

3　標準的手法採用行は、前項第一号に掲げる与信相当額の算出に当たっては、ポートフォリオごとに、現在の市場データを用いて算出した実効EPE又は適切なストレス期間を含むデータを用いて算出した実効EPEのうち、所要自己資本が大きくなるものを用いなければならない。

4　［同上］