（変更に係る届出）

第七十九条の三の四　期待エクスポージャー方式の使用について承認を受けた標準的手法採用行は、次の各号のいずれかに該当する場合には、遅滞なく、その旨及びその内容を金融庁長官に届け出るものとする。

［一～三　略］

2　前項第三号に基づく届出を行う場合には、標準的手法採用行は、当該標準的手法採用行が承認の基準を満たさない事項に関する改善計画を当該届出と併せて、又はその後速やかに提出するものとする。

（承認の取消し）

第七十九条の三の五　金融庁長官は、期待エクスポージャー方式の使用について承認を受けた標準的手法採用行が前条第一項第二号の届出を怠った場合又は同項第三号に該当する場合には、第七十九条の三第一項の承認を取り消すことができる。

（段階的適用等）

第七十九条の三の六　期待エクスポージャー方式の使用について承認を受けた標準的手法採用行は、全ての派生商品取引又は全てのレポ形式の取引について期待エクスポージャー方式を適用するものとする。ただし、期待エクスポージャー方式の適用を開始した後の一定の期間について、一部の取引の与信相当額について期待エクスポージャー方式を適用しない旨を第七十九条の三の二第二項第四号に掲げる期待エクスポージャー方式実施計画に定めている場合は、この限りでない。

2　［略］

（カレント・エクスポージャー方式）

第七十九条の四　標準的手法採用行が第七十九条第二項の規定によりカレント・エクスポージャー方式を用いる場合には、再構築コストの額及びアドオンの額を合計することにより与信相当額を算出するものとする。

2　前項の再構築コストの額は、次の各号に掲げるいずれかの額とする。ただし、第二号に掲げる額については、法的に有効な相対ネッティング契約下にある取引において用いる場合に限る。

一　派生商品取引を時価評価することにより算出した再構築コストの額（零を下回る場合には、零とする。）

二　ネット再構築コストの額（零を下回る場合には、零とする。）

3　第一項のアドオンの額は、次の各号に掲げるいずれかの額とする。ただし、第二号に掲げる額については、法的に有効な相対ネッティング契約下にある取引において用いる場合に限る。

一　次のイ又はロに掲げる額（以下「グロスのアドオン」という。）

イ　派生商品取引（クレジット・デリバティブを除く。）については、次の表の上欄に掲げる取引の区分及び同表の中欄に掲げる残存期間の区分に応じ、当該取引の想定元本額に同表の下欄に定める掛目（元本を複数回交換する取引にあっては、各掛目に残存交換回数を乗ずるものとする。）を乗じて得た額

取引の区分	残存期間の区分	掛　目（パーセント）
外国為替関連取引及び金関連取引	一年以内	一・〇
	一年超五年以内	五・〇
	五年超	七・五

（変更に係る届出）

第七十九条の四の四　期待エクスポージャー方式の使用について承認を受けた標準的手法採用行は、次の各号のいずれかに該当する場合には、遅滞なく、その旨及びその内容を金融庁長官に届け出なければならない。

［一～三　同上］

2　前項第三号に基づく届出を行う場合には、標準的手法採用行は、当該標準的手法採用行が承認の基準を満たさない事項に関する改善計画を当該届出とあわせて、又はその後速やかに提出しなければならない。

（承認の取消し）

第七十九条の四の五　金融庁長官は、期待エクスポージャー方式の使用について承認を受けた標準的手法採用行が前条第一項第二号の届出を怠った場合又は同項第三号に該当する場合には、第七十九条の四第一項の承認を取り消すことができる。

（段階的適用等）

第七十九条の四の六　期待エクスポージャー方式の使用について承認を受けた標準的手法採用行は、すべての派生商品取引又はすべてのレポ形式の取引について期待エクスポージャー方式を適用しなければならない。ただし、期待エクスポージャー方式の適用を開始した後の一定の期間について、一部の取引の与信相当額について期待エクスポージャー方式を適用しない旨を第七十九条の四の二第二項第四号に掲げる期待エクスポージャー方式実施計画に定めている場合は、この限りでない。

2　［同上］

［条を加える。］