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カレント・エクスポージャー方式を用いている場合には、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、第七十九条の三第七項の規定により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。

（事業法人等向けエクスポージャーのEAD）

第百五十七条　［略］

［2～4　略］

5　第七十九条（第二項及び第三項を除く。）から第七十九条の三の六までの規定は、事業法人等向けエクスポージャーのEADについて準用する。この場合において、これらの規定中「標準的手法採用行」とあるのは「内部格付手法採用行」と、第七十九条第四項中「前三項」とあるのは「第一項」と読み替えるものとする。

［項を削る。］

（マチュリティ）

第百五十八条　［略］

［2～5　略］

6　内部格付手法採用行が事業法人等向けエクスポージャーのEADについて第七十九条の三から第七十九条の三の六までの規定を準用する場合には、事業法人等向けエクスポージャーの信用リスク・アセットの額の算式に用いるマチュリティは、第一号に掲げる算式により算出された実効マチュリティとし、同号に掲げる実効EE_{ik}は第二号に掲げる算式により算出された額とする。ただし、実効マチュリティが一年に満たない場合には一年とし、五年を超える場合には五年とする。

［一・二　略］

［7・8　略］

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七十九条の四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、第七十九条の四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。

（事業法人等向けエクスポージャーのEAD）

第百五十七条　［同上］

［2～4　同上］

5　第七十九条から第七十九条の四の六までの規定は、事業法人等向けエクスポージャーのEADについて準用する。この場合において、「標準的手法採用行」とあるのは「内部格付手法採用行」と読み替えるものとする。

6　内部格付手法採用行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七十九条の四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、第七十九条の四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。

（マチュリティ）

第百五十八条　［同上］

［2～5　同上］

6　内部格付手法採用行が事業法人等向けエクスポージャーのEADについて第七十九条の四から第七十九条の四の六までの規定を準用する場合には、事業法人等向けエクスポージャーの信用リスク・アセットの額の算式に用いるマチュリティは、第一号に掲げる算式により算出された実効マチュリティとし、同号に掲げる実効EE_{ik}は第二号に掲げる算式により算出された額とする。ただし、実効マチュリティが一年に満たない場合には一年とし、五年を超える場合には五年とする。

［一・二　同上］

［7・8　同上］