（リテール向けエクスポージャーのEAD）

第百六十五条　［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、リテール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。］

（エクスポージャーの厚さ（T））

第二百六十条　［略］

2　エクスポージャーの厚さを計算するに当たって、金利スワップ又は通貨スワップから生じるエクスポージャーの計算においては第七十九条（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を準用する。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。

（ＣＶＡリスク相当額の算出）

第二百七十条の二　［略］

2　前項の規定にかかわらず、銀行が債券等（第二百八十一条に規定する債券等をいう。以下この章において同じ。）に係る個別リスクの算出について第二百七十二条の承認を受けており、かつ、第七十九条の三第一項（第百五十七条第五項又は第百六十五条第五項において準用する場合を含む。）の承認を受けている場合には、第三節に定める先進的リスク測定方式を用いて、次の各号に掲げる者以外の者を取引相手方とする派生商品取引に係るＣＶＡリスク相当額を算出しなければならない。

［一～三　略］

3　第一項の規定にかかわらず、次の各号に掲げる銀行のいずれにも該当しない国内基準行にあっては、第四節に定める簡便的リスク測定方式を用いて、同項各号に掲げる者以外の者を取引相手方とする派生商品取引に係るＣＶＡリスク相当額を算出することができる。

［一～三　略］

四　期待エクスポージャー方式の使用について第七十九条の三第一項（第百五十七条第五項又は第百六十五条第五項において準用する場合を含む。）の承認を受けた銀行

4　［略］

（標準的リスク測定方式によるＣＶＡリスク相当額）

第二百七十条の三　［略］

［2・3　略］

4　第一項のEAD$_{SA}$は、次の各号に掲げる場合の区分に応じ、当該各号に定める取引相手方に係るネッティング・セットごとに算出した額とする。

一　ＳＡ－ＣＣＲを用いる場合　第七十九条の二第一項に規定する与信相当額の割引現在価値

（リテール向けエクスポージャーのEAD）

第百六十五条　［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、リテール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　第百五十七条第六項の規定は、リテール向けエクスポージャーであって、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を算出する場合について準用する。

（エクスポージャーの厚さ（T））

第二百六十条　［同上］

2　エクスポージャーの厚さを計算するに当たって、金利スワップ又は通貨スワップから生じるエクスポージャーの計算においては第七十九条から第七十九条の四の六までの規定を準用する。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。

（ＣＶＡリスク相当額の算出）

第二百七十条の二　［同上］

2　前項の規定にかかわらず、銀行が債券等（第二百八十一条に規定する債券等をいう。以下この章において同じ。）に係る個別リスクの算出について第二百七十二条の承認を受けており、かつ、第七十九条の四第一項（第百五十七条第五項又は第百六十五条第五項において準用する場合を含む。）の承認を受けている場合には、第三節に定める先進的リスク測定方式を用いて、次の各号に掲げる者以外の者を取引相手方とする派生商品取引に係るＣＶＡリスク相当額を算出しなければならない。

［一～三　同上］

3　［同上］

［一～三　同上］

四　期待エクスポージャー方式の使用について第七十九条の四第一項（第百五十七条第五項又は第百六十五条第五項において準用する場合を含む。）の承認を受けた銀行

4　［同上］

（標準的リスク測定方式によるＣＶＡリスク相当額）

第二百七十条の三　［同上］

［2・3　同上］

4　［同上］

一　カレント・エクスポージャー方式を用いる場合　第六章第五節第三款に規定する包括的手法を使用する場合の信用リスク削減手法を適用した後のエクスポージャーの額の割引現在価値