「号を削る。」

二　期待エクスポージャー方式を用いる場合　第七十九条の三第二項に規定する与信相当額

三　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

5　第一項並びに前項第一号及び第三号の割引現在価値は、次に掲げる算式により算出するものとする。

（割引現在価値）＝（想定元本額又は与信相当額）×（1－EXP（－0.05×M_x））／（0.05×M_x）

M_xは、対応するM、M^{hedge}又はM_{ind}

6　［略］

7　第四項第三号に掲げる場合において、第一項のEAD^{total}（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・エクスポージャーに係るものに限る。）を算出する場合には、同号に定める額に次の掛目を乗じた額を、当該ネッティング・セットのEAD^{total}とすることができる。

掛目＝$\sqrt{（Tm/10）}$

Tmは、第七十九条の三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、同項中「前項」とあるのは「第二百七十条の三第七項」と、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　五営業日」と読み替えるものとする。

（先進的リスク測定方式によるＣＶＡリスク相当額）

第二百七十条の四　［略］

［2～4　略］

［項を削る。］

5　［略］

6　［略］

（適用除外）

第二百七十条の五　［略］

2　第二百七十条の二第二項に規定する場合において、期待エクスポージャー方式を用いないで与信相当額を算出する特定のポートフォリオに含まれる派生商品取引については、あらかじめ金融庁長官に届け出た場合に限り、当該派生商品取引に係るＣＶＡリスク相当額を前節に定める標準的リスク測定方式を用いて算出することができる。

（中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー及び直接清算参加者向けトレード・エクスポージャーの信用リスク・アセット）

第二百七十条の七　第六章（第七十九条の二第四項第二号及び第三号を除く。）の規定は、中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー及び直接清算参加者向けトレード・エクスポージャーの信用リスク・アセットの額の算出について準用する。この場合において、同章（第七十九条第二項及び第三項を除く。）の規定中「標準的手法採用行」とあるのは「銀行」と読み替えるものとする。

二　標準方式を用いる場合　第七十九条の三に規定する与信相当額の割引現在価値

三　期待エクスポージャー方式を用いる場合　第七十九条の四第二項に規定する与信相当額

［号を加える。］

5　第一項並びに前項第一号及び第二号の割引現在価値は、次に掲げる算式により算出するものとする。

（割引現在価値）＝（想定元本額又は与信相当額）×（1－EXP（－0.05×M_x））／（0.05×M_x）

M_xは、対応するM、M^{hedge}又はM_{ind}

6　［同上］

7　第四項第一号又は第二号に掲げる場合において、第一項のEAD^{total}（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・エクスポージャーに係るものに限る。）を算出する場合には、第四項第一号又は第二号に定める額に次の掛目を乗じた額を、当該ネッティング・セットのEAD^{total}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。

（先進的リスク測定方式によるＣＶＡリスク相当額）

第二百七十条の四　［同上］

［2～4　同上］

5　前項の規定にかかわらず、第七十九条の四第六項（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。）に規定する方法を使用する場合には、ネッティング・セットにおける最も長いマチュリティの二分の一に相当する期間又は当該ネッティング・セットに含まれる全ての派生商品取引に係る想定元本額の名目額により加重平均したマチュリティのいずれか大きい期間をt_fとし、当該ネッティング・セットの実効EPEをEEとしなければならない。

6　［同上］

7　［同上］

（適用除外）

第二百七十条の五　［同上］

2　カレント・エクスポージャー方式又は標準方式を用いて与信相当額を算出する特定のポートフォリオに含まれる派生商品取引については、あらかじめ金融庁長官に届け出た場合に限り、当該派生商品取引に係るＣＶＡリスク相当額を前節に定める標準的リスク測定方式を用いて算出することができる。

（中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー及び直接清算参加者向けトレード・エクスポージャーの信用リスク・アセット）

第二百七十条の七　第六章の規定は、中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー及び直接清算参加者向けトレード・エクスポージャーの信用リスク・アセットの額の算出について準用する。この場合において、「標準的手法採用行」とあるのは「銀行」と読み替えるものとする。