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について第五十七条の三から第五十七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額とした実効マチュリティとし、同号に掲げる$\max\{EE_{tk}$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］

（リテール向けエクスポージャーのEAD）

第百四十三条　［略］

［2～4　略］

5　第五十七条（第二項及び第三項を除く。）から第五十七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、第五十七条第四項中「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））

第二百三十八条　［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五十七条（第二項及び第三項を除く。）から第五十七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、第五十七条第四項中「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）

第二百四十八条の二　［略］

2　前項の規定にかかわらず、銀行持株会社が債券等（第二百五十九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二百五十条の承認を受けており、かつ、第五十七条の三第一項（第百三十五条第五項又は第百四十三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持株会社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五十七条の三第一項（第百三十五条第五項又は第百四十三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持株会社

4　［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について第五十七条の四から第五十七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$\max\{EE_{tk}$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］

（リテール向けエクスポージャーのEAD）

第百四十三条　［同上］

［2～4　同上］

5　第五十七条から第五十七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‖　第百三十五条第六項の規定は、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））

第二百三十八条　［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五十七条から第五十七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）

第二百四十八条の二　［同上］

2　前項の規定にかかわらず、銀行持株会社が債券等（第二百五十九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二百五十条の承認を受けており、かつ、第五十七条の四第一項（第百三十五条第五項又は第百四十三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五十七条の四第一項（第百三十五条第五項又は第百四十三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持株会社

4　［同上］