7　前項のリスクのマージン期間は、次の各号に掲げるネッティング・セットの区分に応じ、当該各号に定めるところによる。

一　［略］

二　N（二以上の整数とする。）日ごとの値洗いにより担保の額が調整されるネッティング・セット　F+N−1

F は前号の規定により算出されるリスクのマージン期間

8　前項の規定にかかわらず、算出基準日を含む四半期の前の直近の連続する二の四半期の間に、同項第一号イからニまで又は第二号に掲げるいずれかのネッティング・セットについて、担保額調整に係る係争により、同項のリスクのマージン期間を超える清算期間を要する場合が三回以上生じた場合には、次の連続する二の四半期の間は、当該ネッティング・セットについては、同項のリスクのマージン期間の少なくとも二倍以上の期間をリスクのマージン期間とする。

9　標準的手法を採用する信用協同組合等は、ネッティング・セットを構成する取引において、取引相手方及び参照企業の間に法的な関係が存在し、かつ、個別誤方向リスク（特定の取引相手方に対する将来のエクスポージャーの額が、当該取引相手方のPDと高い相関を持って増減するリスクをいう。以下同じ。）が特定された場合には、当該取引を当該ネッティング・セットから除外するものとする。

10　標準的手法を採用する信用協同組合等は、取引相手方及び参照企業の間に法的な関係が存在し、かつ、個別誤方向リスクが特定された取引に係る信用リスク・アセットの額の算出においては、当該個別誤方向リスクの特性を勘案するものとする。

11　標準的手法を採用する信用協同組合等は、マージン・アグリーメントにより提供をし、又は提供を受ける担保が現金以外の資産を含む場合には、当該担保の価格変動を適切に反映するものとする。

［12・13　略］

（承認申請書の提出）

第五十二条の二　期待エクスポージャー方式の使用について前条第一項の承認を受けようとする信用協同組合等は、次に掲げる事項を記載した承認申請書を金融庁長官に提出するものとする。

［一・二　略］

2　前項の承認申請書には、次に掲げる書類を添付するものとする。

［一～五　略］

3　前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は、次に掲げる事項を記載するものとする。

［一・二　略］

ロ　マージン・アグリーメントに基づき提供をし、又は提供を受けた担保（コールされたもの及び係争中のものを除く。）による効果を反映した場合のネッティング・セットの現時点のエクスポージャーの額

ハ　マージン・アグリーメントに基づき提供をし、又は提供を受ける担保による効果を反映した場合のネッティング・セットにおいて生じ得る最大のエクスポージャーの額

7　前項第二号イのリスクのマージン期間は、次の各号に掲げるネッティング・セットの区分に応じ、当該各号に定めるところによる。

一　［同上］

二　N日ごとの値洗いにより担保の額が調整されるネッティング・セット　F+N−1

F は前号の規定により算出されるリスクのマージン期間

8　前項の規定にかかわらず、算出基準日を含む四半期の前の直近の連続する二の四半期の間に、同項第一号イからニまで又は第二号に掲げるいずれかのネッティング・セットについて、担保額調整（エクスポージャーと担保の価格変動に伴う信用供与額の変化を担保額によって調整する仕組みをいう。以下同じ。）に係る係争により、同項のリスクのマージン期間を超える清算期間を要する場合が三回以上生じた場合には、次の連続する二の四半期の間は、当該ネッティング・セットについては、同項のリスクのマージン期間の少なくとも二倍以上の期間をリスクのマージン期間とする。

9　標準的手法を採用する信用協同組合等は、ネッティング・セットを構成する取引において、取引相手方及び参照企業の間に法的な関係が存在し、かつ、個別誤方向リスク（特定の取引相手方に対する将来のエクスポージャーの額が、当該取引相手方のPDと高い相関を持って増減するリスクをいう。以下同じ。）が特定された場合には、当該取引を当該ネッティング・セットから除外しなければならない。

10　標準的手法を採用する信用協同組合等は、取引相手方及び参照企業の間に法的な関係が存在し、かつ、個別誤方向リスクが特定された取引に係る信用リスク・アセットの額の算出においては、当該個別誤方向リスクの特性を勘案しなければならない。

11　標準的手法を採用する信用協同組合等は、マージン・アグリーメントにより提供をし、又は提供を受ける担保が現金以外の資産を含む場合には、当該担保の価格変動を適切に反映しなければならない。

［12・13　同上］

（承認申請書の提出）

第五十三条の二　期待エクスポージャー方式の使用について前条第一項の承認を受けようとする信用協同組合等は、次に掲げる事項を記載した承認申請書を金融庁長官に提出しなければならない。

［一・二　同上］

2　前項の承認申請書には、次に掲げる書類を添付しなければならない。

［一～五　同上］

3　前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は、次に掲げる事項を記載しなければならない。

［一・二　同上］