（標準的リスク測定方式によるＣＶＡリスク相当額）

**第二百四十六条の三**　［略］

［２・３　略］

４　第一項のEAD$^{total}$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　第五十一条第一項に規定する与信相当額の割引現在価値

二　期待エクスポージャー方式を用いる場合　第五十二条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　第四章第六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、第五十三条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。

（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）

**第二百四十六条の六**　第四章（第五十一条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（第五十条第二項及び第三項を除く。）の規定中「標準的手法を採用する信用協同組合等」とあるのは「信用協同組合等」と読み替えるものとする。

２　前項の規定にかかわらず、次の各号に掲げるトレード・エクスポージャーの信用リスク・アセットの額を算出する場合における当該トレード・エクスポージャーのリスク・ウェイトは、二パーセントとする。

（標準的リスク測定方式によるＣＶＡリスク相当額）

**第二百四十六条の三**　［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　第四章第六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

二　標準方式を用いる場合　第五十二条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　第五十三条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、第五十三条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。

（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）

**第二百四十六条の六**　第四章の規定は、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、「標準的手法を採用する信用協同組合等」とあるのは「信用協同組合等」と読み替えるものとする。

２　前項の規定にかかわらず、次の各号に掲げるトレード・エクスポージャーの信用リスク・アセットの額を算出する場合、当該トレード・エクスポージャーのリスク・ウェイトは、二パーセントとする。また、次の各号に掲げるトレード・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前項の規定に基づき第四章の規定を準用する場合において、第五十三条第七項第一号中「イからニまで」とあるのは「イ、ロ又はニ」と、同号イ中「ロ又はハ」とある