ハ　算出基準日を含む最終指定親会社四半期の一期前の最終指定親会社四半期内のいずれかの時点で取引件数が五千件を超えたネッティング・セット　二十営業日

ニ　［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、算出基準日を含む最終指定親会社四半期の前の直近の連続する二の最終指定親会社四半期の間に、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、次の連続する二の最終指定親会社四半期の間は、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　標準的手法採用最終指定親会社は、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　標準的手法採用最終指定親会社は、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　標準的手法採用最終指定親会社は、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　［略］

13　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法第二条第二十七項に規定する有価証券等清算取次ぎ、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商品先物取引法第二条第二十項に規定する商品清算取引その他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取次ぎ又はこれらに類する海外の取引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ついては、第七項第一号の定めにかかわらず、同号に掲げるネッティング・セットのリスクのマージン期間を五営業日とすることができる。

（承認申請書の提出）

第五十条　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最終指定親会社は、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］

ハ　算出基準日を含む最終指定親会社四半期（法第五十七条の十七第二項に規定する最終指定親会社四半期をいう。以下同じ。）の一期前の最終指定親会社四半期内のいずれかの時点で取引件数が五千件を超えたネッティング・セット　二十営業日

ニ　［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、算出基準日を含む最終指定親会社四半期の前の直近の連続する二の最終指定親会社四半期の間に、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、次の連続する二の最終指定親会社四半期の間は、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　標準的手法採用最終指定親会社は、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　標準的手法採用最終指定親会社は、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　標準的手法採用最終指定親会社は、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　［同上］

13　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ついては、第七項第一号の定めにかかわらず、同号に掲げるネッティング・セットのリスクのマージン期間を五営業日とすることができる。

（承認申請書の提出）

第五十条　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最終指定親会社は、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］