（承認の基準）

第五十一条　金融庁長官は、期待エクスポージャー方式の使用について第四十九条第一項の承認をしようとするときは、次に掲げる基準に適合する期待エクスポージャー計測モデルが当該承認に先立って一年以上にわたって内部管理において運用されており、かつ、期待エクスポージャー方式の使用を開始する日以降において、内部管理に関する体制が当該基準に適合することが見込まれるかどうかを審査するものとする。

［一～三　略］

四　期待エクスポージャー計測モデルが、当該モデルの開発から独立し、かつ、十分な能力を有する者により、開発時点及びその後定期的に、かつ、期待エクスポージャー計測モデルへの重要な変更、市場の構造的な変化又はポートフォリオ構成の大きな変化によって期待エクスポージャー計測モデルの正確性が失われるおそれが生じた場合に検証されており、かつ、当該モデルが適切に見直されるための体制を整備していること。この場合において、当該検証は次に掲げる事項を含むものとする。

［イ～ハ　略］

［五～十四　略］

（変更に係る届出）

第五十二条　期待エクスポージャー方式の使用について承認を受けた標準的手法採用最終指定親会社は、次の各号のいずれかに該当する場合には、遅滞なく、その旨及びその内容を金融庁長官に届け出るものとする。

［一～三　略］

2　前項第三号に基づく届出を行う場合には、標準的手法採用最終指定親会社は、当該標準的手法採用最終指定親会社が承認の基準を満たさない事項に関する改善計画を当該届出と併せて、又はその後速やかに提出するものとする。

（段階的適用等）

第五十四条　期待エクスポージャー方式の使用について承認を受けた標準的手法採用最終指定親会社は、全ての派生商品取引又は全てのレポ形式の取引について期待エクスポージャー方式を適用するものとする。ただし、期待エクスポージャー方式の適用を開始した後の一定の期間について、一部の取引の与信相当額について期待エクスポージャー方式を適用しない旨を第五十条第二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定めている場合は、この限りでない。

2　［略］

（標準的ボラティリティ調整率）

第七十条　標準的手法採用最終指定親会社が標準的ボラティリティ調整率を用いる場合において、包括的手法の計算の対象とする取引について毎営業日の時価評価又は担保額調整を行っており、かつ、保有期間（ボラティリティ調整率を計算する際に、当該資産を保有すると仮定する期間をいう。以下この目から第四目までにおいて同じ。）が十営業日のときに用いるボラティリティ調整率は、次の各号に掲げる場合において、当該各号に定めるものとする。

一　［略］

（承認の基準）

第五十一条　金融庁長官は、期待エクスポージャー方式の使用について第四十九条第一項の承認をしようとするときは、次に掲げる基準に適合する期待エクスポージャー計測モデルが当該承認に先立って一年以上にわたって内部管理において運用されており、かつ、期待エクスポージャー方式の使用を開始する日以降において、内部管理に関する体制が当該基準に適合することが見込まれるかどうかを審査しなければならない。

［一～三　同上］

四　期待エクスポージャー計測モデルが、当該モデルの開発から独立し、かつ、十分な能力を有する者により、開発時点及びその後定期的に、かつ、期待エクスポージャー計測モデルへの重要な変更、市場の構造的な変化又はポートフォリオ構成の大きな変化によって期待エクスポージャー計測モデルの正確性が失われるおそれが生じた場合に検証されており、かつ、当該モデルが適切に見直されるための体制を整備していること。この場合において、当該検証は次に掲げる事項を含まなければならない。

［イ～ハ　同上］

［五～十四　同上］

（変更に係る届出）

第五十二条　期待エクスポージャー方式の使用について承認を受けた標準的手法採用最終指定親会社は、次の各号のいずれかに該当する場合には、遅滞なく、その旨及びその内容を金融庁長官に届け出なければならない。

［一～三　同上］

2　前項第三号に基づく届出を行う場合には、標準的手法採用最終指定親会社は、当該標準的手法採用最終指定親会社が承認の基準を満たさない事項に関する改善計画を当該届出とあわせて、又はその後速やかに提出しなければならない。

（段階的適用等）

第五十四条　期待エクスポージャー方式の使用について承認を受けた標準的手法採用最終指定親会社は、すべての派生商品取引又はすべてのレポ形式の取引について期待エクスポージャー方式を適用しなければならない。ただし、期待エクスポージャー方式の適用を開始した後の一定の期間について、一部の取引の与信相当額について期待エクスポージャー方式を適用しない旨を第五十条第二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定めている場合は、この限りでない。

2　［同上］

（標準的ボラティリティ調整率）

第七十条　［同上］

一　［同上］