（リテール向けエクスポージャーのEAD）

**第百四十二条**　［略］

［2～5　略］

［項を削る。］

（標準的リスク測定方式によるＣＶＡリスク相当額）

**第二百四十八条の三**　［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　第四十七条第一項に規定する与信相当額の割引現在価値

［号を削る。］

二　［略］

5　第一項並びに前項第一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。

$$\text{（割引現在価値）} = \text{（想定元本額又は与信相当額）} \times \left(1 - \mathrm{EXP}\left(-0.05 \times M_k\right)\right) \Big/ \left(0.05 \times M_k\right)$$

$M_k$は、対応する$M$、$M^{hedge}$又は$M_{ind}$

6　［略］

［項を削る。］

（先進的リスク測定方式によるＣＶＡリスク相当額）

**第二百四十八条の四**　［略］

［2～4　略］

［項を削る。］

5　［略］

6　［略］

（リテール向けエクスポージャーのEAD）

**第百四十二条**　［同上］

［2～5　同上］

6　第百三十四条第六項の規定は、リテール向けエクスポージャーであって、内部格付手法採用最終指定親会社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。

（標準的リスク測定方式によるＣＶＡリスク相当額）

**第二百四十八条の三**　［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　第三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　第四十八条に規定する与信相当額の割引現在価値

三　［同上］

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。

$$\text{（割引現在価値）} = \text{（想定元本額又は与信相当額）} \times \left(1 - \mathrm{EXP}\left(-0.05 \times M_k\right)\right) \Big/ \left(0.05 \times M_k\right)$$

$M_k$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、第四十九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。

（先進的リスク測定方式によるＣＶＡリスク相当額）

**第二百四十八条の四**　［同上］

［2～4　同上］

5　前項の規定にかかわらず、第四十九条第六項（第百三十四条第五項又は第百四十二条第五項において準用する場合を含む。）に規定する方法を使用する場合には、ネッティング・セットにおける最も長いマチュリティの二分の一に相当する期間又は当該ネッティング・セットに含まれる全ての派生商品取引に係る想定元本額の名目額により加重平均したマチュリティのいずれか大きい期間を$t_T$とし、当該ネッティング・セットの実効EPEをEE$_T$としなければならない。

6　［同上］

7　［同上］